

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252期	<決算日	2022年12月12日>
第253期	<決算日	2023年1月10日>
第254期	<決算日	2023年2月10日>
第255期	<決算日	2023年3月10日>
第256期	<決算日	2023年4月10日>
第257期	<決算日	2023年5月10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、2023年5月10日に第257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。

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

<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。

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39作成期	228期(2020年12月10日)	円	円	%	204.46	△0.1	342.77	0.7	457.72	7.8	2.2	19.3	75.9	百万円 3,386
	229期(2021年1月12日)	9,411	30	3.4	202.78	△0.8	346.02	0.9	497.12	8.6	2.2	22.0	72.1	3,478
	230期(2021年2月10日)	9,703	30	2.4	203.44	0.3	351.31	1.5	529.39	6.5	2.2	21.0	72.7	3,540
	231期(2021年3月10日)	9,758	30	△1.2	205.87	1.2	361.23	2.8	517.87	△2.2	2.1	15.4	78.0	3,489
	232期(2021年4月12日)	9,922	30	2.0	208.29	1.2	369.59	2.3	533.42	3.0	2.2	15.9	78.6	3,555
第40作成期	233期(2021年5月10日)	9,810	30	△0.8	207.78	△0.2	368.70	△0.2	516.38	△3.2	2.4	14.8	77.6	3,600
	234期(2021年6月10日)	9,874	30	1.0	211.05	1.6	374.18	1.5	526.83	2.0	4.4	13.6	77.8	3,578
	235期(2021年7月12日)	10,016	30	1.7	214.13	1.5	379.94	1.5	541.78	2.8	2.5	13.6	78.6	3,661
	236期(2021年8月10日)	9,986	30	0.0	214.91	0.4	379.57	△0.1	543.38	0.3	2.9	11.4	79.8	3,673
	237期(2021年9月10日)	10,029	30	0.7	214.94	0.0	381.63	0.5	548.48	0.9	3.1	11.7	82.0	3,591
第41作成期	238期(2021年10月11日)	10,052	30	0.5	215.93	0.5	388.17	1.7	552.77	0.8	2.9	10.4	83.7	3,593
	239期(2021年11月10日)	10,320	30	3.0	220.47	2.1	393.68	1.4	582.97	5.5	2.8	12.7	81.4	3,682
	240期(2021年12月10日)	10,176	30	△1.1	219.76	△0.3	393.33	△0.1	552.81	△5.2	3.1	10.0	83.1	3,662
	241期(2022年1月11日)	10,167	30	0.2	219.57	△0.1	398.07	1.2	546.53	△1.1	3.7	6.7	85.2	3,700
	242期(2022年2月10日)	9,902	30	△2.3	216.51	△1.4	392.34	△1.4	540.05	△1.2	3.3	5.9	85.6	3,597
第42作成期	243期(2022年3月10日)	9,667	30	△2.1	213.71	△1.3	385.87	△1.6	519.73	△3.8	3.0	2.5	88.4	3,497
	244期(2022年4月11日)	10,195	30	5.8	221.02	3.4	408.86	6.0	566.60	9.0	1.6	5.0	89.2	3,666
	245期(2022年5月10日)	10,190	30	0.2	223.92	1.3	408.88	0.0	526.74	△7.0	0.3	3.9	89.5	3,696
	246期(2022年6月10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
	247期(2022年7月11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
第43作成期	248期(2022年8月10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
	249期(2022年9月12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
	250期(2022年10月11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
	251期(2022年11月10日)	10,743	30	0.3	236.99	△0.8	443.00	0.4	576.33	△0.1	-	6.9	87.0	4,105
	252期(2022年12月12日)	10,320	30	△3.7	231.82	△2.2	430.70	△2.8	551.80	△4.3	-	19.1	77.7	3,930
第44作成期	253期(2023年1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
	254期(2023年2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
	255期(2023年3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
	256期(2023年4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
	257期(2023年5月10日)	10,068	30	1.5	232.81	0.7	436.41	2.3	550.15	1.4	-	7.5	91.2	3,935

