

運用報告書 (全体版)

MHAM USインカムオープン毎月決算コース (為替ヘッジなし)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2001年12月3日から無期限です。	
運用方針	主として、米国の国債、アセットバック証券等の高格付け債や転換社債等の株式関連債およびハイイールド債に投資し、信託財産の中・長期的な成長を目指します。	
主要投資対象	MHAM USインカムオープン毎月決算コース(為替ヘッジなし)	LA USインカムマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、債券等に直接投資する場合もあります。
	LA USインカムマザーファンド	米国の国債、アセットバック証券等の高格付け債や転換社債等の株式関連債およびハイイールド債を主要投資対象とします。
運用方法	米国の債券市場3セクター(高格付け債・株式関連債・ハイイールド債)に分散投資します。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 LA USインカムマザーファンドにおける運用指図に関する権限をロード・アベット・アンド・カンパニー エルエルシーに委託します。	
組入制限	MHAM USインカムオープン毎月決算コース(為替ヘッジなし)	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	LA USインカムマザーファンド	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。
分配方針	年12回(原則毎月10日)決算を行い、原則として配当等収益等を中心に分配を行います。ただし、基準価額水準によっては、売買益等が中心となる場合があります。収益分配に充てず信託財産に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。	

第270期	<決算日	2024年6月10日>
第271期	<決算日	2024年7月10日>
第272期	<決算日	2024年8月13日>
第273期	<決算日	2024年9月10日>
第274期	<決算日	2024年10月10日>
第275期	<決算日	2024年11月11日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAM USインカムオープン毎月決算コース(為替ヘッジなし)」は、2024年11月11日に第275期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<https://www.am-one.co.jp/>

MHAM USインカムオープン毎月決算コース (為替ヘッジなし)

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			高格付け債指数		ハイイールド債指数		株式関連債指数		株式組入比率	新株予約権付社債(転換社債)組入比率	公社債組入比率	純資産総額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(円換算ベース) 期中騰落率	(円換算ベース) 期中騰落率	(円換算ベース) 期中騰落率	(円換算ベース) 期中騰落率	(円換算ベース) 期中騰落率					
第42作成期	246期(2022年6月10日)	円	円	%										
	247期(2022年7月11日)	10,545	30	3.8	232.14	3.7	425.41	4.0	554.50	5.3	0.3	2.7	90.6	3,900
	248期(2022年8月10日)	10,417	30	△0.9	233.77	0.7	416.49	△2.1	545.83	△1.6	0.2	3.4	90.4	3,915
	249期(2022年9月12日)	10,603	30	2.1	236.20	1.0	433.09	4.0	568.82	4.2	0.2	9.5	85.3	4,020
	250期(2022年10月11日)	10,969	30	3.7	242.46	2.7	449.13	3.7	604.88	6.3	2.0	10.9	82.8	4,139
第43作成期	251期(2022年11月10日)	10,745	30	△1.8	238.94	△1.5	441.45	△1.7	577.13	△4.6	0.9	6.9	84.8	4,092
	252期(2022年12月12日)	10,743	30	0.3	236.99	△0.8	443.00	0.4	576.33	△0.1	-	6.9	87.0	4,105
	253期(2023年1月10日)	10,320	30	△3.7	231.82	△2.2	430.70	△2.8	551.80	△4.3	-	19.1	77.7	3,930
	254期(2023年2月10日)	9,956	30	△3.2	224.84	△3.0	421.36	△2.2	532.18	△3.6	0.2	15.7	79.0	3,858
	255期(2023年3月10日)	9,979	30	0.5	224.34	△0.2	425.23	0.9	556.11	4.5	-	14.2	81.8	3,896
第44作成期	256期(2023年4月10日)	10,063	30	1.1	228.18	1.7	431.47	1.5	559.51	0.6	-	10.1	86.0	3,962
	257期(2023年5月10日)	9,951	30	△0.8	231.30	1.4	426.76	△1.1	542.43	△3.1	-	7.2	87.6	3,925
	258期(2023年6月12日)	10,068	30	1.5	232.81	0.7	436.41	2.3	550.15	1.4	-	7.5	91.2	3,935
	259期(2023年7月10日)	10,341	30	3.0	237.91	2.2	453.87	4.0	587.77	6.8	0.0	10.5	86.2	4,037
	260期(2023年8月10日)	10,485	30	1.7	240.46	1.1	463.45	2.1	614.58	4.6	0.2	10.5	86.4	4,086
第45作成期	261期(2023年9月11日)	10,610	30	1.5	244.64	1.7	476.52	2.8	623.15	1.4	0.2	12.0	84.9	4,087
	262期(2023年10月10日)	10,791	30	2.0	247.41	1.1	487.42	2.3	631.06	1.3	0.7	17.6	78.4	4,140
	263期(2023年11月10日)	10,647	30	△1.1	243.16	△1.7	482.16	△1.1	617.38	△2.2	0.6	17.7	79.0	4,077
	264期(2023年12月11日)	10,882	30	2.5	251.37	3.4	501.76	4.1	616.52	△0.1	0.5	12.6	82.6	4,156
	265期(2024年1月10日)	10,741	30	△1.0	249.94	△0.6	496.78	△1.0	626.55	1.6	0.5	12.5	83.5	4,110
第46作成期	266期(2024年2月13日)	10,867	30	1.5	253.26	1.3	506.04	1.9	642.34	2.5	0.6	12.6	83.6	4,138
	267期(2024年3月11日)	11,311	30	4.4	260.24	2.8	526.98	4.1	674.65	5.0	-	13.5	79.8	4,344
	268期(2024年4月10日)	11,109	30	△1.5	258.03	△0.8	522.22	△0.9	666.11	△1.3	-	11.6	81.2	4,238
	269期(2024年5月10日)	11,469	30	3.5	264.16	2.4	540.63	3.5	693.20	4.1	-	14.8	81.1	4,345
	270期(2024年6月10日)	11,702	30	2.3	270.39	2.4	556.08	2.9	705.04	1.7	-	13.5	81.5	4,442
第47作成期	271期(2024年7月10日)	11,768	30	0.8	274.24	1.4	563.54	1.3	713.22	1.2	-	11.8	83.7	4,454
	272期(2024年8月13日)	12,204	30	4.0	285.39	4.1	585.76	3.9	742.95	4.2	-	11.7	86.1	4,594
	273期(2024年9月10日)	11,259	30	△7.5	266.91	△6.5	542.01	△7.5	676.06	△9.0	-	9.6	86.3	4,176
	274期(2024年10月10日)	11,092	30	△1.2	264.97	△0.7	538.64	△0.6	669.02	△1.0	-	9.4	87.3	4,083
	275期(2024年11月11日)	11,576	30	4.6	271.61	2.5	564.72	4.8	722.46	8.0	-	13.3	83.1	4,262
	275期(2024年11月11日)	11,956	30	3.5	276.44	1.8	583.11	3.3	769.35	6.5	-	15.2	81.5	4,384

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)組入比率」、「公社債組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 新株予約権証券は、株式組入比率に含まれます。

(注4) 高格付け債指数、ハイイールド債指数および株式関連債指数の名称は、各々ICE BofA US Corporate & Government Index、ICE BofA US Cash Pay High Yield IndexおよびICE BofA All US Convertibles Indexです(以下同じ)。

(注5) 各指数は、当社が独自に円換算したものです。なお、指数算出にあたっては基準価額への反映を考慮して前営業日の米ドルベースの指数値を当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場中値)で円換算し、設定日(2001年12月3日)を100として指数化しています(以下同じ)。

(注6) ICE Data Indices, LLC (「ICE Data」)、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、明示又は黙示のいずれかを問わず、インデックス、インデックス・データ、及びそれらに含まれ、関連し、又は派生する一切のデータを含めて、商品性又は特定の目的若しくは使用への適合性の保証を含む一切の表明及び保証を否認します。ICE Data、その関係会社又はそれらの第三者サプライヤーは、インデックス、インデックス・データ若しくはそれらの構成要素の適切性、正確性、適時性又は完全性について、なんら損害賠償又は責任を負わず、インデックス、インデックス・データ及びそれらの全ての構成要素は、現状有姿において提供されるものであり、自らの責任において使用いただくものです。ICE Data、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、アセットマネジメントOne(株)又はその製品若しくはサービスを後援、推薦又は推奨するものではありません(以下同じ)。

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

決算期	年月日	基準価額		高格付け債指数		ハイイールド債指数		株式関連債指数		株式組入比率	新株予約権付社債(転換社債)組入比率	公社債組入比率
		円	騰落率	(円換算ベース) (参考指数)	騰落率	(円換算ベース) (参考指数)	騰落率	(円換算ベース) (参考指数)	騰落率			
第270期	(期首)	円	%		%		%		%	%	%	%
	2024年5月10日	11,702	-	270.39	-	556.08	-	705.04	-	-	13.5	81.5
	5月末	11,733	0.3	271.65	0.5	559.25	0.6	711.70	0.9	-	13.9	82.2
第271期	(期首)											
	2024年6月10日	11,768	-	274.24	-	563.54	-	713.22	-	-	11.8	83.7
	6月末	12,143	3.2	283.91	3.5	580.93	3.1	739.61	3.7	-	11.9	85.2
第272期	(期首)											
	2024年7月10日	12,234	4.0	285.39	4.1	585.76	3.9	742.95	4.2	-	11.7	86.1
	7月末	11,583	△5.1	272.12	△4.6	559.58	△4.5	709.37	△4.5	-	10.8	85.4
第273期	(期首)											
	2024年8月13日	11,289	△7.5	266.91	△6.5	542.01	△7.5	676.06	△9.0	-	9.6	86.3
	8月末	11,259	-	266.91	-	542.01	-	676.06	-	-	9.6	86.3
第274期	(期首)											
	2024年9月10日	11,122	△1.2	264.97	△0.7	538.64	△0.6	669.02	△1.0	-	9.4	87.3
	9月末	11,188	△0.6	264.19	△1.0	541.27	△0.1	684.32	1.2	-	11.0	85.5
第275期	(期首)											
	2024年10月10日	11,092	-	264.97	-	538.64	-	669.02	-	-	9.4	87.3
	10月末	11,162	0.6	263.90	△0.4	542.05	0.6	689.73	3.1	-	12.6	83.3
第276期	(期首)											
	2024年11月11日	11,606	4.6	271.61	2.5	564.72	4.8	722.46	8.0	-	13.3	83.1
	11月末	11,576	-	271.61	-	564.72	-	722.46	-	-	13.3	83.1
第277期	2024年10月10日	11,838	2.3	276.74	1.9	581.33	2.9	752.79	4.2	-	13.0	83.2
	2024年11月11日	11,986	3.5	276.44	1.8	583.11	3.3	769.35	6.5	-	15.2	81.5

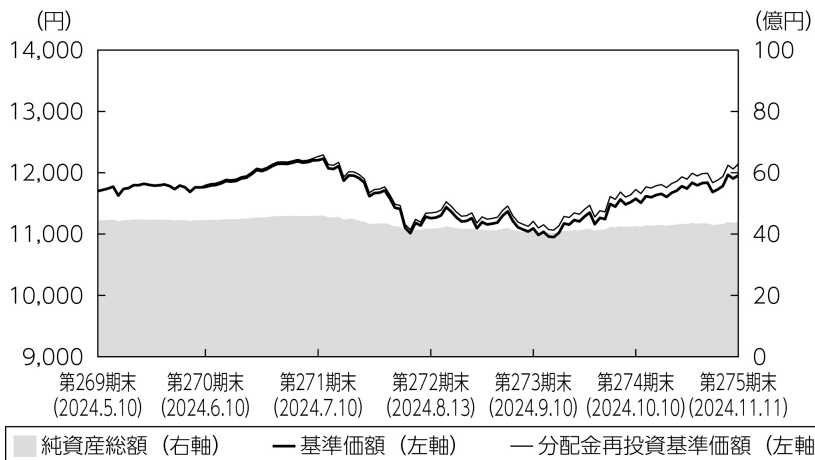
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)組入比率」、「公社債組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 新株予約権証券は、株式組入比率に含まれます。

■第270期～第275期の運用経過（2024年5月11日から2024年11月11日まで）

基準価額等の推移



第270期首： 11,702円
第275期末： 11,956円
（既払分配金180円）
騰落率： 3.8%
（分配金再投資ベース）

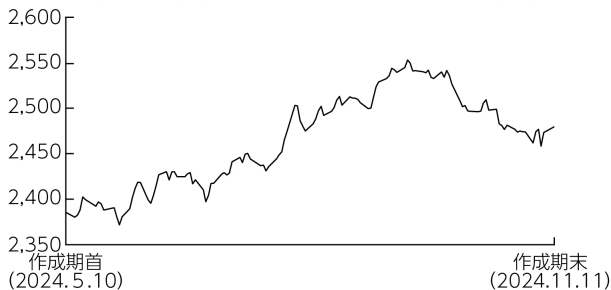
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

「LA USインカムマザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に米国の高格付け債やハイイールド債、転換社債等の株式関連債に投資した結果、高格付け債、ハイイールド債、株式関連債市場が上昇したことなどから、基準価額（税引前分配金再投資ベース）は上昇しました。

投資環境

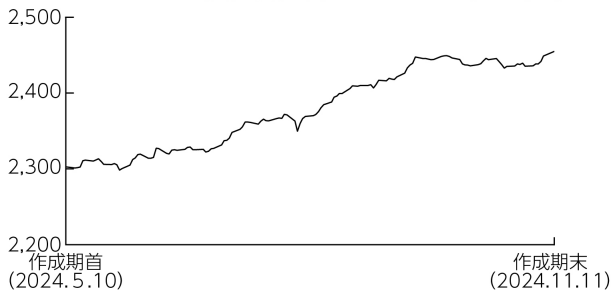
<高格付け債指数（米ドルベース）の推移>



<高格付け債>

米国高格付け債市場は、上昇しました。2024年9月中旬にかけては、米国で雇用統計や物価指標の下振れなどを背景に9月に利下げが実施されるとの観測が高まったことから上昇しました。しかしその後は、F R B（米連邦準備理事会）議長の発言や、堅調な雇用統計の発表などを受け、今後の利下げペースは緩やかなものに留まるとの観測が広がり上昇幅を一部縮小しました。

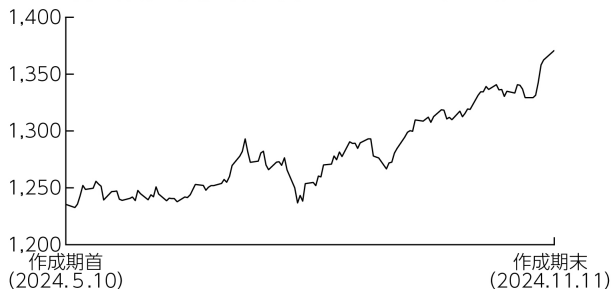
<ハイイールド債指数（米ドルベース）の推移>



<ハイイールド債>

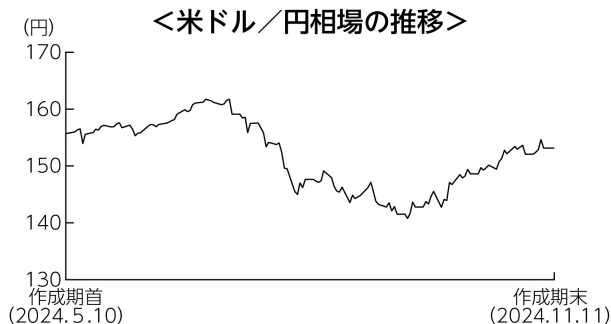
米国ハイイールド債市場は、上昇しました。2024年7月にかけては、米国で雇用統計の下振れなどを受け、早期利下げ観測が高まったことなどから上昇しました。8月上旬にはリスク回避姿勢の高まりから、一時下落する場面もありましたが、その後は、9月に利下げが実施されるとの観測が一段と高まり上昇基調を継続しました。

<株式関連債指数（米ドルベース）の推移>



<株式関連債>

米国株式関連債市場は、上昇しました。2024年7月中旬にかけては、米長期金利の低下や、A I（人工知能）向けの半導体需要への期待感などから上昇しました。その後は、米国による対中規制強化への懸念や雇用統計の下振れなどを受けた景気減速懸念などから下落する場面もありましたが、作成期末にかけては、大幅な利下げへの期待感や米大統領選でのトランプ氏勝利などが好感され上昇しました。



<為替市場>

米ドルは対円で下落しました。2024年7月上旬にかけては、日銀が金融政策の現状維持を決定したことなどから上昇しました。しかしその後は、米物価指標の伸びが下振れたなどを背景に9月に米国で利下げが実施されるとの観測や日銀による利上げ観測が高まったことなどから下落しました。作成期末にかけては、日銀が利上げを急がない姿勢を示したことや、堅調な米雇用統計の発表などを受け、下落幅を一部縮小しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

「L A US インカムマザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。また、組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行いませんでした。

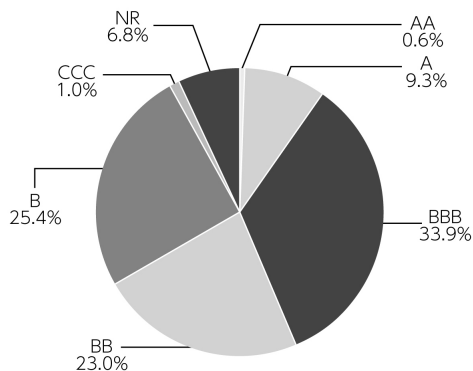
●L A US インカムマザーファンド

資産・債券種類別では、高格付け債およびハイイールド債の比率を高めとするポートフォリオを維持しました。格付け別では、B格やA格の比率を引き下げました。また、債券の組入比率は高位を維持しました。

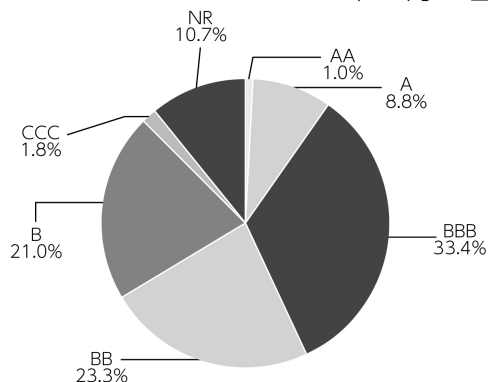
上記の運用を行った結果、高格付け債、ハイイールド債、株式関連債市場が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

<公社債の格付け別構成>

2024年5月10日現在



2024年11月11日現在



(注1) 格付け別構成は、マザーファンドの公社債現物に対する評価額の割合です。(新株予約権付社債(転換社債)を含みます。)

(注2) 格付けはS & P、Moody'sのうち、低い方の格付けを採用しています。(表記方法はS & Pに準拠)

(注3) 格付けが付与されていない銘柄についてはNRと表示します。

<公社債の組入上位10銘柄>

No.	銘柄	クーポン (%)	償還日	格付け	組入比率 (%)
1	AXON ENTERPRISE INC 0.5 12/15/27	0.500	2027/12/15	—	1.6
2	VARONIS SYSTEM INC 1.25 08/15/25	1.250	2025/08/15	—	1.2
3	GRANITE CONSTRUCTION INC 3.75 05/15/28	3.750	2028/05/15	—	1.1
4	GLAUKOS CORP 2.75 06/15/27	2.750	2027/06/15	—	1.1
5	WISDOMTREE INC 5.75 08/15/28	5.750	2028/08/15	—	1.0
6	PARSONS CORP 0.25 08/15/25	0.250	2025/08/15	—	1.0
7	LUMENTUM HOLDINGS INC 1.5 12/15/29	1.500	2029/12/15	B	0.9
8	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	4.000	2030/11/13	BB	0.8
9	SHIFT4 PAYMENTS INC 12/15/25	—	2025/12/15	BB	0.8
10	CHEFS' WAREHOUSE THE 2.375 12/15/28	2.375	2028/12/15	B	0.7

(注1) 比率は、マザーファンド純資産総額に対する評価額の割合です。

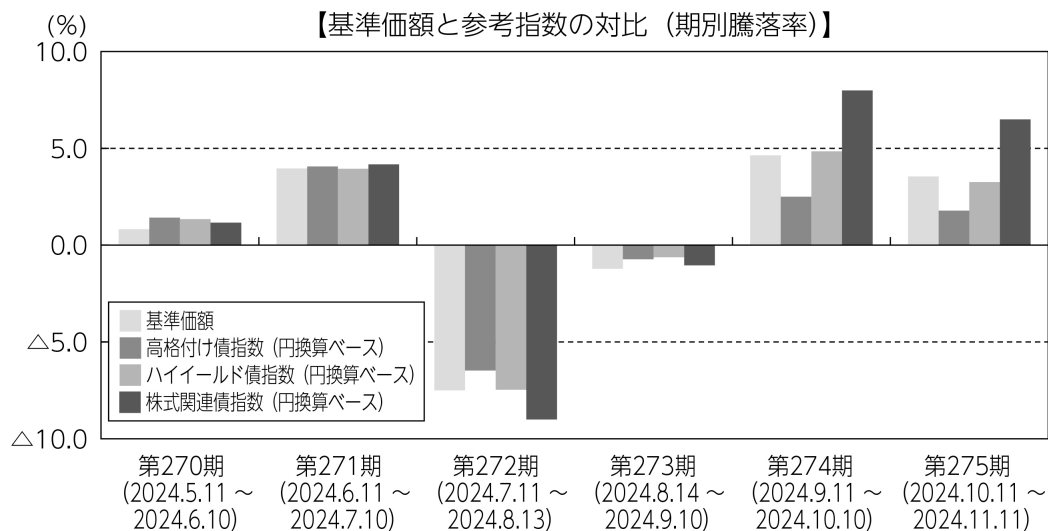
(注2) 格付けはS & P、Moody'sのうち、低い方の格付けを採用しています。(表記方法はS & Pに準拠)

(注3) 格付けが付与されていない銘柄については「—」と表示します。

(注4) 「公社債の組入上位10銘柄」は新株予約権付社債(転換社債)を含む場合があります。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当作成期の収益分配金は、基準価額水準、市場動向および商品性格等を勘案して、下記のとおりいたしました。なお、収益分配に充てず信託財産に留保した収益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第270期	第271期	第272期	第273期	第274期	第275期
	2024年5月11日 ～2024年6月10日	2024年6月11日 ～2024年7月10日	2024年7月11日 ～2024年8月13日	2024年8月14日 ～2024年9月10日	2024年9月11日 ～2024年10月10日	2024年10月11日 ～2024年11月11日
当期分配金（税引前）	30円	30円	30円	30円	30円	30円
対基準価額比率	0.25%	0.25%	0.27%	0.27%	0.26%	0.25%
当期の収益	30円	30円	30円	25円	30円	30円
当期の収益以外	-円	-円	-円	4円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	3,426円	3,862円	3,865円	3,860円	3,876円	3,894円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

「L A USインカムマザーファンド」の組入れを高位に維持する方針です。また、組入外貨建資産に対して、為替ヘッジを行いません。

●L A USインカムマザーファンド

米国の高格付け債やハイイールド債、転換社債等の株式関連債を主要投資対象とし、信託財産の中・長期的な成長を目指します。

資産配分については、高格付け債およびハイイールド債を中心としたポートフォリオとし、高格付け債については、社債の割合を高め維持する方針です。株式関連債については、利回りを重視しつつも、株価との連動性についても意識した銘柄選択を実施します。

個別銘柄選択においては、発行体の有する手元流動性、経営陣の質、実物資産の価値を重視します。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第270期～第275期 (2024年5月11日 ～2024年11月11日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	107円	
(投信会社)	(52)	(0.446)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(49)	(0.418)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(6)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	5	0.041	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(5)	(0.039)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	112	0.961	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

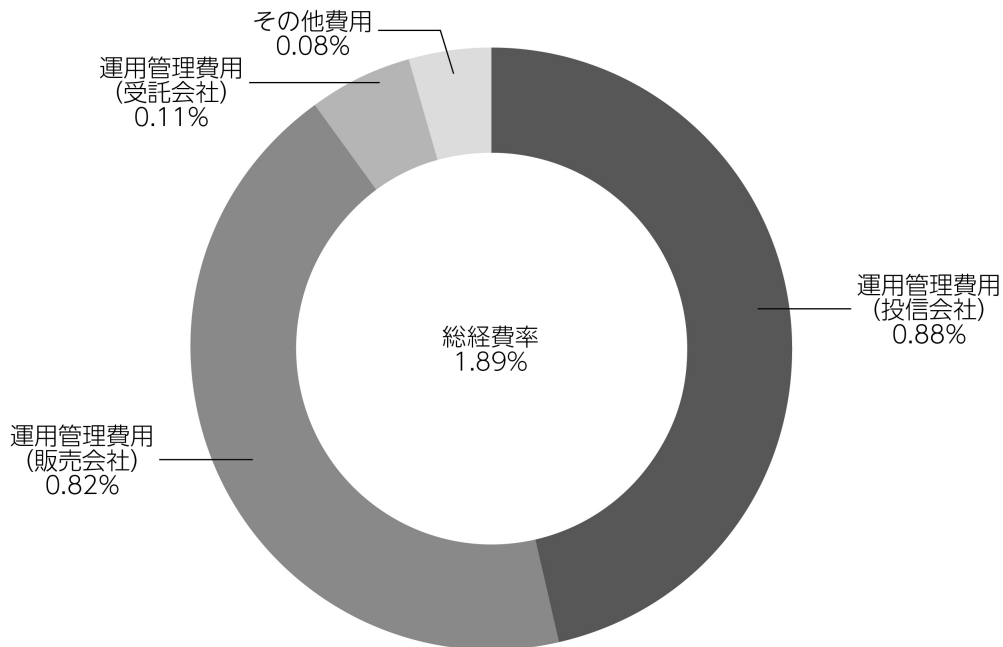
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.89%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年5月11日から2024年11月11日まで）

	第 270 期 ~ 第 275 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
L A U S インカムマザーファンド	千口 —	千円 —	千口 32,716	千円 240,000

■利害関係人との取引状況等（2024年5月11日から2024年11月11日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第45作成期末		第46作成期末	
	□	数	□	数
L A U S インカムマザーファンド		千円 607,904		千円 575,188
				千円 4,345,547

<補足情報>

■ L A U S インカムマザーファンドの組入資産の明細

下記は、L A U S インカムマザーファンド (871,265,806□) の内容です。

(1) 外国新株予約権付社債 (転換社債)

銘 柄	2024年11月11日現在		
	額 面 金 額	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円
MICROSTRATEGY INC 02/15/27	54	106	16,348
TYLER TECHNOLOGIES INC 0.25 03/15/26	174	225	34,533
M/A-COM TECH SOLUTIONS 0.25 03/15/26	146	248	38,014
GUIDEWIRE SOFTWARE INC 1.25 03/15/25	130	222	34,052
GREENBRIER COS INC 2.875 04/15/28	178	227	34,775
FRESHPET INC 3.0 04/01/28	91	212	32,526
GRANITE CONSTRUCTION INC 3.75 05/15/28	225	489	74,942
CNX RESOURCES CORP 2.25 05/01/26	92	273	41,956
BOOKING HOLDINGS INC 0.75 05/01/25	89	234	35,863
GLAUKOS CORP 2.75 06/15/27	187	476	72,924
PARSONS CORP 0.25 08/15/25	172	430	65,899
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 6.0 08/15/25	63	285	43,751
VARONIS SYSTEM INC 1.25 08/15/25	312	532	81,514
WISDOMTREE INC 5.75 08/15/28	335	438	67,205
STRIDE INC 1.125 09/01/27	115	226	34,623
NUTANIX INC 0.25 10/01/27	158	211	32,420
AXON ENTERPRISE INC 0.5 12/15/27	266	706	108,118
LUMENTUM HOLDINGS INC 1.5 12/15/29	281	392	60,149
SHIFT4 PAYMENTS INC 12/15/25	265	350	53,629
CHEFS' WAREHOUSE THE 2.375 12/15/28	274	320	49,068
合 計	額 面 ・ 金 額 3,607	6,610	1,012,319
	銘 柄 数<比率> 20銘柄	-	<15.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年11月11日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >は、2024年11月11日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 公社債

(A) 債券種類別開示

外国 (外貨建) 公社債

区 分	2024年11月11日現在							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちB B格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 35,935	千アメリカ・ドル 35,359	千円 5,414,954	% 82.3	% 31.5	% 39.3	% 32.1	% 10.8
合 計	-	-	千円 5,414,954	82.3	31.5	39.3	32.1	10.8

(注1) 邦貨換算金額は、2024年11月11日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、2024年11月11日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注3) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国 (外貨建) 公社債銘柄別

銘 柄	2024年11月11日現在						償 還 年 月 日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
CITGO PETROLEUM CORP 8.375 01/15/29	特 殊 債 券	8.3750	58	60	9,265	2029/01/15	
PETROLEOS MEXICANOS 5.35 02/12/28	特 殊 債 券	5.3500	93	87	13,381	2028/02/12	
PETROLEOS MEXICANOS 10.0 02/07/33	特 殊 債 券	10.0000	41	44	6,787	2033/02/07	
ECOPETROL SA 5.875 05/28/45	特 殊 債 券	5.8750	121	87	13,350	2045/05/28	
DICK'S SPORTING GOODS 4.1 01/15/52	社 債 券	4.1000	57	42	6,484	2052/01/15	
AES CORP/THE 01/15/55	社 債 券	7.6000	47	48	7,494	2055/01/15	
AMERICAN TOWER CORP 2.95 01/15/25	社 債 券	2.9500	183	182	27,912	2025/01/15	
STANDARD CHARTERED PLC 01/11/35	社 債 券	6.0970	200	210	32,241	2035/01/11	
CENOVUS ENERGY INC 2.65 01/15/32	社 債 券	2.6500	50	42	6,475	2032/01/15	
SM ENERGY CO 6.625 01/15/27	社 債 券	6.6250	204	204	31,385	2027/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/31	社 債 券	4.0000	56	51	7,918	2031/01/15	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 6.15 01/15/33	社 債 券	6.1500	135	142	21,759	2033/01/15	
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社 債 券	4.3750	282	274	42,014	2028/01/15	
NRG ENERGY INC 5.75 01/15/28	社 債 券	5.7500	44	44	6,764	2028/01/15	
HILTON DOMESTIC OPERATIN 4.875 01/15/30	社 債 券	4.8750	134	130	20,015	2030/01/15	
APACHE CORP 4.25 01/15/30	社 債 券	4.2500	250	236	36,203	2030/01/15	
CENTURYLINK INC 6.875 01/15/28	社 債 券	6.8750	46	42	6,516	2028/01/15	
REGENCY CENTERS L.P. 5.25 01/15/34	社 債 券	5.2500	28	28	4,330	2034/01/15	
PHILLIPS EDISON GROCERY 4.95 01/15/35	社 債 券	4.9500	4	3	588	2035/01/15	
BANK OF AMERICA CORP 4.0 01/22/25	社 債 券	4.0000	95	94	14,520	2025/01/22	
HOME BANCSHARES INC 01/30/32	社 債 券	3.1250	39	32	5,039	2032/01/30	
ATHENE HOLDING LTD 3.5 01/15/31	社 債 券	3.5000	120	109	16,787	2031/01/15	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 3.25 01/31/32	社 債 券	3.2500	55	48	7,366	2032/01/31	
DICK'S SPORTING GOODS 3.15 01/15/32	社 債 券	3.1500	75	66	10,117	2032/01/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	社 債 券	6.1250	179	185	28,390	2031/01/01	
TRANSDIGM INC 4.625 01/15/29	社 債 券	4.6250	100	95	14,676	2029/01/15	
HILTON GRAND VAC BOR ESC 6.625 01/15/32	社 債 券	6.6250	54	54	8,328	2032/01/15	
CRESCENT ENERGY FINANCE 7.375 01/15/33	社 債 券	7.3750	31	31	4,753	2033/01/15	
WAND NEWCO 3 INC 7.625 01/30/32	社 債 券	7.6250	66	68	10,486	2032/01/30	
TRANSDIGM INC 6.0 01/15/33	社 債 券	6.0000	62	61	9,483	2033/01/15	
FLEX LTD 5.25 01/15/32	社 債 券	5.2500	35	34	5,321	2032/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/30	社 債 券	4.0000	47	43	6,728	2030/01/15	

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
BACARDI LTD / MARTINI BV 5.25 01/15/29	社債	債券	5.2500	37	37	5,706	2029/01/15
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN 7.25 01/15/31	社債	債券	7.2500	32	33	5,121	2031/01/15
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 6.35 01/15/29	社債	債券	6.3500	42	43	6,704	2029/01/15
HAWAIIAN AIRLINES 13-1A 3.9 01/15/26	社債	債券	3.9000	168	164	25,232	2026/01/15
MICRON TECHNOLOGY INC 5.3 01/15/31	社債	債券	5.3000	26	26	4,024	2031/01/15
STENA INTERNATIONAL SA 7.25 01/15/31	社債	債券	7.2500	200	208	31,868	2031/01/15
UBS GROUP AG 01/12/29	社債	債券	3.8690	250	242	37,124	2029/01/12
AVIATION CAPITAL GROUP 1.95 01/30/26	社債	債券	1.9500	25	24	3,682	2026/01/30
CITIZENS FINANCIAL GROUP 01/23/30	社債	債券	5.8410	43	44	6,746	2030/01/23
US BANCORP 01/23/30	社債	債券	5.3840	43	43	6,707	2030/01/23
LIFE TIME INC 5.75 01/15/26	社債	債券	5.7500	115	114	17,610	2026/01/15
ABC SUPPLY CO INC 4.0 01/15/28	社債	債券	4.0000	50	47	7,342	2028/01/15
NEWMARK GROUP INC 7.5 01/12/29	社債	債券	7.5000	24	25	3,902	2029/01/12
DANSKE BANK A/S 01/09/26	社債	債券	6.4660	200	200	30,674	2026/01/09
CHURCHILL DOWNS INC 4.75 01/15/28	社債	債券	4.7500	87	85	13,037	2028/01/15
CARNIVAL CORP 6.65 01/15/28	社債	債券	6.6500	150	153	23,508	2028/01/15
APACHE CORP 5.25 02/01/42	社債	債券	5.2500	60	52	8,060	2042/02/01
DEUTSCHE BANK NY 02/10/34	社債	債券	7.0790	200	211	32,370	2034/02/10
APPLE INC 3.25 02/23/26	社債	債券	3.2500	175	172	26,426	2026/02/23
CALPINE CORP 5.0 02/01/31	社債	債券	5.0000	206	195	29,944	2031/02/01
BANCO SANTANDER SA 02/01/34	社債	債券	8.0000	200	209	32,111	2034/02/01
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO 7.875 02/15/31	社債	債券	7.8750	47	48	7,384	2031/02/15
PHILIP MORRIS INTL INC 5.125 02/13/31	社債	債券	5.1250	36	36	5,588	2031/02/13
OLIN CORP 5.0 02/01/30	社債	債券	5.0000	51	49	7,521	2030/02/01
UNITED AIR 2024-1 AA PTT 5.45 02/15/37	社債	債券	5.4500	45	46	7,066	2037/02/15
OVINTIV INC 6.5 02/01/38	社債	債券	6.5000	79	82	12,630	2038/02/01
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6 02/23/28	社債	債券	4.6000	59	58	9,028	2028/02/23
OCEANEERING INTL INC 6.0 02/01/28	社債	債券	6.0000	82	81	12,410	2028/02/01
WESTERN DIGITAL CORP 3.1 02/01/32	社債	債券	3.1000	56	47	7,221	2032/02/01
SYNCHRONY FINANCIAL 7.25 02/02/33	社債	債券	7.2500	101	105	16,182	2033/02/02
PATTERSON-UTI ENERGY INC 3.95 02/01/28	社債	債券	3.9500	170	162	24,899	2028/02/01
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 4.05 02/01/30	社債	債券	4.0500	140	132	20,262	2030/02/01
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.0 02/15/29	社債	債券	3.0000	163	149	22,900	2029/02/15
MEG ENERGY CORP 5.875 02/01/29	社債	債券	5.8750	43	42	6,533	2029/02/01
ALLY FINANCIAL INC 6.7 02/14/33	社債	債券	6.7000	123	125	19,270	2033/02/14
PTC INC 4.0 02/15/28	社債	債券	4.0000	47	45	6,924	2028/02/15
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER 5.875 02/01/29	社債	債券	5.8750	106	106	16,239	2029/02/01
RAYTHEON TECH CORP 5.15 02/27/33	社債	債券	5.1500	43	43	6,650	2033/02/27
SUNCOR ENERGY INC 7.15 02/01/32	社債	債券	7.1500	101	112	17,201	2032/02/01
HECLA MINING CO 7.25 02/15/28	社債	債券	7.2500	165	167	25,600	2028/02/15
AMC NETWORKS INC 4.25 02/15/29	社債	債券	4.2500	58	42	6,578	2029/02/15
XPO INC 7.125 02/01/32	社債	債券	7.1250	38	39	6,072	2032/02/01
PERMIAN RESOURC OPTG LLC 6.25 02/01/33	社債	債券	6.2500	31	31	4,799	2032/02/01
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 6.0 02/01/33	社債	債券	6.0000	61	61	9,461	2033/02/01
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.75 02/15/32	社債	債券	4.7500	26	25	3,925	2032/02/15
MERCER INTL INC 5.125 02/01/29	社債	債券	5.1250	37	31	4,895	2029/02/01
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER 5.5 02/01/26	社債	債券	5.5000	91	91	13,938	2026/02/01
CDW LLC/CDW FINANCE 3.25 02/15/29	社債	債券	3.2500	125	115	17,761	2029/02/15
BOMBARDIER INC 7.5 02/01/29	社債	債券	7.5000	42	44	6,751	2029/02/01
CAESARS ENTERTAIN INC 7.0 02/15/30	社債	債券	7.0000	62	64	9,826	2030/02/15

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
TRANSOCEAN INC	8.75 02/15/30	社債	8.7500	68	72	11,047	2030/02/15
VENTURE GLOBAL LNG INC	9.5 02/01/29	社債	9.5000	49	54	8,365	2029/02/01
AMERICAN AIRLINES INC	7.25 02/15/28	社債	7.2500	174	178	27,303	2028/02/15
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.0 02/01/28	社債	5.0000	141	137	20,985	2028/02/01
FREEDOM MORTGAGE HOLD	9.25 02/01/29	社債	9.2500	21	21	3,335	2029/02/01
KODIAK GAS SERVICES LLC	7.25 02/15/29	社債	7.2500	21	21	3,329	2029/02/15
IQVIA INC	6.25 02/01/29	社債	6.2500	29	30	4,633	2029/02/01
SOUTH BOW CAN INFRA HOLD	03/01/55	社債	7.5000	18	18	2,876	2055/03/01
NISOURCE INC	03/31/55	社債	6.3750	43	43	6,629	2055/03/31
PG&E CORP	03/15/55	社債	7.3750	42	43	6,687	2055/03/15
TOLL BROS FINANCE CORP	4.875 03/15/27	社債	4.8750	85	85	13,028	2027/03/15
ABN AMRO BANK NV	03/13/37	社債	3.3240	200	171	26,325	2037/03/13
SPRINT CORP	7.625 03/01/26	社債	7.6250	165	169	25,994	2026/03/01
NEUBERGER BERMAN GRP/FIN	4.5 03/15/27	社債	4.5000	100	97	14,924	2027/03/15
BROWN & BROWN INC	2.375 03/15/31	社債	2.3750	78	66	10,172	2031/03/15
GOODMAN US FIN THREE	3.7 03/15/28	社債	3.7000	38	36	5,569	2028/03/15
WEBSTER FINANCIAL CORP	4.1 03/25/29	社債	4.1000	96	92	14,106	2029/03/25
SPRINT CAPITAL CORP	8.75 03/15/32	社債	8.7500	50	60	9,289	2032/03/15
LUMEN TECHNOLOGIES INC	7.65 03/15/42	社債	7.6500	64	49	7,512	2042/03/15
CALPINE CORP	3.75 03/01/31	社債	3.7500	77	70	10,721	2031/03/01
LEGGETT & PLATT INC	4.4 03/15/29	社債	4.4000	56	52	8,082	2029/03/15
SOUTHWEST GAS CORP	4.05 03/15/32	社債	4.0500	46	43	6,632	2032/03/15
CIT GROUP INC	6.125 03/09/28	社債	6.1250	156	161	24,758	2028/03/09
MAGELLAN MIDSTREAM PARTN	3.95 03/01/50	社債	3.9500	103	78	11,990	2050/03/01
TWILIO INC	3.875 03/15/31	社債	3.8750	29	26	4,036	2031/03/15
COMMERCIAL METALS CO	4.375 03/15/32	社債	4.3750	70	64	9,805	2032/03/15
JACOBS ENGINEERING GROUP	5.9 03/01/33	社債	5.9000	75	77	11,816	2033/03/01
AG ISSUER LLC	6.25 03/01/28	社債	6.2500	271	267	40,900	2028/03/01
CONSTELLATION EN GEN LLC	5.8 03/01/33	社債	5.8000	65	67	10,360	2033/03/01
TRIMBLE INC	6.1 03/15/33	社債	6.1000	65	68	10,525	2033/03/15
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	6.25 03/15/32	社債	6.2500	43	43	6,732	2032/03/15
UNITED STATES STEEL CORP	6.875 03/01/29	社債	6.8750	63	63	9,706	2029/03/01
OCI NV	6.7 03/16/33	社債	6.7000	200	200	30,715	2033/03/16
COMSTOCK RESOURCES INC	6.75 03/01/29	社債	6.7500	86	84	12,877	2029/03/01
SOLVENTUM CORP	5.6 03/23/34	社債	5.6000	34	34	5,288	2034/03/23
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	4.5 03/01/28	社債	4.5000	100	97	14,930	2028/03/01
TWILIO INC	3.625 03/15/29	社債	3.6250	30	27	4,266	2029/03/15
SOLVENTUM CORP	5.45 03/13/31	社債	5.4500	55	55	8,535	2031/03/13
HILTON DOMESTIC OPERATIN	5.875 03/15/33	社債	5.8750	60	60	9,219	2033/03/15
ANTERO RESOURCES CORP	5.375 03/01/30	社債	5.3750	67	65	10,064	2030/03/01
SOUTHWESTERN ENERGY CO	5.375 03/15/30	社債	5.3750	66	65	9,994	2030/03/15
ALCOA NEDERLAND HOLDING	7.125 03/15/31	社債	7.1250	200	209	32,130	2031/03/15
CARNIVAL CORP	5.75 03/01/27	社債	5.7500	106	106	16,341	2027/03/01
CHARLES RIVER LABORATORI	3.75 03/15/29	社債	3.7500	50	46	7,133	2029/03/15
BELLRING BRANDS INC	7.0 03/15/30	社債	7.0000	45	46	7,180	2030/03/15
MACQUARIE AIRFINANCE HLD	6.5 03/26/31	社債	6.5000	31	32	4,947	2031/03/26
BAE SYSTEMS PLC	5.25 03/26/31	社債	5.2500	200	203	31,148	2031/03/26
NAVIENT CORP	5.5 03/15/29	社債	5.5000	136	131	20,106	2029/03/15
CLOUD SOFTWARE GRP HOLDG	6.5 03/31/29	社債	6.5000	75	74	11,343	2029/03/31
OLD REPUBLIC INTL CORP	5.75 03/28/34	社債	5.7500	42	42	6,569	2034/03/28

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
BALL CORP 6.875 03/15/28	社債	債券	6.8750	59	60	9,301	2028/03/15
LPL HOLDINGS INC 4.0 03/15/29	社債	債券	4.0000	100	94	14,449	2029/03/15
HSBC HOLDINGS PLC 03/11/34	社債	債券	6.9500	200	201	30,914	2034/03/11
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.412 03/15/26	社債	債券	6.4120	125	125	19,142	2026/03/15
NEXTERA ENERGY CAPITAL 6.051 03/01/25	社債	債券	6.0510	43	43	6,606	2025/03/01
DELEK LOG PART/FINANCE 8.625 03/15/29	社債	債券	8.6250	64	66	10,210	2029/03/15
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.8 03/08/29	社債	債券	5.8000	200	201	30,887	2029/03/08
BLACKROCK FUNDING INC 4.7 03/14/29	社債	債券	4.7000	16	16	2,469	2029/03/14
USA COM PART/USA COM FIN 7.125 03/15/29	社債	債券	7.1250	35	35	5,481	2029/03/15
ASTON MARTIN CAPITAL HOL 10.0 03/31/29	社債	債券	10.0000	200	197	30,243	2029/03/31
WILLIAMS COMPANIES INC 4.9 03/15/29	社債	債券	4.9000	84	84	12,910	2029/03/15
NEWELL BRANDS INC 4.2 04/01/26	社債	債券	5.7000	125	125	19,275	2026/04/01
MCCORMICK & CO 4.95 04/15/33	社債	債券	4.9500	51	50	7,783	2033/04/15
REGAL REXNORD CORP 6.4 04/15/33	社債	債券	6.4000	45	47	7,206	2033/04/15
FORTRESS TRANS & INFRAST 5.875 04/15/33	社債	債券	5.8750	43	42	6,440	2033/04/15
VITAL ENERGY INC 7.875 04/15/32	社債	債券	7.8750	53	52	8,031	2032/04/15
CRESCENT ENERGY FINANCE 7.625 04/01/32	社債	債券	7.6250	35	35	5,424	2032/04/01
MATADOR RESOURCES CO 6.5 04/15/32	社債	債券	6.5000	45	45	6,940	2032/04/15
APACHE CORP 4.75 04/15/43	社債	債券	4.7500	45	36	5,598	2043/04/15
SWISS RE SUB FIN PLC 04/05/35	社債	債券	5.6980	200	201	30,853	2035/04/05
STEEL DYNAMICS INC 3.45 04/15/30	社債	債券	3.4500	49	45	7,010	2030/04/15
FMG RESOURCES AUG 2006 4.375 04/01/31	社債	債券	4.3750	100	91	14,043	2031/04/01
DPL INC 4.35 04/15/29	社債	債券	4.3500	6	5	862	2029/04/15
JANE STREET GRP/JSG FIN 7.125 04/30/31	社債	債券	7.1250	59	61	9,375	2031/04/30
HUNT COS INC 5.25 04/15/29	社債	債券	5.2500	46	43	6,652	2029/04/15
MGM RESORTS INTL 5.5 04/15/27	社債	債券	5.5000	150	150	23,000	2027/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.625 04/15/29	社債	債券	4.6250	28	26	4,128	2029/04/15
TOTALENERGIES CAPITAL SA 5.15 04/05/34	社債	債券	5.1500	46	46	7,152	2034/04/05
ALLIANT HOLD / CO-ISSUER 6.75 04/15/28	社債	債券	6.7500	80	80	12,385	2028/04/15
SYSTEM ENERGY RESOURCES 6.0 04/15/28	社債	債券	6.0000	105	108	16,581	2028/04/15
MOZART DEBT MERGER SUB 3.875 04/01/29	社債	債券	3.8750	125	117	17,975	2029/04/01
MATADOR RESOURCES CO 6.875 04/15/28	社債	債券	6.8750	26	26	4,080	2028/04/15
ENTEGRIS ESCROW CORP 4.75 04/15/29	社債	債券	4.7500	97	94	14,431	2029/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.375 04/15/26	社債	債券	4.3750	70	69	10,575	2026/04/15
ZF NA CAPITAL 6.875 04/14/28	社債	債券	6.8750	150	152	23,310	2028/04/14
REGAL REXNORD CORP 6.05 04/15/28	社債	債券	6.0500	41	42	6,434	2028/04/15
BAYTEX ENERGY CORP 8.5 04/30/30	社債	債券	8.5000	35	36	5,547	2030/04/30
GENERAL MOTORS FINL CO 5.4 04/06/26	社債	債券	5.4000	27	27	4,165	2026/04/06
EQM MIDSTREAM PARTNERS L 6.375 04/01/29	社債	債券	6.3750	41	41	6,406	2029/04/01
VALARIS LTD 8.375 04/30/30	社債	債券	8.3750	60	62	9,506	2030/04/30
CORECIVIC INC 8.25 04/15/29	社債	債券	8.2500	120	127	19,533	2029/04/15
RENAISSANCERE FINANCE 3.7 04/01/25	社債	債券	3.7000	215	214	32,776	2025/04/01
RENAISSANCERE HOLDINGS L 3.6 04/15/29	社債	債券	3.6000	91	86	13,240	2029/04/15
GEO GROUP INC/THE 8.625 04/15/29	社債	債券	8.6250	64	68	10,420	2029/04/15
RAYONIER LP 2.75 05/17/31	社債	債券	2.7500	100	86	13,196	2031/05/17
OWENS-BROCKWAY 7.25 05/15/31	社債	債券	7.2500	41	41	6,347	2031/05/15
TRANSOCEAN INC 8.5 05/15/31	社債	債券	8.5000	31	31	4,841	2031/05/15
ENCINO ACQUISITION PARTN 8.75 05/01/31	社債	債券	8.7500	29	30	4,633	2031/05/01
ONEMAIN FINANCE CORP 7.5 05/15/31	社債	債券	7.5000	123	127	19,565	2031/05/15
PULTE GROUP INC 6.375 05/15/33	社債	債券	6.3750	48	51	7,897	2033/05/15

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
MONONGAHELA POWER CO 3.55 05/15/27	社債	債券	3.5500	173	167	25,692	2027/05/15
HERSHEY COMPANY 4.5 05/04/33	社債	債券	4.5000	45	44	6,832	2033/05/04
JETBLUE 2019-1 CLASS A 2.95 05/15/28	社債	債券	2.9500	31	28	4,347	2028/05/15
GOODMAN US FIN FIVE LLC 4.625 05/04/32	社債	債券	4.6250	40	38	5,893	2032/05/04
NEWS CORP 3.875 05/15/29	社債	債券	3.8750	64	60	9,219	2029/05/15
MIDWEST GAMING BORROWER 4.875 05/01/29	社債	債券	4.8750	89	85	13,048	2029/05/01
BOEING CO 5.15 05/01/30	社債	債券	5.1500	45	44	6,823	2030/05/01
RANGE RESOURCES CORP 4.875 05/15/25	社債	債券	4.8750	191	190	29,191	2025/05/15
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.0 05/01/28	社債	債券	5.0000	146	144	22,073	2028/05/01
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 4.5 05/01/32	社債	債券	4.5000	50	43	6,680	2032/05/01
BOEING CO 6.528 05/01/34	社債	債券	6.5280	25	26	4,055	2034/05/01
FMC CORP 5.65 05/18/33	社債	債券	5.6500	43	43	6,672	2033/05/18
EQUIPMENTSHARE.COM INC 8.625 05/15/32	社債	債券	8.6250	26	27	4,158	2032/05/15
ENI SPA 5.5 05/15/34	社債	債券	5.5000	200	202	30,974	2034/05/15
BLOCK INC 6.5 05/15/32	社債	債券	6.5000	74	75	11,570	2032/05/15
ATLASSIAN CORPORATION 5.5 05/15/34	社債	債券	5.5000	45	45	7,036	2034/05/15
JPMORGAN CHASE & CO 05/01/28	社債	債券	3.5400	110	107	16,390	2028/05/01
LPL HOLDINGS INC 6.0 05/20/34	社債	債券	6.0000	45	46	7,090	2034/05/20
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/27	社債	債券	5.1250	180	177	27,225	2027/05/01
ALLY FINANCIAL INC 05/15/26	社債	債券	4.7000	95	87	13,379	2026/05/15
BOEING CO 5.04 05/01/27	社債	債券	5.0400	135	134	20,636	2027/05/01
VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.5 05/15/29	社債	債券	5.5000	200	190	29,241	2029/05/15
ALLEGION US HOLDING CO 5.6 05/29/34	社債	債券	5.6000	27	27	4,247	2034/05/29
DELTA AIR LINES INC 7.0 05/01/25	社債	債券	7.0000	135	136	20,830	2025/05/01
HUNTINGTON INGALLS INDUS 4.2 05/01/30	社債	債券	4.2000	139	132	20,299	2030/05/01
UNIVISION COMMUNICATIONS 4.5 05/01/29	社債	債券	4.5000	100	89	13,766	2029/05/01
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.5 05/15/30	社債	債券	4.5000	92	89	13,738	2030/05/15
AMERICAN AIRLINES INC 8.5 05/15/29	社債	債券	8.5000	46	48	7,441	2029/05/15
ROBLOX CORP 3.875 05/01/30	社債	債券	3.8750	146	133	20,436	2030/05/01
EQUIPMENTSHARE.COM INC 9.0 05/15/28	社債	債券	9.0000	85	88	13,545	2028/05/15
GRAY TELEVISION INC 7.0 05/15/27	社債	債券	7.0000	50	48	7,391	2027/05/15
EQUIPMENTSHARE.COM INC 9.0 05/15/28	社債	債券	9.0000	23	23	3,656	2028/05/15
MINERAL RESOURCES LTD 8.5 05/01/30	社債	債券	8.5000	75	77	11,812	2030/05/01
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.65 05/19/30	社債	債券	4.6500	56	56	8,581	2030/05/19
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS 5.25 05/15/30	社債	債券	5.2500	250	221	33,975	2030/05/15
FMC CORP 5.15 05/18/26	社債	債券	5.1500	42	42	6,438	2026/05/18
VISTRA OPERATIONS CO LLC 5.125 05/13/25	社債	債券	5.1250	300	300	45,949	2025/05/13
TRANSOCEAN INC 8.25 05/15/29	社債	債券	8.2500	22	22	3,423	2029/05/15
GXO LOGISTICS INC 6.25 05/06/29	社債	債券	6.2500	41	42	6,485	2029/05/06
CENOVUS ENERGY INC 5.4 06/15/47	社債	債券	5.4000	108	101	15,602	2047/06/15
DTE ENERGY COMPANY 3.4 06/15/29	社債	債券	3.4000	100	93	14,374	2029/06/15
HEALTH CARE SERVICE CORP 5.875 06/15/54	社債	債券	5.8750	18	18	2,804	2054/06/15
BRITISH AIR 19-1 A PTT 3.35 06/15/29	社債	債券	3.3500	190	178	27,298	2029/06/15
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75 06/01/28	社債	債券	5.7500	102	103	15,903	2028/06/01
HCA INC 5.5 06/01/33	社債	債券	5.5000	46	46	7,117	2033/06/01
KAISER ALUMINUM CORP 4.5 06/01/31	社債	債券	4.5000	62	56	8,614	2031/06/01
HCA INC 7.69 06/15/25	社債	債券	7.6900	136	137	21,129	2025/06/15
VERISIGN INC 2.7 06/15/31	社債	債券	2.7000	53	45	6,989	2031/06/15
CABOT CORP 5.0 06/30/32	社債	債券	5.0000	60	59	9,144	2032/06/30
WESTERN ALLIANCE BANCORP 06/15/31	社債	債券	3.0000	77	71	10,936	2031/06/15

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
LKQ CORP 6.25 06/15/33	社債	債券	6.2500	56	58	8,921	2033/06/15
CLOUD SOFTWARE GRP INC 8.25 06/30/32	社債	債券	8.2500	70	72	11,174	2032/06/30
LIFEPOINT HEALTH INC 10.0 06/01/32	社債	債券	10.0000	50	53	8,197	2032/06/01
VENTURE GLOBAL LNG INC 8.375 06/01/31	社債	債券	8.3750	50	52	8,064	2031/06/01
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP 6.5 06/01/32	社債	債券	6.5000	16	16	2,512	2032/06/01
PANTHER ESCROW ISSUER 7.125 06/01/31	社債	債券	7.1250	52	53	8,210	2031/06/01
NETAPP INC 2.7 06/22/30	社債	債券	2.7000	20	17	2,724	2030/06/22
SOLVAY FINANCE (AMERICA) 5.85 06/04/34	社債	債券	5.8500	200	205	31,453	2034/06/04
ALBEMARLE CORP 4.65 06/01/27	社債	債券	4.6500	88	87	13,402	2027/06/01
VFH PARENT / VALOR CO 7.5 06/15/31	社債	債券	7.5000	50	51	7,943	2031/06/15
TENET HEALTHCARE CORP 4.25 06/01/29	社債	債券	4.2500	48	45	6,999	2029/06/01
AES CORP/THE 5.45 06/01/28	社債	債券	5.4500	83	83	12,845	2028/06/01
VENTURE GLOBAL LNG INC 8.125 06/01/28	社債	債券	8.1250	27	28	4,321	2028/06/01
GARTNER INC 3.625 06/15/29	社債	債券	3.6250	70	65	10,057	2029/06/15
CALPINE CORP 5.25 06/01/26	社債	債券	5.2500	44	43	6,717	2026/06/01
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 8.625 06/01/30	社債	債券	8.6250	51	55	8,445	2030/06/01
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.95 06/08/25	社債	債券	4.9500	85	84	13,009	2025/06/08
DELTA AIR LINES 2020-AA 2.0 06/10/28	社債	債券	2.0000	247	229	35,180	2028/06/10
HUB INTERNATIONAL LTD 7.25 06/15/30	社債	債券	7.2500	64	66	10,207	2030/06/15
WINDSOR HOLDINGS III LLC 8.5 06/15/30	社債	債券	8.5000	52	55	8,425	2030/06/15
DAVITA INC 4.625 06/01/30	社債	債券	4.6250	130	121	18,546	2030/06/01
GLOBAL MARINE INC 7.0 06/01/28	社債	債券	7.0000	44	41	6,404	2028/06/01
CALIFORNIA RESOURCES CRP 8.25 06/15/29	社債	債券	8.2500	41	42	6,446	2029/06/15
MASTEC INC 5.9 06/15/29	社債	債券	5.9000	40	40	6,273	2029/06/15
SATURN OIL & GAS INC 9.625 06/15/29	社債	債券	9.6250	48	48	7,365	2029/06/15
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF 5.4 06/12/29	社債	債券	5.4000	41	41	6,384	2029/06/12
CALIFORNIA RESOURCES CRP 8.25 06/15/29	社債	債券	8.2500	19	19	2,987	2029/06/15
MORGAN STANLEY 3.125 07/27/26	社債	債券	3.1250	175	170	26,151	2026/07/27
UNITED AIR 2023-1 A PTT 5.8 07/15/36	社債	債券	5.8000	53	55	8,506	2036/07/15
NGPL PIPECO LLC 3.25 07/15/31	社債	債券	3.2500	75	65	9,991	2031/07/15
BRIXMOR OPERATING PART 4.05 07/01/30	社債	債券	4.0500	45	42	6,563	2030/07/01
PG&E CORP 5.25 07/01/30	社債	債券	5.2500	47	45	7,042	2030/07/01
EQM MIDSTREAM PARTNERS L 5.5 07/15/28	社債	債券	5.5000	65	65	9,985	2028/07/15
PARTNERRE FINANCE B LLC 3.7 07/02/29	社債	債券	3.7000	138	131	20,114	2029/07/02
GXO LOGISTICS INC 2.65 07/15/31	社債	債券	2.6500	57	49	7,528	2031/07/15
BLUE RACER MID LLC/FINAN 7.25 07/15/32	社債	債券	7.2500	27	27	4,287	2032/07/15
CIVITAS RESOURCES INC 8.75 07/01/31	社債	債券	8.7500	55	58	8,919	2031/07/01
PG&E CORP 5.0 07/01/28	社債	債券	5.0000	59	57	8,841	2028/07/01
MASTERBRAND INC 7.0 07/15/32	社債	債券	7.0000	12	12	1,883	2032/07/15
PHILLIPS EDISON GROCERY 5.75 07/15/34	社債	債券	5.7500	15	15	2,347	2034/07/15
CONCENTRA ESCROW ISSUER 6.875 07/15/32	社債	債券	6.8750	22	22	3,491	2032/07/15
EMRLD BOR / EMRLD CO-ISS 6.75 07/15/31	社債	債券	6.7500	20	20	3,137	2031/07/15
BACARDI LTD 2.75 07/15/26	社債	債券	2.7500	300	289	44,278	2026/07/15
KINROSS GOLD CORP 6.25 07/15/33	社債	債券	6.2500	117	124	19,002	2033/07/15
TAKEDA PHARMACEUTICAL 5.3 07/05/34	社債	債券	5.3000	200	203	31,104	2034/07/05
ANZ BANK NEW ZEALAND LTD 5.898 07/10/34	社債	債券	5.8980	200	204	31,246	2034/07/10
AIRCASTLE LTD 6.5 07/18/28	社債	債券	6.5000	37	38	5,894	2028/07/18
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.165 07/15/27	社債	債券	6.1650	128	130	19,927	2027/07/15
IMPERIAL BRANDS FIN PLC 6.125 07/27/27	社債	債券	6.1250	200	205	31,518	2027/07/27
DPL INC 4.125 07/01/25	社債	債券	4.1250	135	134	20,597	2025/07/01

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	5.3 08/01/54	社債	5.3000	44	44	6,782	2054/08/01
AUSGRID FINANCE PTY LTD	4.35 08/01/28	社債	4.3500	58	56	8,657	2028/08/01
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	5.25 08/01/26	社債	5.2500	92	84	12,892	2026/08/01
MSCI INC	3.25 08/15/33	社債	3.2500	22	18	2,898	2033/08/15
ASHTAD CAPITAL INC	5.5 08/11/32	社債	5.5000	200	200	30,660	2032/08/11
BOARDWALK PIPELINES LP	5.625 08/01/34	社債	5.6250	65	65	10,032	2034/08/01
BOOZ ALLEN HAMILTON INC	5.95 08/04/33	社債	5.9500	47	49	7,561	2033/08/04
CHOICE HOTELS INTL INC	5.85 08/01/34	社債	5.8500	63	63	9,781	2034/08/01
NGPL PIPECO LLC	4.875 08/15/27	社債	4.8750	122	121	18,530	2027/08/15
WATCO COS LLC/FINANCE CO	7.125 08/01/32	社債	7.1250	35	36	5,569	2032/08/01
SM ENERGY CO	7.0 08/01/32	社債	7.0000	25	25	3,832	2032/08/01
INDEPENDENT BANK GRP INC	8.15 08/15/34	社債	8.3750	50	51	7,810	2034/08/15
AMENTUM ESCROW CORP	7.25 08/01/32	社債	7.2500	27	28	4,304	2032/08/01
LIGHTNING POWER LLC	7.25 08/15/32	社債	7.2500	42	43	6,705	2032/08/15
LAS VEGAS SANDS CORP	3.5 08/18/26	社債	3.5000	190	184	28,330	2026/08/18
CARNIVAL CORP	4.0 08/01/28	社債	4.0000	75	71	10,974	2028/08/01
IDAHO POWER CO	5.2 08/15/34	社債	5.2000	42	42	6,481	2034/08/15
QUANTA SERVICES INC	5.25 08/09/34	社債	5.2500	42	41	6,407	2034/08/09
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	3.875 08/15/29	社債	3.8750	47	43	6,696	2029/08/15
NABORS INDUSTRIES INC	8.875 08/15/31	社債	8.8750	27	26	4,075	2031/08/15
CDW LLC/CDW FINANCE	5.55 08/22/34	社債	5.5500	43	43	6,592	2034/08/22
BRAND INDUSTRIAL SERVICE	10.375 08/01/30	社債	10.3750	67	71	11,005	2030/08/01
LIFEPOINT HEALTH INC	9.875 08/15/30	社債	9.8750	46	50	7,725	2030/08/15
ATI INC	7.25 08/15/30	社債	7.2500	100	104	16,023	2030/08/15
SEAWORLD PARKS & ENTERTA	5.25 08/15/29	社債	5.2500	44	42	6,510	2029/08/15
JACOBS ENGINEERING GROUP	6.35 08/18/28	社債	6.3500	40	41	6,399	2028/08/18
SYNCHRONY FINANCIAL	08/02/30	社債	5.9350	22	22	3,441	2030/08/02
ASSOC BANC-CORP	08/29/30	社債	6.4550	43	43	6,716	2030/08/29
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	6.625 08/01/26	社債	6.6250	24	20	3,185	2026/08/01
MAUSER PACKAGING SOLUT	7.875 08/15/26	社債	7.8750	130	131	20,209	2026/08/15
HERSHEY COMPANY	7.2 08/15/27	社債	7.2000	150	159	24,368	2027/08/15
SM ENERGY CO	6.75 08/01/29	社債	6.7500	29	29	4,447	2029/08/01
KRAKEN OIL & GAS PARTNER	7.625 08/15/29	社債	7.6250	19	18	2,898	2029/08/15
NATIONSTAR MTG HLD INC	6.5 08/01/29	社債	6.5000	52	52	8,034	2029/08/01
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	8.125 08/15/29	社債	8.1250	59	59	9,136	2029/08/15
LEAR CORP	3.8 09/15/27	社債	3.8000	41	39	6,103	2027/09/15
INTERSTATE POWER & LIGHT	5.45 09/30/54	社債	5.4500	35	35	5,382	2054/09/30
ROPER TECHNOLOGIES INC	4.2 09/15/28	社債	4.2000	89	87	13,425	2028/09/15
OLIN CORP	5.125 09/15/27	社債	5.1250	18	17	2,725	2027/09/15
FLUOR CORP	4.25 09/15/28	社債	4.2500	114	109	16,809	2028/09/15
HCA INC	3.5 09/01/30	社債	3.5000	85	78	11,988	2030/09/01
ONEOK INC	6.05 09/01/33	社債	6.0500	64	67	10,270	2033/09/01
REGIONS FINANCIAL CORP	09/06/35	社債	5.5020	36	35	5,500	2035/09/06
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	6.625 09/01/30	社債	6.6250	36	38	5,830	2030/09/01
MARVELL TECHNOLOGY INC	5.95 09/15/33	社債	5.9500	44	46	7,082	2033/09/15
MURPHY OIL USA INC	4.75 09/15/29	社債	4.7500	133	128	19,617	2029/09/15
WHISTLER PIPELINE LLC	5.95 09/30/34	社債	5.9500	88	89	13,728	2034/09/30
HELMERICH & PAYNE INC	2.9 09/29/31	社債	2.9000	100	85	13,053	2031/09/29
PERFORMANCE FOOD GROUP I	6.125 09/15/32	社債	6.1250	48	48	7,427	2032/09/15
GLENCORE FUNDING LLC	2.5 09/01/30	社債	2.5000	90	78	12,070	2030/09/01

銘柄		2024年11月11日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
PERRIGO FINANCE UNLIMITE	6.125 09/30/32	社債	6.1250	35	34	5,338	2032/09/30
USA COM PART/USA COM FIN	6.875 09/01/27	社債	6.8750	115	115	17,735	2027/09/01
MCGRAW-HILL EDUCATION	7.375 09/01/31	社債	7.3750	25	25	3,941	2031/09/01
MOSS CREEK RESOURCES HLD	8.25 09/01/31	社債	8.2500	36	35	5,465	2031/09/01
GENERAL MOTORS FINL CO	5.45 09/06/34	社債	5.4500	80	79	12,172	2034/09/06
KROGER CO	4.9 09/15/31	社債	4.9000	63	63	9,670	2031/09/15
ON SEMICONDUCTOR CORP	3.875 09/01/28	社債	3.8750	98	92	14,169	2028/09/01
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	5.625 09/30/31	社債	5.6250	56	56	8,591	2031/09/30
NORDEA BANK ABP	09/25/31	社債	6.3000	200	193	29,589	2031/09/25
FIFTH THIRD BANCORP	09/06/30	社債	4.8950	36	35	5,477	2030/09/06
TREEHOUSE FOODS INC	4.0 09/01/28	社債	4.0000	45	41	6,338	2028/09/01
FIRST AMERICAN FINANCIAL	5.45 09/30/34	社債	5.4500	20	19	3,004	2034/09/30
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	6.375 09/01/29	社債	6.3750	57	57	8,765	2029/09/01
VICI PROPERTIES / NOTE	4.5 09/01/26	社債	4.5000	145	143	21,989	2026/09/01
INTUIT INC	5.125 09/15/28	社債	5.1250	125	127	19,586	2028/09/15
MIRABELA NICKEL 144-A	1%	社債	0.0000	1	0	0	2044/09/10
PNC FINANCIAL SERVICES	09/15/26	社債	3.4000	47	43	6,681	2026/09/15
IDEX CORP	4.95 09/01/29	社債	4.9500	42	42	6,458	2029/09/01
KROGER CO	4.65 09/15/29	社債	4.6500	35	35	5,363	2029/09/15
SONOCO PRODUCTS CO	4.6 09/01/29	社債	4.6000	23	22	3,445	2029/09/01
GLOBAL ATLANTIC FIN CO	10/15/54	社債	7.9500	30	31	4,796	2054/10/15
SEMPRA	10/01/54	社債	6.4000	52	52	8,035	2054/10/01
TEVA PHARMACEUTICALS NE	3.15 10/01/26	社債	3.1500	90	86	13,203	2026/10/01
MARRIOTT INTERNATIONAL	3.5 10/15/32	社債	3.5000	50	44	6,862	2032/10/15
BANK OZK	10/01/31	社債	2.7500	100	82	12,634	2031/10/01
BAT CAPITAL CORP	7.75 10/19/32	社債	7.7500	79	91	13,972	2032/10/19
ALPHA GENERATION LLC	6.75 10/15/32	社債	6.7500	21	21	3,259	2032/10/15
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	6.625 10/15/32	社債	6.6250	28	27	4,283	2032/10/15
6297782 LLC	5.584 10/01/34	社債	5.5840	37	36	5,636	2034/10/01
LABL INC	8.625 10/01/31	社債	8.6250	88	85	13,024	2031/10/01
WISCONSIN ELECTRIC POWER	4.6 10/01/34	社債	4.6000	25	24	3,729	2034/10/01
WINDSTREAM ESCROW LLC	8.25 10/01/31	社債	8.2500	18	18	2,854	2031/10/01
UNIVERSAL HEALTH SVCS	5.05 10/15/34	社債	5.0500	22	20	3,213	2034/10/15
AS MILEAGE PLAN IP LTD	5.308 10/20/31	社債	5.3080	41	39	6,107	2031/10/20
TIFFANY & CO	4.9 10/01/44	社債	4.9000	75	74	11,385	2044/10/01
CONSTELLATION EN GEN LLC	6.25 10/01/39	社債	6.2500	120	128	19,629	2039/10/01
PATTERSON-UTI ENERGY INC	7.15 10/01/33	社債	7.1500	48	51	7,821	2033/10/01
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	7.5 10/15/27	社債	7.5000	90	95	14,630	2027/10/15
QORVO INC	4.375 10/15/29	社債	4.3750	99	93	14,302	2029/10/15
DIAMOND FRGN/DIAMOND FIN	8.5 10/01/30	社債	8.5000	23	24	3,699	2030/10/01
GAP INC/THE	3.625 10/01/29	社債	3.6250	47	42	6,508	2029/10/01
VITAL ENERGY INC	9.75 10/15/30	社債	9.7500	95	102	15,631	2030/10/15
STAR PARENT INC	9.0 10/01/30	社債	9.0000	35	36	5,644	2030/10/01
FRONTIER COMMUNICATIONS	5.875 10/15/27	社債	5.8750	68	68	10,415	2027/10/15
LIFEPOINT HEALTH INC	11.0 10/15/30	社債	11.0000	50	55	8,557	2030/10/15
UNITED AIR 2020-1 A PTT	5.875 10/15/27	社債	5.8750	192	197	30,178	2027/10/15
AMER AIRLINE 16-3 AA PTT	3.0 10/15/28	社債	3.0000	208	196	30,064	2028/10/15
EVERARC ESCROW SARL	5.0 10/30/29	社債	5.0000	52	49	7,558	2029/10/30
RETAIL OPPORTUNITY IN	6.75 10/15/28	社債	6.7500	46	48	7,481	2028/10/15
NATIONAL FUEL GAS CO	5.5 10/01/26	社債	5.5000	80	80	12,389	2026/10/01

銘柄	2024年11月11日現在						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
GOLDMAN SACHS GROUP INC 10/21/27	社債	1.9480	23	21	3,334	2027/10/21	
TRUIST FINANCIAL CORP 10/30/29	社債	7.1610	140	150	23,073	2029/10/30	
MERCER INTL INC 12.875 10/01/28	社債	12.8750	12	12	1,958	2028/10/01	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.125 11/16/28	社債	4.1250	89	87	13,368	2028/11/16	
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.4 11/14/34	社債	5.4000	91	91	14,027	2034/11/14	
NETFLIX INC 5.875 11/15/28	社債	5.8750	109	114	17,459	2028/11/15	
WABTEC CORP 3.45 11/15/26	社債	3.4500	169	164	25,245	2026/11/15	
OVINTIV INC 5.15 11/15/41	社債	5.1500	23	19	3,013	2041/11/15	
MSCI INC 3.625 11/01/31	社債	3.6250	195	176	26,980	2031/11/01	
JM SMUCKER CO 6.2 11/15/33	社債	6.2000	46	49	7,556	2033/11/15	
SPRINT CAPITAL CORP 6.875 11/15/28	社債	6.8750	192	206	31,604	2028/11/15	
MOLINA HEALTHCARE INC 3.875 11/15/30	社債	3.8750	155	140	21,587	2030/11/15	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT 6.375 11/15/33	社債	6.3750	80	87	13,463	2033/11/15	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	社債	4.0000	400	364	55,823	2030/11/13	
PATRICK INDUSTRIES INC 6.375 11/01/32	社債	6.3750	41	40	6,237	2032/11/01	
SVB FINANCIAL GROUP 11/15/26	社債	0.0000	155	0.465	71	2026/11/15	
VIPER ENERGY PARTNERS LP 7.375 11/01/31	社債	7.3750	31	32	4,967	2031/11/01	
ABBVIE INC 3.2 11/21/29	社債	3.2000	80	74	11,471	2029/11/21	
CIVITAS RESOURCES INC 8.625 11/01/30	社債	8.6250	40	42	6,500	2030/11/01	
JETBLUE 2019-1 CLASS B 8.0 11/15/27	社債	8.0000	31	32	4,931	2027/11/15	
RAVEN ACQUISITION HOLDIN 6.875 11/15/31	社債	6.8750	112	111	17,129	2031/11/15	
SPIRIT AEROSYSTEMS INC 9.75 11/15/30	社債	9.7500	50	55	8,511	2030/11/15	
SMYRNA READY MIX CONCRET 6.0 11/01/28	社債	6.0000	95	94	14,483	2028/11/01	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35 11/04/27	社債	7.3500	200	210	32,232	2027/11/04	
PENNYMAC FIN SVCS INC 7.125 11/15/30	社債	7.1250	43	43	6,717	2030/11/15	
BORR IHC LTD / BORR FIN 10.0 11/15/28	社債	10.0000	192	198	30,340	2028/11/15	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 11/01/30	社債	6.1680	35	35	5,414	2030/11/01	
ARCELORMITTAL SA 6.55 11/29/27	社債	6.5500	122	127	19,538	2027/11/29	
GLOBAL PAYMENTS INC 1.5 11/15/24	社債	1.5000	45	44	6,889	2024/11/15	
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7 12/15/25	社債	3.7000	210	208	31,890	2025/12/15	
BRITISH AIR 19-1 AA PTT 3.3 12/15/32	社債	3.3000	131	120	18,431	2032/12/15	
ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.011 12/15/26	社債	4.0110	84	82	12,661	2026/12/15	
BNP PARIBAS 12/05/34	社債	5.8940	200	210	32,167	2034/12/05	
CF INDUSTRIES INC 4.5 12/01/26	社債	4.5000	86	85	13,056	2026/12/01	
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社債	3.5000	170	159	24,381	2029/12/01	
AUST & NZ BANKING GROUP 6.742 12/08/32	社債	6.7420	200	218	33,508	2032/12/08	
TRIMBLE INC 4.75 12/01/24	社債	4.7500	181	180	27,707	2024/12/01	
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社債	4.6250	237	226	34,750	2029/12/15	
H&E EQUIPMENT SERVICES 3.875 12/15/28	社債	3.8750	45	41	6,410	2028/12/15	
EMERALD DEBT MERGER 6.625 12/15/30	社債	6.6250	115	117	17,938	2030/12/15	
WMG ACQUISITION CORP 3.75 12/01/29	社債	3.7500	77	71	10,950	2029/12/01	
VICI PROPERTIES / NOTE 4.625 12/01/29	社債	4.6250	90	87	13,353	2029/12/01	
WARRIOR MET COAL INC 7.875 12/01/28	社債	7.8750	45	47	7,197	2028/12/01	
BOYD GAMING CORP 4.75 12/01/27	社債	4.7500	190	186	28,565	2027/12/01	
SEAGATE HDD CAYMAN 8.25 12/15/29	社債	8.2500	18	19	2,980	2029/12/15	
PENNYMAC FIN SVCS INC 7.875 12/15/29	社債	7.8750	48	50	7,749	2029/12/15	
合計	-	-	35,935	35,359	5,414,954	-	

■投資信託財産の構成

2024年11月11日現在

項 目	第46作成期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
L A U S インカム マザー ファンド	4,345,547	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	61,131	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	4,406,679	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末のL A U S インカム マザー ファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、6,550,985千円、98.0％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年11月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=153.14円、1ユーロ=164.04円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月10日)、 (2024年7月10日)、 (2024年8月13日)、 (2024年9月10日)、 (2024年10月10日)、 (2024年11月11日)現在

項 目	第270期末	第271期末	第272期末	第273期末	第274期末	第275期末
(A)資 産	4,473,507,476円	4,616,768,545円	4,195,524,316円	4,101,277,763円	4,280,194,705円	4,406,679,095円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	44,863,773	15,198,308	58,393,026	68,617,289	52,171,396	61,131,889
L A U S インカム マザーファンド(評価額)	4,428,643,703	4,531,570,237	4,137,131,290	4,032,660,474	4,228,023,309	4,345,547,206
未 収 入 金	-	70,000,000	-	-	-	-
(B)負 債	18,963,667	21,892,735	19,414,479	17,293,892	17,957,364	22,010,338
未 払 収 益 分 配 金	11,356,208	11,294,903	11,127,622	11,045,494	11,045,572	11,001,939
未 払 解 約 金	726,055	3,818,141	895,565	450,897	739,749	4,142,904
未 払 信 託 報 酬	6,867,725	6,766,214	7,376,601	5,785,975	6,159,777	6,851,845
そ の 他 未 払 費 用	13,679	13,477	14,691	11,526	12,266	13,650
(C)純 資 産 総 額(A-B)	4,454,543,809	4,594,875,810	4,176,109,837	4,083,983,871	4,262,237,341	4,384,668,757
元 本	3,785,402,902	3,764,967,804	3,709,207,609	3,681,831,370	3,681,857,377	3,667,313,200
次 期 繰 越 損 益 金	669,140,907	829,908,006	466,902,228	402,152,501	580,379,964	717,355,557
(D)受 益 権 総 口 数	3,785,402,902口	3,764,967,804口	3,709,207,609口	3,681,831,370口	3,681,857,377口	3,667,313,200口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,768円	12,204円	11,259円	11,092円	11,576円	11,956円

(注) 第269期末における元本額は3,796,099,802円、当作成期間(第270期~第275期)中における追加設定元本額は62,939,382円、同解約元本額は191,725,984円です。

■損益の状況

[自 2024年5月11日] [自 2024年6月11日] [自 2024年7月11日] [自 2024年8月14日] [自 2024年9月11日] [自 2024年10月11日]
 [至 2024年6月10日] [至 2024年7月10日] [至 2024年8月13日] [至 2024年9月10日] [至 2024年10月10日] [至 2024年11月11日]

項 目	第270期	第271期	第272期	第273期	第274期	第275期
(A)配当等収益	3,156円	1,230円	7,019円	6,248円	9,604円	8,126円
受取利息	3,156	1,230	7,019	6,248	9,604	8,126
(B)有価証券売買損益	42,926,999	182,210,305	△332,026,489	△44,448,521	195,221,526	156,986,309
売 買 益	43,039,823	182,926,533	2,356,054	148,672	195,415,435	157,524,771
売 買 損	△112,824	△716,228	△334,382,543	△44,597,193	△193,909	△538,462
(C)信託報酬等	△6,881,404	△6,779,691	△7,391,292	△5,797,501	△6,172,043	△6,865,495
(D)当期損益金(A+B+C)	36,048,751	175,431,844	△339,410,762	△50,239,774	189,059,087	150,128,940
(E)前期繰越損益金	890,560,831	907,569,073	1,054,441,038	696,712,085	633,050,910	804,283,990
(F)追加信託差損益金	△246,112,467	△241,798,008	△237,000,426	△233,274,316	△230,684,461	△226,055,434
(配当等相当額)	(381,779,199)	(382,478,435)	(378,237,178)	(378,451,338)	(382,384,097)	(385,516,628)
(売買損益相当額)	(△627,891,666)	(△624,276,443)	(△615,237,604)	(△611,725,654)	(△613,068,558)	(△611,572,062)
(G)合 計(D+E+F)	680,497,115	841,202,909	478,029,850	413,197,995	591,425,536	728,357,496
(H)収益分配金	△11,356,208	△11,294,903	△11,127,622	△11,045,494	△11,045,572	△11,001,939
次期繰越損益金(G+H)	669,140,907	829,908,006	466,902,228	402,152,501	580,379,964	717,355,557
追加信託差損益金	△246,112,467	△241,798,008	△237,000,426	△233,274,316	△230,684,461	△226,055,434
(配当等相当額)	(381,796,133)	(382,509,275)	(378,251,375)	(378,474,100)	(382,419,435)	(385,565,648)
(売買損益相当額)	(△627,908,600)	(△624,307,283)	(△615,251,801)	(△611,748,416)	(△613,103,896)	(△611,621,082)
分配準備積立金	915,253,374	1,071,706,014	1,055,489,827	1,043,040,353	1,044,959,004	1,042,633,383
繰越損益金	-	-	△351,587,173	△407,613,536	△233,894,579	△99,222,392

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用は、第270期から第275期まではL A U S インカムマザーファンド 8,224,153円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	第270期	第271期	第272期	第273期	第274期	第275期
(a)経費控除後の配当等収益	15,184,063円	17,629,207円	12,176,411円	9,378,155円	16,864,224円	17,412,095円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	20,864,688	157,802,637	0	0	0	0
(c)収益調整金	381,796,133	382,509,275	378,251,375	378,474,100	382,419,435	385,565,648
(d)分配準備積立金	890,560,831	907,569,073	1,054,441,038	1,044,707,692	1,039,140,352	1,036,223,227
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	1,308,405,715	1,465,510,192	1,444,868,824	1,432,559,947	1,438,424,011	1,439,200,970
(f)1万口当たり当期分配対象額	3,456.45	3,892.49	3,895.36	3,890.89	3,906.79	3,924.40
(g)分 配 金	11,356,208	11,294,903	11,127,622	11,045,494	11,045,572	11,001,939
(h)1万口当たり分配金	30	30	30	30	30	30

■分配金のお知らせ

決算期	第270期	第271期	第272期	第273期	第274期	第275期
1万口当たり分配金	30円	30円	30円	30円	30円	30円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「L A U S インカムマザーファンド」において、運用の指図に関する権限委託先であるロード・アベット・アンド・カンパニー エルエルシーの所在地を変更しました。

(2024年8月1日)

LA USインカムマザーファンド

運用報告書

第54期（決算日 2024年7月30日）

（計算期間 2024年1月31日～2024年7月30日）

LA USインカムマザーファンドの第54期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1997年1月31日から無期限です。
運用方針	主として米国の国債、アセットバック証券等の高格付け債、転換社債等の株式関連債およびハイイールド債に投資し、信託財産の中・長期的な成長を目指します。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 当マザーファンドにおける運用指図に関する権限をロード・アベット・アンド・カンパニーエルエルシーに委託します。
主要投資対象	米国の国債、アセットバック証券等の高格付け債や転換社債等の株式関連債およびハイイールド債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		高格付け債指数		ハイイールド債指数		株式関連債指数		株式組入比率	新株予約権付社債(転換社債)組入比率	公社債組入比率	純資産総額
	円	%	(円換算ベース)参考指数	期中騰落率	(円換算ベース)参考指数	期中騰落率	(円換算ベース)参考指数	期中騰落率				
50期(2022年8月1日)	58,752	8.9	341.52	7.1	519.64	8.1	826.53	6.4	0.2	9.1	88.4	5,824
51期(2023年1月30日)	57,065	△2.9	326.15	△4.5	515.47	△0.8	824.77	△0.2	-	15.6	82.4	5,881
52期(2023年7月31日)	61,952	8.6	350.50	7.5	572.77	11.1	936.92	13.6	0.2	12.8	84.8	6,226
53期(2024年1月30日)	67,758	9.4	376.42	7.4	637.60	11.3	994.00	6.1	-	13.4	83.2	6,381
54期(2024年7月30日)	72,840	7.5	400.71	6.5	694.38	8.9	1,082.29	8.9	-	11.6	86.0	6,467

(注1) 新株予約権証券は、株式組入比率に含まれます。

(注2) 高格付け債指数、ハイイールド債指数および株式関連債指数の名称は、各々ICE BofA US Corporate & Government Index、ICE BofA US Cash Pay High Yield IndexおよびICE BofA All US Convertibles Indexです。(以下同じ)。

(注3) 各参考指数は、当社が独自に円換算したものです。なお、指数算出にあたっては基準価額への反映を考慮して前営業日の米ドルベースの指数値を当日の米ドル為替レート(対顧客電信売相場仲値)で円換算し、設定日の前営業日(1997年1月30日)を100として指数化しています。(以下同じ)。

(注4) ICE Data Indices, LLC(「ICE Data」)、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、明示又は黙示のいずれかを問わず、インデックス、インデックス・データ、及びそれらに含まれ、関連し、又は派生する一切のデータを含めて、商品性又は特定の目的若しくは使用への適合性の保証を含む一切の表明及び保証を否認します。ICE Data、その関係会社又はそれらの第三者サプライヤーは、インデックス、インデックス・データ若しくはそれらの構成要素の適切性、正確性、適時性又は完全性について、なんら損害賠償又は責任を負わず、インデックス、インデックス・データ及びそれらの全ての構成要素は、現状有姿において提供されるものであり、自らの責任において使用いただくものです。ICE Data、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、アセットマネジメントOne(株)又はその製品若しくはサービスを後援、推薦又は推奨するものではありません。(以下同じ)。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

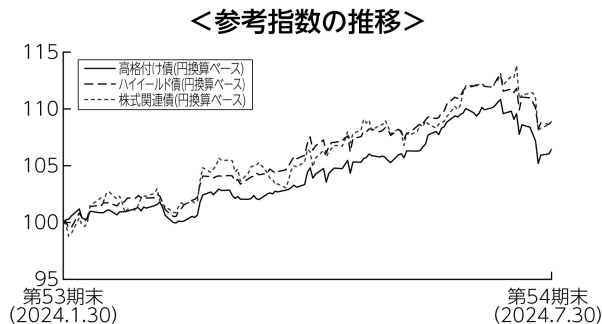
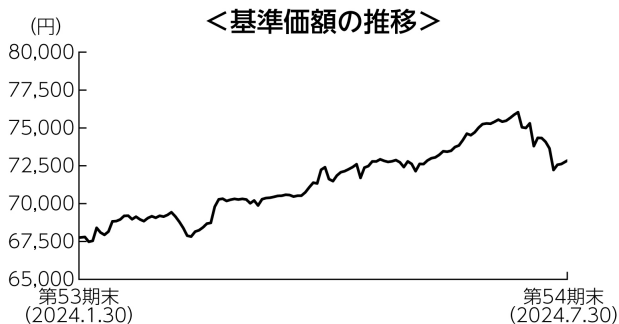
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		高格付け債指数		ハイールド債指数		株式関連債指数		株 式 組入比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 組入比率	公 社 債 組入比率
	円	騰落率	(円換算 ベース) (参考指数)	騰落率	(円換算 ベース) (参考指数)	騰落率	(円換算 ベース) (参考指数)	騰落率			
(期 首) 2024年 1月30日	円	%		%		%		%	%	%	%
	67,758	-	376.42	-	637.60	-	994.00	-	-	13.4	83.2
1 月末	67,796	0.1	377.34	0.2	638.14	0.1	992.58	△0.1	-	13.4	83.2
2 月末	69,197	2.1	381.55	1.4	652.24	2.3	1,017.07	2.3	-	12.9	80.3
3 月末	70,275	3.7	387.02	2.8	663.66	4.1	1,048.35	5.5	-	14.8	83.7
4 月末	72,238	6.6	393.14	4.4	682.22	7.0	1,058.01	6.4	-	14.4	81.6
5 月末	72,414	6.9	396.30	5.3	686.48	7.7	1,071.52	7.8	-	14.1	83.0
6 月末	75,248	11.1	414.19	10.0	713.08	11.8	1,113.54	12.0	-	12.0	85.6
(期 末) 2024年 7月30日	72,840	7.5	400.71	6.5	694.38	8.9	1,082.29	8.9	-	11.6	86.0

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 新株予約権証券は、株式組入比率に含まれます。

■当期の運用経過 (2024年1月31日から2024年7月30日まで)



(注) 各参考指数は、期首の値を100として指数化しています。

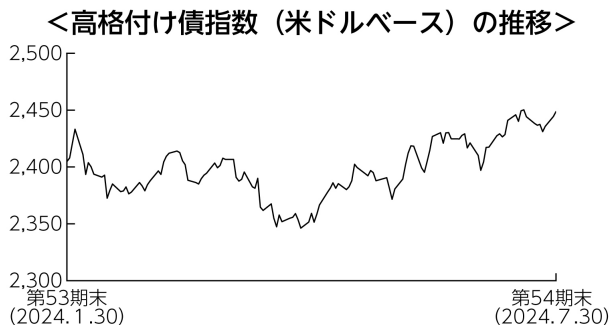
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で7.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主に米国の高格付け債やハイイールド債、転換社債等の株式関連債に投資した結果、米ドルが対円で上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

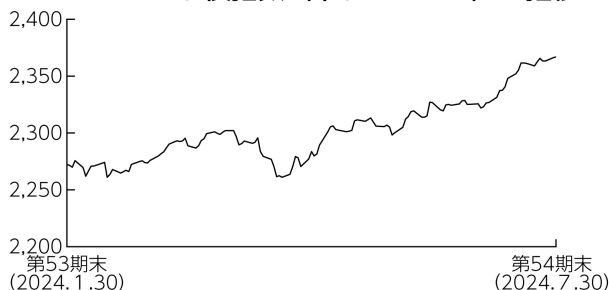
投資環境



＜高格付け債＞

米国高格付け債市場は、上昇しました。今期前半は、堅調な雇用統計やインフレの上振れを背景に、F R B (米連邦準備理事会) による利下げ観測が後退し、下落基調で推移しました。後半に入り、軟調な米景況感指数や失業率の上昇などを受け、早期利下げの可能性が再び意識されたことなどから上昇に転じました。

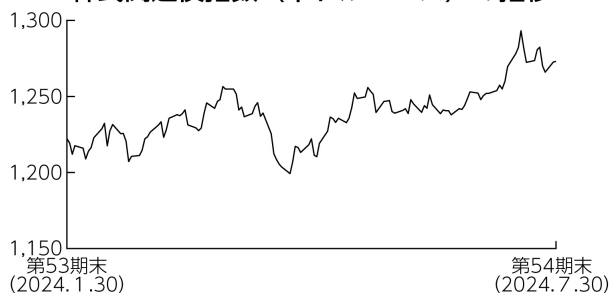
<ハイイールド債指数（米ドルベース）の推移>



<ハイイールド債>

米国ハイイールド債市場は、上昇しました。今期前半は良好な企業決算が好感されたことなどが上昇要因となった一方で、堅調な経済指標などを背景に金利が上昇したことが下落要因となり、一進一退で推移しました。期末にかけて、軟調な米景況感指数や失業率の上昇などを受け、早期利下げの可能性が再び意識されたことなどから上昇基調で推移しました。

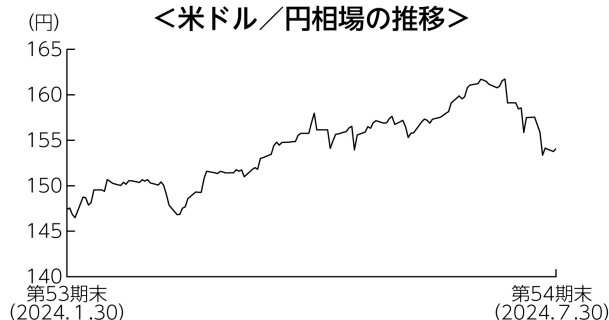
<株式関連債指数（米ドルベース）の推移>



<株式関連債>

米国株式関連債市場は、上昇しました。今期前半は、良好な企業決算が見られるも、堅調な経済指標などを背景に米金融引締めが長期化するとの見方が強まった中、レンジ推移となりました。しかし、期末にかけて、軟調な米景況感指数や失業率の上昇などを受け、早期利下げの可能性が再び意識されたことなどから上昇基調に転じました。

<米ドル／円相場の推移>



<為替市場>

米ドルは、対円で上昇しました。

2024年7月上旬にかけては、日銀はマイナス金利政策の終了を発表しましたが、根強い米インフレ圧力を背景に米金融引締めの長期化観測が高まったことなどから上昇基調で推移しました。7月中旬以降は、軟調な米景況感指数や米雇用統計に加え、日本の通貨当局による円買い介入とともに、日銀の追加利上げ観測が強まったことから、円高ドル安が進行しました。

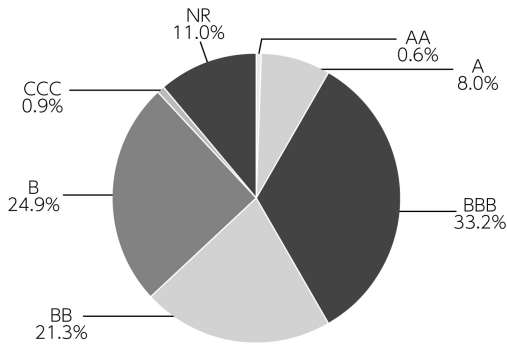
ポートフォリオについて

各セクターの相対的な価値判断に基づき、期を通じてハイイールド債や高格付け債を中心にポートフォリオを構成しました。当期は株式関連債の比率を引き下げた一方、ハイイールド債の比率を引き上げました。格付け別では、A格やB B格の比率を引き上げました。また、債券の組入比率は高位を維持しました。

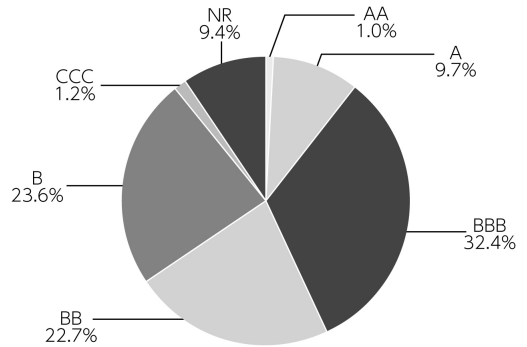
上記の運用を行った結果、米ドルが対円で上昇したことなどから、基準価額は7.5%上昇しました。

<公社債の格付け別構成>

期首



期末



(注1) 格付け別構成は、マザーファンドの公社債現物に対する評価額の割合です。(新株予約権付社債(転換社債)を含みます。)

(注2) 格付けはS & P、Moody'sのうち、低い方の格付けを採用しています。(表記方法はS & Pに準拠)

(注3) 格付けが付与されていない銘柄についてはNRと表示します。

<公社債の組入上位10銘柄>

No.	銘柄	クーポン (%)	償還日	格付け	組入比率 (%)
1	GUIDEWIRE SOFTWARE INC 1.25 03/15/25	1.250	2025/03/15	-	1.2
2	PARSONS CORP 0.25 08/15/25	0.250	2025/08/15	-	1.2
3	BOOKING HOLDINGS INC 0.75 05/01/25	0.750	2025/05/01	A	1.1
4	AXON ENTERPRISE INC 0.5 12/15/27	0.500	2027/12/15	-	1.1
5	STRIDE INC 1.125 09/01/27	1.125	2027/09/01	-	1.0
6	CNX RESOURCES CORP 2.25 05/01/26	2.250	2026/05/01	B	1.0
7	IMPINJ INC 1.125 05/15/27	1.125	2027/05/15	-	1.0
8	GLAUKOS CORP 2.75 06/15/27	2.750	2027/06/15	-	1.0
9	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	4.000	2030/11/13	BB	0.9
10	TYLER TECHNOLOGIES INC 0.25 03/15/26	0.250	2026/03/15	-	0.8

(注1) 比率は、マザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 格付けはS & P、Moody'sのうち、低い方の格付けを採用しています。(表記方法はS & Pに準拠)

(注3) 格付けが付与されていない銘柄については「-」と表示します。

今後の運用方針

米国の高格付け債やハイイールド債、転換社債等の株式関連債を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。

資産配分については、ハイイールド債および高格付け債を中心としたポートフォリオとし、株式関連債については利回りを確保しつつ、株式市場に連動した価格上昇が期待できる銘柄に着目して運用します。

個別銘柄選択においては、発行会社の有する手元流動性、経営陣の質、実物資産の価値を重視します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用 (保管費用)	25円 (24)	0.035% (0.033)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(1)	(0.002)	
合計	25	0.035	
期中の平均基準価額は71,514円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2024年1月31日から2024年7月30日まで)

(1) 新株予約権付社債 (転換社債)

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外国	アメリカ	千アメリカ・ドル 6,025	千アメリカ・ドル 8,931	千アメリカ・ドル 7,066 (-)	千アメリカ・ドル 9,800 (-)

(注1) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は予約権行使による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 公社債

		買 付 額		売 付 額	
		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル	
外国	アメリカ	特 殊 債 券	75	150 (-)	
		社 債 券	7,403	7,140 (331)	

(注1) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2024年1月31日から2024年7月30日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

(1) 外国新株予約権付社債（転換社債）

銘 柄	当 期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円
TYLER TECHNOLOGIES INC 0.25 03/15/26	278	342	52,793
GUIDEWIRE SOFTWARE INC 1.25 03/15/25	370	494	76,221
NATERA INC 2.25 05/01/27	76	206	31,799
IMPINJ INC 1.125 05/15/27	258	412	63,608
CNX RESOURCES CORP 2.25 05/01/26	204	415	64,037
BOOKING HOLDINGS INC 0.75 05/01/25	231	460	70,963
GLAUKOS CORP 2.75 06/15/27	187	406	62,682
VEECO INSTRUMENTS INC 2.875 06/01/29	121	184	28,385
ALTAIR ENGINEERING INC 1.75 06/15/27	125	166	25,683
PARSONS CORP 0.25 08/15/25	287	494	76,209
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 6.0 08/15/25	62	194	29,990
STRIDE INC 1.125 09/01/27	292	438	67,487
BROOKDALE SENIOR LIVING 2.0 10/15/26	192	216	33,410
AXON ENTERPRISE INC 0.5 12/15/27	308	443	68,337
合 計	額 面 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比率 >	2,991 14銘柄	4,878 - <11.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちB B格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 37,010	千アメリカ・ドル 36,113	千円 5,564,385	% 86.0	% 36.4	% 38.0	% 36.4	% 11.7
合 計	-	-	千円 5,564,385	86.0	36.4	38.0	36.4	11.7

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注3) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄	種類	利率	当期末				償還日
			額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル			
CITGO PETROLEUM CORP 8.375 01/15/29	特 殊 債 券	8.3750	58	60	9,316	2029/01/15	
PETROLEOS MEXICANOS 5.35 02/12/28	特 殊 債 券	5.3500	93	84	12,954	2028/02/12	
PETROLEOS MEXICANOS 10.0 02/07/33	特 殊 債 券	10.0000	41	41	6,436	2033/02/07	
ECOPETROL SA 5.875 05/28/45	特 殊 債 券	5.8750	121	87	13,423	2045/05/28	
DICK'S SPORTING GOODS 4.1 01/15/52	社 債 券	4.1000	57	40	6,301	2052/01/15	
AES CORP/THE 01/15/55	社 債 券	7.6000	47	47	7,379	2055/01/15	
AMERICAN TOWER CORP 2.95 01/15/25	社 債 券	2.9500	183	180	27,850	2025/01/15	
STANDARD CHARTERED PLC 01/11/35	社 債 券	6.0970	200	207	31,927	2035/01/11	
CENOVUS ENERGY INC 2.65 01/15/32	社 債 券	2.6500	50	41	6,464	2032/01/15	
SM ENERGY CO 6.625 01/15/27	社 債 券	6.6250	204	203	31,429	2027/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/31	社 債 券	4.0000	56	51	7,874	2031/01/15	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 6.15 01/15/33	社 債 券	6.1500	135	139	21,556	2033/01/15	
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社 債 券	4.3750	282	274	42,251	2028/01/15	
NRG ENERGY INC 5.75 01/15/28	社 債 券	5.7500	44	43	6,762	2028/01/15	
HILTON DOMESTIC OPERATIN 4.875 01/15/30	社 債 券	4.8750	134	129	19,945	2030/01/15	
APACHE CORP 4.25 01/15/30	社 債 券	4.2500	250	236	36,363	2030/01/15	
REGENCY CENTERS L.P. 5.25 01/15/34	社 債 券	5.2500	28	27	4,295	2034/01/15	
BANK OF AMERICA CORP 4.0 01/22/25	社 債 券	4.0000	95	94	14,541	2025/01/22	
HOME BANCSHARES INC 01/30/32	社 債 券	3.1250	39	32	4,985	2032/01/30	
ATHENE HOLDING LTD 3.5 01/15/31	社 債 券	3.5000	120	108	16,696	2031/01/15	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 3.25 01/31/32	社 債 券	3.2500	55	47	7,360	2032/01/31	
DICK'S SPORTING GOODS 3.15 01/15/32	社 債 券	3.1500	75	64	9,965	2032/01/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	社 債 券	6.1250	179	186	28,678	2031/01/01	
TRANSIDGM INC 4.625 01/15/29	社 債 券	4.6250	100	94	14,554	2029/01/15	
HILTON GRAND VAC BOR ESC 6.625 01/15/32	社 債 券	6.6250	54	54	8,423	2032/01/15	
CRESCENT ENERGY FINANCE 7.375 01/15/33	社 債 券	7.3750	31	31	4,823	2033/01/15	
WAND NEWCO 3 INC 7.625 01/30/32	社 債 券	7.6250	66	68	10,603	2032/01/30	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 9.25 01/15/29	社 債 券	9.2500	85	90	14,004	2029/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/30	社 債 券	4.0000	47	43	6,753	2030/01/15	
BACARDI LTD / MARTINI BV 5.25 01/15/29	社 債 券	5.2500	37	36	5,694	2029/01/15	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN 7.25 01/15/31	社 債 券	7.2500	32	33	5,158	2031/01/15	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 6.35 01/15/29	社 債 券	6.3500	42	43	6,758	2029/01/15	
HAWAIIAN AIRLINES 13-1A 3.9 01/15/26	社 債 券	3.9000	168	162	25,033	2026/01/15	
MICRON TECHNOLOGY INC 5.3 01/15/31	社 債 券	5.3000	26	26	4,053	2031/01/15	
STENA INTERNATIONAL SA 7.25 01/15/31	社 債 券	7.2500	200	204	31,570	2031/01/15	
UBS GROUP AG 01/12/29	社 債 券	3.8690	250	239	36,884	2029/01/12	
AVIATION CAPITAL GROUP 1.95 01/30/26	社 債 券	1.9500	25	23	3,654	2026/01/30	
BLACKSTONE PRIVATE CRE 6.25 01/25/31	社 債 券	6.2500	44	44	6,862	2031/01/25	
CITIZENS FINANCIAL GROUP 01/23/30	社 債 券	5.8410	43	43	6,704	2030/01/23	
US BANCORP 01/23/30	社 債 券	5.3840	43	43	6,720	2030/01/23	
ARES CAPITAL CORP 7.0 01/15/27	社 債 券	7.0000	71	73	11,261	2027/01/15	
LIFE TIME INC 5.75 01/15/26	社 債 券	5.7500	115	114	17,650	2026/01/15	
ABC SUPPLY CO INC 4.0 01/15/28	社 債 券	4.0000	50	47	7,298	2028/01/15	
NEWMARK GROUP INC 7.5 01/12/29	社 債 券	7.5000	24	25	3,883	2029/01/12	
DANSKE BANK A/S 01/09/26	社 債 券	6.4660	200	200	30,926	2026/01/09	
CHURCHILL DOWNS INC 4.75 01/15/28	社 債 券	4.7500	190	183	28,249	2028/01/15	
CARNIVAL CORP 6.65 01/15/28	社 債 券	6.6500	150	150	23,239	2028/01/15	
APACHE CORP 5.25 02/01/42	社 債 券	5.2500	60	52	8,097	2042/02/01	
DEUTSCHE BANK NY 02/10/34	社 債 券	7.0790	200	207	31,930	2034/02/10	
APPLE INC 3.25 02/23/26	社 債 券	3.2500	175	171	26,393	2026/02/23	
CALPINE CORP 5.0 02/01/31	社 債 券	5.0000	206	194	29,922	2031/02/01	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO 7.875 02/15/31	社 債 券	7.8750	47	47	7,367	2031/02/15	
HOWDEN UK REFINANCE / US 7.25 02/15/31	社 債 券	7.2500	200	200	30,906	2031/02/15	
PHILIP MORRIS INTL INC 5.125 02/13/31	社 債 券	5.1250	36	36	5,587	2031/02/13	
OLIN CORP 5.0 02/01/30	社 債 券	5.0000	51	48	7,499	2030/02/01	
UNITED AIR 2024-1 AA PTT 5.45 02/15/37	社 債 券	5.4500	45	45	7,011	2037/02/15	
OVINTIV INC 6.5 02/01/38	社 債 券	6.5000	79	82	12,724	2038/02/01	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6 02/23/28	社 債 券	4.6000	59	58	9,014	2028/02/23	
OCEANEERING INTL INC 6.0 02/01/28	社 債 券	6.0000	82	81	12,531	2028/02/01	
WESTERN DIGITAL CORP 3.1 02/01/32	社 債 券	3.1000	56	46	7,125	2032/02/01	

銘柄	当 期 未					償還日
	種類	利率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
SYNCHRONY FINANCIAL 7.25 02/02/33	社 債 券	7.2500	101	102	15,863	2033/02/02
PATTERSON-JTI ENERGY INC 3.95 02/01/28	社 債 券	3.9500	170	161	24,959	2028/02/01
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 4.05 02/01/30	社 債 券	4.0500	140	132	20,404	2030/02/01
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.0 02/15/29	社 債 券	3.0000	163	146	22,575	2029/02/15
MEG ENERGY CORP 5.875 02/01/29	社 債 券	5.8750	91	90	13,875	2029/02/01
ALLY FINANCIAL INC 6.7 02/14/33	社 債 券	6.7000	123	125	19,301	2033/02/14
PTC INC 4.0 02/15/28	社 債 券	4.0000	47	44	6,901	2028/02/15
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER 5.875 02/01/29	社 債 券	5.8750	106	105	16,207	2029/02/01
RAYTHEON TECH CORP 5.15 02/27/33	社 債 券	5.1500	43	43	6,670	2033/02/27
SUNCOR ENERGY INC 7.15 02/01/32	社 債 券	7.1500	101	112	17,266	2032/02/01
HECLA MINING CO 7.25 02/15/28	社 債 券	7.2500	165	166	25,629	2028/02/15
AMC NETWORKS INC 4.25 02/15/29	社 債 券	4.2500	58	39	6,130	2029/02/15
XPO INC 7.125 02/01/32	社 債 券	7.1250	38	39	6,080	2032/02/01
PTC INC 3.625 02/15/25	社 債 券	3.6250	92	90	14,019	2025/02/15
GENTING NY LLC/GENNY CAP 3.3 02/15/26	社 債 券	3.3000	200	192	29,671	2026/02/15
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER 5.5 02/01/26	社 債 券	5.5000	91	90	13,922	2026/02/01
CDW LLC/CDW FINANCE 3.25 02/15/29	社 債 券	3.2500	125	114	17,638	2029/02/15
BOMBARDIER INC 7.5 02/01/29	社 債 券	7.5000	42	43	6,768	2029/02/01
CAESARS ENTERTAIN INC 7.0 02/15/30	社 債 券	7.0000	62	63	9,857	2030/02/15
TRANSOCEAN INC 8.75 02/15/30	社 債 券	8.7500	112	118	18,242	2030/02/15
VENTURE GLOBAL LNG INC 9.5 02/01/29	社 債 券	9.5000	49	54	8,392	2029/02/01
AMERICAN AIRLINES INC 7.25 02/15/28	社 債 券	7.2500	174	174	26,822	2028/02/15
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.0 02/01/28	社 債 券	5.0000	141	133	20,603	2028/02/01
FREEDOM MORTGAGE HOLD 9.25 02/01/29	社 債 券	9.2500	21	21	3,255	2029/02/01
KODIAK GAS SERVICES LLC 7.25 02/15/29	社 債 券	7.2500	21	21	3,336	2029/02/15
IQVIA INC 6.25 02/01/29	社 債 券	6.2500	29	30	4,652	2029/02/01
TOLL BROS FINANCE CORP 4.875 03/15/27	社 債 券	4.8750	85	84	13,005	2027/03/15
ABN AMRO BANK NV 03/13/37	社 債 券	3.3240	200	167	25,781	2037/03/13
SPRINT CORP 7.625 03/01/26	社 債 券	7.6250	165	169	26,154	2026/03/01
NEUBERGER BERMAN GRP/FIN 4.5 03/15/27	社 債 券	4.5000	100	96	14,937	2027/03/15
BROWN & BROWN INC 2.375 03/15/31	社 債 券	2.3750	78	65	10,043	2031/03/15
GOODMAN US FIN THREE 3.7 03/15/28	社 債 券	3.7000	38	35	5,545	2028/03/15
WEBSTER FINANCIAL CORP 4.1 03/25/29	社 債 券	4.1000	96	90	13,911	2029/03/25
SPRINT CAPITAL CORP 8.75 03/15/32	社 債 券	8.7500	50	60	9,333	2032/03/15
CALPINE CORP 3.75 03/01/31	社 債 券	3.7500	77	68	10,567	2031/03/01
LEGGETT & PLATT INC 4.4 03/15/29	社 債 券	4.4000	56	52	8,078	2029/03/15
SOUTHWEST GAS CORP 4.05 03/15/32	社 債 券	4.0500	46	42	6,525	2032/03/15
CIT GROUP INC 6.125 03/09/28	社 債 券	6.1250	156	160	24,702	2028/03/09
MAGELLAN MIDSTREAM PARTN 3.95 03/01/50	社 債 券	3.9500	103	76	11,790	2050/03/01
TWILIO INC 3.875 03/15/31	社 債 券	3.8750	29	25	3,999	2031/03/15
COMMERCIAL METALS CO 4.375 03/15/32	社 債 券	4.3750	70	64	9,906	2032/03/15
JACOBS ENGINEERING GROUP 5.9 03/01/33	社 債 券	5.9000	75	76	11,746	2033/03/01
AG ISSUER LLC 6.25 03/01/28	社 債 券	6.2500	271	257	39,612	2028/03/01
ADVANCE AUTO PARTS 3.5 03/15/32	社 債 券	3.5000	143	123	18,993	2032/03/15
CONSTELLATION EN GEN LLC 5.8 03/01/33	社 債 券	5.8000	65	67	10,348	2033/03/01
TRIMBLE INC 6.1 03/15/33	社 債 券	6.1000	65	68	10,507	2033/03/15
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 6.25 03/15/32	社 債 券	6.2500	43	43	6,776	2032/03/15
UNITED STATES STEEL CORP 6.875 03/01/29	社 債 券	6.8750	97	97	15,028	2029/03/01
FREEPORT-MCMORAN INC 4.125 03/01/28	社 債 券	4.1250	93	90	13,872	2028/03/01
HILLENBRAND INC 3.75 03/01/31	社 債 券	3.7500	49	43	6,637	2031/03/01
OCI NV 6.7 03/16/33	社 債 券	6.7000	200	198	30,623	2033/03/16
COMSTOCK RESOURCES INC 6.75 03/01/29	社 債 券	6.7500	86	83	12,897	2029/03/01
SOLVENTUM CORP 5.6 03/23/34	社 債 券	5.6000	34	33	5,221	2034/03/23
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 4.5 03/01/28	社 債 券	4.5000	100	95	14,725	2028/03/01
TWILIO INC 3.625 03/15/29	社 債 券	3.6250	30	27	4,190	2029/03/15
SOLVENTUM CORP 5.45 03/13/31	社 債 券	5.4500	55	55	8,486	2031/03/13
ANTERO RESOURCES CORP 5.375 03/01/30	社 債 券	5.3750	67	65	10,088	2030/03/01
SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.375 03/15/30	社 債 券	5.3750	66	64	9,925	2030/03/15
ALCOA NEDERLAND HOLDING 7.125 03/15/31	社 債 券	7.1250	200	206	31,805	2031/03/15
CARNIVAL CORP 5.75 03/01/27	社 債 券	5.7500	175	174	26,847	2027/03/01
CHARLES RIVER LABORATORI 3.75 03/15/29	社 債 券	3.7500	50	46	7,141	2029/03/15
BELLRING BRANDS INC 7.0 03/15/30	社 債 券	7.0000	45	46	7,151	2030/03/15
MACQUARIE AIRFINANCE HLD 6.5 03/26/31	社 債 券	6.5000	31	32	4,958	2031/03/26

銘柄	当 期 未					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
BAE SYSTEMS PLC 5.25 03/26/31	社債	5.2500	200	202	31,173	2031/03/26
NAVIENT CORP 5.5 03/15/29	社債	5.5000	136	126	19,484	2029/03/15
CLOUD SOFTWARE GRP HOLDG 6.5 03/31/29	社債	6.5000	75	73	11,289	2029/03/31
OLD REPUBLIC INTL CORP 5.75 03/28/34	社債	5.7500	28	28	4,364	2034/03/28
BALL CORP 6.875 03/15/28	社債	6.8750	59	60	9,362	2028/03/15
LPL HOLDINGS INC 4.0 03/15/29	社債	4.0000	100	93	14,434	2029/03/15
POLARIS INC 6.95 03/15/29	社債	6.9500	18	18	2,927	2029/03/15
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.412 03/15/26	社債	6.4120	125	124	19,243	2026/03/15
TRANSCANADA PIPELINES 03/09/26	社債	6.8718	192	192	29,604	2026/03/09
NEXTERA ENERGY CAPITAL 6.051 03/01/25	社債	6.0510	43	43	6,658	2025/03/01
HORMEL FOODS CORP 4.8 03/30/27	社債	4.8000	181	181	28,015	2027/03/30
DELEK LOG PART/FINANCE 8.625 03/15/29	社債	8.6250	64	66	10,225	2029/03/15
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.8 03/08/29	社債	5.8000	200	201	31,019	2029/03/08
BLACKROCK FUNDING INC 4.7 03/14/29	社債	4.7000	16	16	2,480	2029/03/14
USA COM PART/USA COM FIN 7.125 03/15/29	社債	7.1250	35	35	5,492	2029/03/15
ASTON MARTIN CAPITAL HOL 10.0 03/31/29	社債	10.0000	200	200	30,820	2029/03/31
WILLIAMS COMPANIES INC 4.9 03/15/29	社債	4.9000	84	83	12,912	2029/03/15
NEWELL BRANDS INC 4.2 04/01/26	社債	5.7000	125	124	19,185	2026/04/01
MCCORMICK & CO 4.95 04/15/33	社債	4.9500	51	50	7,826	2033/04/15
DT MIDSTREAM INC 4.3 04/15/32	社債	4.3000	47	43	6,640	2032/04/15
REGAL REXNORD CORP 6.4 04/15/33	社債	6.4000	45	46	7,189	2033/04/15
VITAL ENERGY INC 7.875 04/15/32	社債	7.8750	53	54	8,344	2032/04/15
CRESCENT ENERGY FINANCE 7.625 04/01/32	社債	7.6250	35	35	5,531	2032/04/01
MATADOR RESOURCES CO 6.5 04/15/32	社債	6.5000	45	45	6,955	2032/04/15
APACHE CORP 4.75 04/15/43	社債	4.7500	45	36	5,619	2043/04/15
SWISS RE SUB FIN PLC 04/05/35	社債	5.6980	200	202	31,128	2035/04/05
STEEL DYNAMICS INC 3.45 04/15/30	社債	3.4500	49	45	6,974	2030/04/15
FMG RESOURCES AUG 2006 4.375 04/01/31	社債	4.3750	100	90	14,008	2031/04/01
JANE STREET GRP/JSG FIN 7.125 04/30/31	社債	7.1250	59	61	9,455	2031/04/30
HUNT COS INC 5.25 04/15/29	社債	5.2500	46	43	6,649	2029/04/15
MGM RESORTS INTL 5.5 04/15/27	社債	5.5000	150	148	22,956	2027/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.625 04/15/29	社債	4.6250	28	26	4,073	2029/04/15
TOTALENERGIES CAPITAL SA 5.15 04/05/34	社債	5.1500	46	46	7,197	2034/04/05
ALLIANT HOLD / CO-ISSUER 6.75 04/15/28	社債	6.7500	80	80	12,428	2028/04/15
SYSTEM ENERGY RESOURCES 6.0 04/15/28	社債	6.0000	105	108	16,643	2028/04/15
MOZART DEBT MERGER SUB 3.875 04/01/29	社債	3.8750	125	116	17,984	2029/04/01
MATADOR RESOURCES CO 6.875 04/15/28	社債	6.8750	26	26	4,085	2028/04/15
ENTEGRIS ESCROW CORP 4.75 04/15/29	社債	4.7500	97	93	14,410	2029/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.375 04/15/26	社債	4.3750	70	68	10,507	2026/04/15
ZF NA CAPITAL 6.875 04/14/28	社債	6.8750	150	153	23,673	2028/04/14
WEATHERFORD INTERNATIONA 8.625 04/30/30	社債	8.6250	104	108	16,658	2030/04/30
REGAL REXNORD CORP 6.05 04/15/28	社債	6.0500	41	41	6,447	2028/04/15
BAYTEX ENERGY CORP 8.5 04/30/30	社債	8.5000	35	36	5,694	2030/04/30
GENERAL MOTORS FINL CO 5.4 04/06/26	社債	5.4000	27	27	4,173	2026/04/06
ADVANCE AUTO PARTS 3.9 04/15/30	社債	3.9000	80	73	11,325	2030/04/15
CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO 7.875 04/01/30	社債	7.8750	42	42	6,583	2030/04/01
EQM MIDSTREAM PARTNERS L 6.375 04/01/29	社債	6.3750	41	41	6,439	2029/04/01
VALARIS LTD 8.375 04/30/30	社債	8.3750	60	62	9,669	2030/04/30
CORECIVIC INC 8.25 04/15/29	社債	8.2500	120	125	19,388	2029/04/15
RENAISSANCERE FINANCE 3.7 04/01/25	社債	3.7000	215	212	32,735	2025/04/01
GEO GROUP INC/THE 8.625 04/15/29	社債	8.6250	64	66	10,272	2029/04/15
RENAISSANCERE HOLDINGS L 3.6 04/15/29	社債	3.6000	91	85	13,182	2029/04/15
HAWAIIAN BRAND INTELLECT 11.0 04/15/29	社債	11.0000	42	38	5,994	2029/04/15
RAYONIER LP 2.75 05/17/31	社債	2.7500	100	85	13,125	2031/05/17
TENET HEALTHCARE CORP 6.75 05/15/31	社債	6.7500	52	53	8,234	2031/05/15
OWENS-BROCKWAY 7.25 05/15/31	社債	7.2500	41	40	6,255	2031/05/15
TRANSOCEAN INC 8.5 05/15/31	社債	8.5000	31	31	4,879	2031/05/15
ENCINO ACQUISITION PARTN 8.75 05/01/31	社債	8.7500	29	30	4,690	2031/05/01
ONEMAIN FINANCE CORP 7.5 05/15/31	社債	7.5000	123	126	19,510	2031/05/15
PULTE GROUP INC 6.375 05/15/33	社債	6.3750	48	51	7,931	2033/05/15
MONONGAHELA POWER CO 3.55 05/15/27	社債	3.5500	173	166	25,728	2027/05/15
HERSHEY COMPANY 4.5 05/04/33	社債	4.5000	45	44	6,872	2033/05/04
JETBLUE 2019-1 CLASS A 2.95 05/15/28	社債	2.9500	31	28	4,414	2028/05/15

銘柄	当 期 未					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
GOODMAN US FIN FIVE LLC 4.625 05/04/32	社 債 券	4.6250	40	37	5,819	2032/05/04
NEWS CORP 3.875 05/15/29	社 債 券	3.8750	64	59	9,117	2029/05/15
MIDWEST GAMING BORROWER 4.875 05/01/29	社 債 券	4.8750	119	112	17,314	2029/05/01
BOEING CO 5.15 05/01/30	社 債 券	5.1500	45	44	6,780	2030/05/01
RANGE RESOURCES CORP 4.875 05/15/25	社 債 券	4.8750	191	189	29,249	2025/05/15
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.0 05/01/28	社 債 券	5.0000	146	140	21,606	2028/05/01
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 4.5 05/01/32	社 債 券	4.5000	50	41	6,402	2032/05/01
BOEING CO 6.528 05/01/34	社 債 券	6.5280	25	26	4,007	2034/05/01
FMC CORP 5.65 05/18/33	社 債 券	5.6500	43	43	6,637	2033/05/18
EQUIPMENTSHARE.COM INC 8.625 05/15/32	社 債 券	8.6250	26	26	4,158	2032/05/15
ENI SPA 5.5 05/15/34	社 債 券	5.5000	200	202	31,236	2034/05/15
BLOCK INC 6.5 05/15/32	社 債 券	6.5000	74	75	11,636	2032/05/15
ATLASSIAN CORPORATION 5.5 05/15/34	社 債 券	5.5000	45	45	6,973	2034/05/15
JPMORGAN CHASE & CO 05/01/28	社 債 券	3.5400	110	105	16,325	2028/05/01
LPL HOLDINGS INC 6.0 05/20/34	社 債 券	6.0000	45	44	6,921	2034/05/20
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/27	社 債 券	5.1250	180	174	26,909	2027/05/01
ALLY FINANCIAL INC 05/15/26	社 債 券	4.7000	95	86	13,375	2026/05/15
BOEING CO 5.04 05/01/27	社 債 券	5.0400	135	133	20,556	2027/05/01
SCIH SALT HOLDINGS INC 4.875 05/01/28	社 債 券	4.8750	100	93	14,355	2028/05/01
VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.5 05/15/29	社 債 券	5.5000	200	186	28,687	2029/05/15
ALLEGION US HOLDING CO 5.6 05/29/34	社 債 券	5.6000	27	27	4,226	2034/05/29
DELTA AIR LINES INC 7.0 05/01/25	社 債 券	7.0000	135	136	20,982	2025/05/01
HUNTINGTON INGALLS INDUS 4.2 05/01/30	社 債 券	4.2000	139	132	20,483	2030/05/01
UNIVISION COMMUNICATIONS 4.5 05/01/29	社 債 券	4.5000	100	87	13,459	2029/05/01
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.5 05/15/30	社 債 券	4.5000	92	89	13,814	2030/05/15
AMERICAN AIRLINES INC 8.5 05/15/29	社 債 券	8.5000	46	47	7,318	2029/05/15
ROBLOX CORP 3.875 05/01/30	社 債 券	3.8750	146	130	20,129	2030/05/01
EQUIPMENTSHARE.COM INC 9.0 05/15/28	社 債 券	9.0000	85	87	13,520	2028/05/15
GRAY TELEVISION INC 7.0 05/15/27	社 債 券	7.0000	50	48	7,431	2027/05/15
EQUIPMENTSHARE.COM INC 9.0 05/15/28	社 債 券	9.0000	23	23	3,655	2028/05/15
MINERAL RESOURCES LTD 8.5 05/01/30	社 債 券	8.5000	75	78	12,080	2030/05/01
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.65 05/19/30	社 債 券	4.6500	56	56	8,638	2030/05/19
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS 5.25 05/15/30	社 債 券	5.2500	250	216	33,335	2030/05/15
FMC CORP 5.15 05/18/26	社 債 券	5.1500	42	41	6,469	2026/05/18
VISTRA OPERATIONS CO LLC 5.125 05/13/25	社 債 券	5.1250	300	298	46,016	2025/05/13
TRANSOCEAN INC 8.25 05/15/29	社 債 券	8.2500	22	22	3,458	2029/05/15
GXO LOGISTICS INC 6.25 05/06/29	社 債 券	6.2500	41	42	6,518	2029/05/06
CENOVUS ENERGY INC 5.4 06/15/47	社 債 券	5.4000	108	101	15,623	2047/06/15
DTE ENERGY COMPANY 3.4 06/15/29	社 債 券	3.4000	100	93	14,352	2029/06/15
HEALTH CARE SERVICE CORP 5.875 06/15/54	社 債 券	5.8750	18	17	2,762	2054/06/15
BRITISH AIR 19-1 A PTT 3.35 06/15/29	社 債 券	3.3500	200	189	29,187	2029/06/15
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75 06/01/28	社 債 券	5.7500	102	103	15,930	2028/06/01
HCA INC 5.5 06/01/33	社 債 券	5.5000	46	46	7,115	2033/06/01
KAISER ALUMINUM CORP 4.5 06/01/31	社 債 券	4.5000	62	54	8,465	2031/06/01
HCA INC 7.69 06/15/25	社 債 券	7.6900	136	138	21,352	2025/06/15
VERISIGN INC 2.7 06/15/31	社 債 券	2.7000	53	45	6,957	2031/06/15
CABOT CORP 5.0 06/30/32	社 債 券	5.0000	60	59	9,106	2032/06/30
SM ENERGY CO 5.625 06/01/25	社 債 券	5.6250	65	65	10,018	2025/06/01
WESTERN ALLIANCE BANCORP 06/15/31	社 債 券	3.0000	77	68	10,529	2031/06/15
LKQ CORP 6.25 06/15/33	社 債 券	6.2500	56	57	8,909	2033/06/15
CLOUD SOFTWARE GRP INC 8.25 06/30/32	社 債 券	8.2500	70	72	11,198	2032/06/30
LIFEPOINT HEALTH INC 10.0 06/01/32	社 債 券	10.0000	50	52	8,136	2032/06/01
VENTURE GLOBAL LNG INC 8.375 06/01/31	社 債 券	8.3750	50	52	8,087	2031/06/01
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP 6.5 06/01/32	社 債 券	6.5000	16	16	2,527	2032/06/01
MADISON IAQ LLC 4.125 06/30/28	社 債 券	4.1250	45	42	6,478	2028/06/30
PANTHER ESCROW ISSUER 7.125 06/01/31	社 債 券	7.1250	52	53	8,242	2031/06/01
NETAPP INC 2.7 06/22/30	社 債 券	2.7000	20	17	2,725	2030/06/22
SOLVAY FINANCE (AMERICA) 5.85 06/04/34	社 債 券	5.8500	200	202	31,201	2034/06/04
ALBEMARLE CORP 4.65 06/01/27	社 債 券	4.6500	88	87	13,410	2027/06/01
VFH PARENT / VALOR CO 7.5 06/15/31	社 債 券	7.5000	50	51	7,894	2031/06/15
TENET HEALTHCARE CORP 4.25 06/01/29	社 債 券	4.2500	48	45	7,000	2029/06/01
AES CORP/THE 5.45 06/01/28	社 債 券	5.4500	83	83	12,858	2028/06/01
VENTURE GLOBAL LNG INC 8.125 06/01/28	社 債 券	8.1250	27	28	4,324	2028/06/01

銘柄	当 期 未					償還日
	種類	利率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
GARTNER INC 3.625 06/15/29	社債	3.6250	70	65	10,022	2029/06/15
CALPINE CORP 5.25 06/01/26	社債	5.2500	130	128	19,849	2026/06/01
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 8.625 06/01/30	社債	8.6250	51	54	8,427	2030/06/01
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.95 06/08/25	社債	4.9500	85	84	13,034	2025/06/08
DELTA AIR LINES 2020-AA 2.0 06/10/28	社債	2.0000	247	227	35,021	2028/06/10
HUB INTERNATIONAL LTD 7.25 06/15/30	社債	7.2500	64	66	10,172	2030/06/15
WINDSOR HOLDINGS III LLC 8.5 06/15/30	社債	8.5000	52	54	8,411	2030/06/15
DAVITA INC 4.625 06/01/30	社債	4.6250	130	119	18,339	2030/06/01
CALIFORNIA RESOURCES CRP 8.25 06/15/29	社債	8.2500	41	41	6,455	2029/06/15
MASTEC INC 5.9 06/15/29	社債	5.9000	40	40	6,270	2029/06/15
SATURN OIL & GAS INC 9.625 06/15/29	社債	9.6250	48	49	7,605	2029/06/15
1011778 BC / NEW RED FIN 6.125 06/15/29	社債	6.1250	49	49	7,636	2029/06/15
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF 5.4 06/12/29	社債	5.4000	41	41	6,421	2029/06/12
MORGAN STANLEY 3.125 07/27/26	社債	3.1250	175	169	26,047	2026/07/27
VERISIGN INC 4.75 07/15/27	社債	4.7500	82	81	12,500	2027/07/15
UNITED AIR 2023-1 A PTT 5.8 07/15/36	社債	5.8000	53	54	8,415	2036/07/15
NGPL PIPECO LLC 3.25 07/15/31	社債	3.2500	75	65	10,043	2031/07/15
BRIXMOR OPERATING PART 4.05 07/01/30	社債	4.0500	45	42	6,549	2030/07/01
PG&E CORP 5.25 07/01/30	社債	5.2500	47	45	7,003	2030/07/01
EQM MIDSTREAM PARTNERS L 5.5 07/15/28	社債	5.5000	65	64	9,985	2028/07/15
PARTNERRE FINANCE B LLC 3.7 07/02/29	社債	3.7000	138	130	20,045	2029/07/02
GXO LOGISTICS INC 2.65 07/15/31	社債	2.6500	57	46	7,222	2031/07/15
BLUE RACER MID LLC/FINAN 7.25 07/15/32	社債	7.2500	27	28	4,316	2032/07/15
CIVITAS RESOURCES INC 8.75 07/01/31	社債	8.7500	55	59	9,108	2031/07/01
PG&E CORP 5.0 07/01/28	社債	5.0000	59	57	8,832	2028/07/01
MASTERBRAND INC 7.0 07/15/32	社債	7.0000	12	12	1,901	2032/07/15
MURPHY OIL CORP 6.375 07/15/28	社債	6.3750	28	28	4,348	2028/07/15
CONCENTRA ESCROW ISSUER 6.875 07/15/32	社債	6.8750	22	22	3,479	2032/07/15
EMRLD BOR / EMRLD CO-ISS 6.75 07/15/31	社債	6.7500	20	20	3,153	2031/07/15
BACARDI LTD 2.75 07/15/26	社債	2.7500	300	286	44,082	2026/07/15
KINROSS GOLD CORP 6.25 07/15/33	社債	6.2500	117	123	19,019	2033/07/15
TAKEDA PHARMACEUTICAL 5.3 07/05/34	社債	5.3000	200	201	30,985	2034/07/05
ANZ BANK NEW ZEALAND LTD 5.898 07/10/34	社債	5.8980	200	202	31,253	2034/07/10
AIRCATTLE LTD 6.5 07/18/28	社債	6.5000	37	38	5,881	2028/07/18
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.165 07/15/27	社債	6.1650	128	131	20,202	2027/07/15
IMPERIAL BRANDS FIN PLC 6.125 07/27/27	社債	6.1250	200	205	31,637	2027/07/27
DPL INC 4.125 07/01/25	社債	4.1250	135	132	20,396	2025/07/01
ZEGONA FINANCE PLC 8.625 07/15/29	社債	8.6250	200	204	31,495	2029/07/15
AUSGRID FINANCE PTY LTD 4.35 08/01/28	社債	4.3500	58	56	8,699	2028/08/01
HUGHES SATELLITE SYSTEMS 5.25 08/01/26	社債	5.2500	92	69	10,695	2026/08/01
MSCI INC 3.25 08/15/33	社債	3.2500	22	18	2,871	2033/08/15
ASHTREAD CAPITAL INC 5.5 08/11/32	社債	5.5000	200	198	30,656	2032/08/11
BOARDWALK PIPELINES LP 5.625 08/01/34	社債	5.6250	65	65	10,043	2034/08/01
BOOZ ALLEN HAMILTON INC 5.95 08/04/33	社債	5.9500	47	48	7,530	2033/08/04
CHOICE HOTELS INTL INC 5.85 08/01/34	社債	5.8500	63	62	9,703	2034/08/01
NGPL PIPECO LLC 4.875 08/15/27	社債	4.8750	122	120	18,590	2027/08/15
WATCO COS LLC/FINANCE CO 7.125 08/01/32	社債	7.1250	35	35	5,527	2032/08/01
SM ENERGY CO 7.0 08/01/32	社債	7.0000	25	25	3,888	2032/08/01
LAS VEGAS SANDS CORP 3.5 08/18/26	社債	3.5000	190	183	28,240	2026/08/18
CARNIVAL CORP 4.0 08/01/28	社債	4.0000	75	71	10,957	2028/08/01
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 3.875 08/15/29	社債	3.8750	47	43	6,705	2029/08/15
NABORS INDUSTRIES INC 8.875 08/15/31	社債	8.8750	27	27	4,230	2031/08/15
BRAND INDUSTRIAL SERVICE 10.375 08/01/30	社債	10.3750	67	73	11,294	2030/08/01
LIFEPOINT HEALTH INC 9.875 08/15/30	社債	9.8750	46	50	7,710	2030/08/15
ATI INC 7.25 08/15/30	社債	7.2500	100	104	16,108	2030/08/15
SEAWORLD PARKS & ENTERTA 5.25 08/15/29	社債	5.2500	95	90	13,981	2029/08/15
JACOBS ENGINEERING GROUP 6.35 08/18/28	社債	6.3500	40	41	6,418	2028/08/18
MAUSER PACKAGING SOLUT 7.875 08/15/26	社債	7.8750	130	131	20,313	2026/08/15
HERSHEY COMPANY 7.2 08/15/27	社債	7.2000	150	160	24,781	2027/08/15
SM ENERGY CO 6.75 08/01/29	社債	6.7500	29	29	4,493	2029/08/01
KRAKEN OIL & GAS PARTNER 7.625 08/15/29	社債	7.6250	19	19	2,956	2029/08/15
LEAR CORP 3.8 09/15/27	社債	3.8000	41	39	6,073	2027/09/15
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.2 09/15/28	社債	4.2000	89	86	13,404	2028/09/15

銘柄	当 期 未						償還日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
OLIN CORP 5.125 09/15/27	社債	5.1250	18	17	2,704	2027/09/15	
FLUOR CORP 4.25 09/15/28	社債	4.2500	114	108	16,676	2028/09/15	
HCA INC 3.5 09/01/30	社債	3.5000	85	77	11,980	2030/09/01	
ONEOK INC 6.05 09/01/33	社債	6.0500	64	66	10,313	2033/09/01	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.625 09/01/30	社債	6.6250	36	38	5,895	2030/09/01	
MARVELL TECHNOLOGY INC 5.95 09/15/33	社債	5.9500	44	45	7,074	2033/09/15	
MURPHY OIL USA INC 4.75 09/15/29	社債	4.7500	133	127	19,590	2029/09/15	
WHISTLER PIPELINE LLC 5.95 09/30/34	社債	5.9500	88	88	13,612	2034/09/30	
SM ENERGY CO 6.75 09/15/26	社債	6.7500	42	42	6,482	2026/09/15	
HELMERICH & PAYNE INC 2.9 09/29/31	社債	2.9000	100	85	13,100	2031/09/29	
GLENCORE FUNDING LLC 2.5 09/01/30	社債	2.5000	90	77	11,953	2030/09/01	
USA COM PART/JUSA COM FIN 6.875 09/01/27	社債	6.8750	115	115	17,810	2027/09/01	
MATADOR RESOURCES CO 5.875 09/15/26	社債	5.8750	133	133	20,496	2026/09/15	
ENEL FINANCE INTL NV 2.65 09/10/24	社債	2.6500	200	199	30,693	2024/09/10	
ON SEMICONDUCTOR CORP 3.875 09/01/28	社債	3.8750	98	91	14,097	2028/09/01	
NORTONLIFELOCK INC 6.75 09/30/27	社債	6.7500	42	42	6,578	2027/09/30	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 6.375 09/01/29	社債	6.3750	57	55	8,516	2029/09/01	
VICI PROPERTIES / NOTE 4.5 09/01/26	社債	4.5000	145	142	21,971	2026/09/01	
INTUIT INC 5.125 09/15/28	社債	5.1250	125	127	19,619	2028/09/15	
MIRABELA NICKEL 144-A 1%	社債	0.0000	1	0	0	2044/09/10	
GLOBAL ATLANTIC FIN CO 10/15/54	社債	7.9500	30	30	4,693	2054/10/15	
TEVA PHARMACEUTICALS NE 3.15 10/01/26	社債	3.1500	90	85	13,108	2026/10/01	
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.5 10/15/32	社債	3.5000	50	44	6,830	2032/10/15	
BANK OZK 10/01/31	社債	2.7500	100	81	12,574	2031/10/01	
BAT CAPITAL CORP 7.75 10/19/32	社債	7.7500	79	90	13,942	2032/10/19	
TIFFANY & CO 4.9 10/01/44	社債	4.9000	75	71	11,048	2044/10/01	
CONSTELLATION EN GEN LLC 6.25 10/01/39	社債	6.2500	120	127	19,577	2039/10/01	
PATTERSON-UTI ENERGY INC 7.15 10/01/33	社債	7.1500	48	51	7,946	2033/10/01	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 7.5 10/15/27	社債	7.5000	90	95	14,769	2027/10/15	
CONNECT FINCO SARL/CONNIE 6.75 10/01/26	社債	6.7500	91	89	13,772	2026/10/01	
QORVO INC 4.375 10/15/29	社債	4.3750	99	94	14,498	2029/10/15	
DIAMOND FRGN/DIAMOND FIN 8.5 10/01/30	社債	8.5000	23	24	3,780	2030/10/01	
GAP INC/THE 3.625 10/01/29	社債	3.6250	105	91	14,043	2029/10/01	
VITAL ENERGY INC 9.75 10/15/30	社債	9.7500	95	104	16,032	2030/10/15	
STAR PARENT INC 9.0 10/01/30	社債	9.0000	35	37	5,758	2030/10/01	
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.875 10/15/27	社債	5.8750	68	67	10,358	2027/10/15	
LIFEPPOINT HEALTH INC 11.0 10/15/30	社債	11.0000	50	56	8,652	2030/10/15	
ROLLER BEARING CO OF AME 4.375 10/15/29	社債	4.3750	94	87	13,547	2029/10/15	
UNITED AIR 2020-1 A PTT 5.875 10/15/27	社債	5.8750	213	215	33,153	2027/10/15	
AMER AIRLINE 16-3 AA PTT 3.0 10/15/28	社債	3.0000	216	201	31,095	2028/10/15	
EVERARC ESCROW SARL 5.0 10/30/29	社債	5.0000	52	48	7,444	2029/10/30	
RETAIL OPPORTUNITY IN 6.75 10/15/28	社債	6.7500	46	48	7,405	2028/10/15	
NATIONAL FUEL GAS CO 5.5 10/01/26	社債	5.5000	80	80	12,411	2026/10/01	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 10/21/27	社債	1.9480	23	21	3,308	2027/10/21	
HP ENTERPRISE CO 5.9 10/01/24	社債	5.9000	89	88	13,712	2024/10/01	
TRUIST FINANCIAL CORP 10/30/29	社債	7.1610	140	150	23,129	2029/10/30	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.125 11/16/28	社債	4.1250	89	86	13,360	2028/11/16	
FREEPORT-MCMORAN INC 5.4 11/14/34	社債	5.4000	91	90	13,914	2034/11/14	
NETFLIX INC 5.875 11/15/28	社債	5.8750	109	113	17,512	2028/11/15	
WABTEC CORP 3.45 11/15/26	社債	3.4500	169	163	25,135	2026/11/15	
OVINTIV INC 5.15 11/15/41	社債	5.1500	23	19	3,051	2041/11/15	
MSCI INC 3.625 11/01/31	社債	3.6250	195	174	26,842	2031/11/01	
JM SMUCKER CO 6.2 11/15/33	社債	6.2000	46	49	7,593	2033/11/15	
SPRINT CAPITAL CORP 6.875 11/15/28	社債	6.8750	192	205	31,714	2028/11/15	
MOLINA HEALTHCARE INC 3.875 11/15/30	社債	3.8750	155	139	21,553	2030/11/15	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT 6.375 11/15/33	社債	6.3750	80	85	13,221	2033/11/15	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	社債	4.0000	400	362	55,806	2030/11/13	
TRANSDIGM INC 5.5 11/15/27	社債	5.5000	175	172	26,616	2027/11/15	
SVB FINANCIAL GROUP 11/15/26	社債	0.0000	155	0.5231	80	2026/11/15	
VIPER ENERGY PARTNERS LP 7.375 11/01/31	社債	7.3750	31	32	5,014	2031/11/01	
ABBVIE INC 3.2 11/21/29	社債	3.2000	80	74	11,488	2029/11/21	
CIVITAS RESOURCES INC 8.625 11/01/30	社債	8.6250	40	43	6,668	2030/11/01	
JETBLUE 2019-1 CLASS B 8.0 11/15/27	社債	8.0000	10	10	1,673	2027/11/15	

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
NEXSTAR MEDIA INC 4.75 11/01/28	社 債 券	4.7500	50	45	7,069	2028/11/01
SPIRIT AEROSYSTEMS INC 9.75 11/15/30	社 債 券	9.7500	50	55	8,597	2030/11/15
SMYRNA READY MIX CONCRET 6.0 11/01/28	社 債 券	6.0000	95	94	14,530	2028/11/01
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35 11/04/27	社 債 券	7.3500	200	210	32,405	2027/11/04
PENNYMAC FIN SVCS INC 7.125 11/15/30	社 債 券	7.1250	43	43	6,687	2030/11/15
BORR IHC LTD / BORR FIN 10.0 11/15/28	社 債 券	10.0000	192	201	31,118	2028/11/15
ARCELORMITTAL SA 6.55 11/29/27	社 債 券	6.5500	122	126	19,559	2027/11/29
LIVE NATION ENTERTAINMEN 4.875 11/01/24	社 債 券	4.8750	110	109	16,908	2024/11/01
ZOETIS INC 5.4 11/14/25	社 債 券	5.4000	20	20	3,095	2025/11/14
GLOBAL PAYMENTS INC 1.5 11/15/24	社 債 券	1.5000	45	44	6,851	2024/11/15
TENNECO INC 8.0 11/17/28	社 債 券	8.0000	50	45	6,964	2028/11/17
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7 12/15/25	社 債 券	3.7000	210	206	31,864	2025/12/15
BRITISH AIR 19-1 AA PTT 3.3 12/15/32	社 債 券	3.3000	134	122	18,853	2032/12/15
ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.011 12/15/26	社 債 券	4.0110	84	81	12,605	2026/12/15
BNP PARIBAS 12/05/34	社 債 券	5.8940	200	207	32,029	2034/12/05
CF INDUSTRIES INC 4.5 12/01/26	社 債 券	4.5000	86	84	13,039	2026/12/01
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社 債 券	3.5000	170	158	24,491	2029/12/01
AUST & NZ BANKING GROUP 6.742 12/08/32	社 債 券	6.7420	200	214	33,123	2032/12/08
TRIMBLE INC 4.75 12/01/24	社 債 券	4.7500	181	180	27,798	2024/12/01
MURPHY OIL CORP 5.875 12/01/27	社 債 券	5.8750	29	29	4,469	2027/12/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	237	227	35,119	2029/12/15
H&E EQUIPMENT SERVICES 3.875 12/15/28	社 債 券	3.8750	102	93	14,456	2028/12/15
EMERALD DEBT MERGER 6.625 12/15/30	社 債 券	6.6250	115	117	18,067	2030/12/15
WMG ACQUISITION CORP 3.75 12/01/29	社 債 券	3.7500	77	70	10,786	2029/12/01
VICI PROPERTIES / NOTE 4.625 12/01/29	社 債 券	4.6250	90	86	13,321	2029/12/01
WARRIOR MET COAL INC 7.875 12/01/28	社 債 券	7.8750	45	46	7,115	2028/12/01
BOYD GAMING CORP 4.75 12/01/27	社 債 券	4.7500	190	184	28,492	2027/12/01
SEAGATE HDD CAYMAN 8.25 12/15/29	社 債 券	8.2500	18	19	2,990	2029/12/15
PENNYMAC FIN SVCS INC 7.875 12/15/29	社 債 券	7.8750	48	50	7,749	2029/12/15
合 計	—	—	37,010	36,113	5,564,385	—

■投資信託財産の構成

2024年7月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
新 株 予 約 権 付 社 債(転 換 社 債)	751,609	11.6
公 社 債	5,564,385	85.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	171,544	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	6,487,538	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、6,433,625千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年7月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.08円、1ユーロ=166.64円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月30日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	6,487,538,936円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	89,571,219
公 社 債(評価額)	6,315,994,908
未 収 入 金	976,232
未 収 利 息	77,546,818
前 払 費 用	3,449,759
(B) 負 債	20,459,692
未 払 金	20,459,692
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	6,467,079,244
元 本	887,845,167
次 期 繰 越 損 益 金	5,579,234,077
(D) 受 益 権 総 口 数	887,845,167口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	72,840円

(注1) 期首元本額 941,831,410円
追加設定元本額 -円
一部解約元本額 53,986,243円

(注2) 期末における元本の内訳
MHAM USインカムオープンAコース(為替ヘッジあり) 84,650,158円
MHAM USインカムオープンBコース(為替ヘッジなし) 214,053,091円
MHAM USインカムオープン毎月決算コース(為替ヘッジなし) 589,141,918円
期末元本合計 887,845,167円

■損益の状況

当期 自2024年1月31日 至2024年7月30日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	160,511,284円
受 取 利 息	155,780,575
そ の 他 収 益 金	4,730,874
支 払 利 息	△165
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	317,224,930
売 買 益	449,224,859
売 買 損	△131,999,929
(C) そ の 他 費 用	△2,324,255
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	475,411,959
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,439,835,875
(F) 解 約 差 損 益 金	△336,013,757
(G) 合 計(D + E + F)	5,579,234,077
次 期 繰 越 損 益 金(G)	5,579,234,077

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。