(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	%	(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 252 期	(期 首) 2022年11月10日	円	%		%		%		%	%	%	%
	2022年11月10日	10,743	-	236.99	-	443.00	-	576.33	-	-	6.9	87.0
	11月末	10,425	△3.0	231.76	△2.2	432.21	△2.4	563.17	△2.3	-	15.0	80.8
第 253 期	(期 末) 2022年12月12日	10,350	△3.7	231.82	△2.2	430.70	△2.8	551.80	△4.3	-	19.1	77.7
	2022年12月12日	10,320	-	231.82	-	430.70	-	551.80	-	-	19.1	77.7
	12月末	9,895	△4.1	221.98	△4.2	411.71	△4.4	528.62	△4.2	0.2	17.1	75.7
第 254 期	(期 末) 2023年1月10日	9,986	△3.2	224.84	△3.0	421.36	△2.2	532.18	△3.6	0.2	15.7	79.0
	2023年1月10日	9,956	-	224.84	-	421.36	-	532.18	-	0.2	15.7	79.0
	1月末	9,924	△0.3	223.73	△0.5	420.18	△0.3	544.80	2.4	-	15.1	80.4
第 255 期	(期 末) 2023年2月10日	10,009	0.5	224.34	△0.2	425.23	0.9	556.11	4.5	-	14.2	81.8
	2023年2月10日	9,979	-	224.34	-	425.23	-	556.11	-	-	14.2	81.8
	2月末	10,153	1.7	228.55	1.9	433.59	2.0	566.50	1.9	-	12.5	83.2
第 256 期	(期 末) 2023年3月10日	10,093	1.1	228.18	1.7	431.47	1.5	559.51	0.6	-	10.1	86.0
	2023年3月10日	10,063	-	228.18	-	431.47	-	559.51	-	-	10.1	86.0
	3月末	9,974	△0.9	228.98	0.4	426.02	△1.3	546.32	△2.4	-	8.1	87.1
第 257 期	(期 末) 2023年4月10日	9,981	△0.8	231.30	1.4	426.76	△1.1	542.43	△3.1	-	7.2	87.6
	2023年4月10日	9,951	-	231.30	-	426.76	-	542.43	-	-	7.2	87.6
	4月末	10,057	1.1	231.45	0.1	434.56	1.8	545.14	0.5	-	7.2	88.5
第 257 期	(期 末) 2023年5月10日	10,098	1.5	232.81	0.7	436.41	2.3	550.15	1.4	-	7.5	91.2

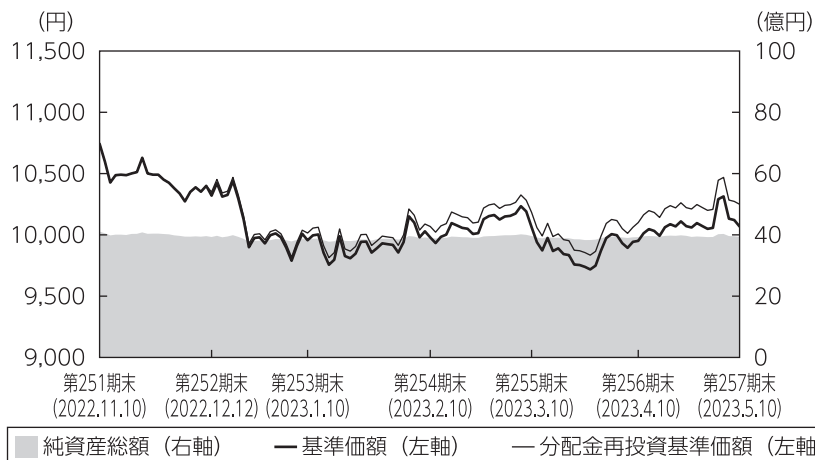
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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252期～第257期の運用経過（2022年11月11日から2023年5月10日まで）

基準価額等の推移



第252期首：10,743円
第257期末：10,068円
(既払分配金180円)
騰落率：△4.6%
(分配金再投資ベース)

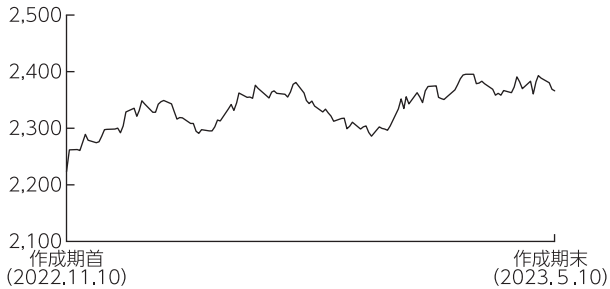
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

「L A U S 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、株式関連債、ハイイールド債、高格付け債の市場が上昇したものの、米ドルが対円で下落したことなどから、基準価額（税引前分配金再投資ベース）は下落しました。

投資環境

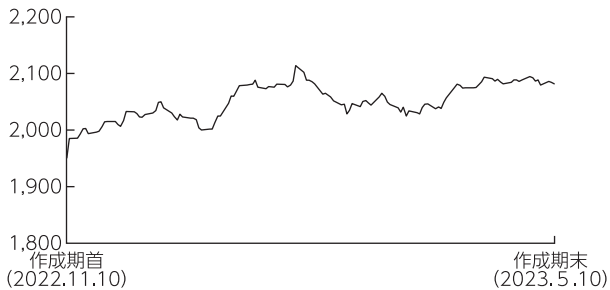
＜高格付け債指数（米ドルベース）の推移＞



＜高格付け債＞

米国高格付け債市場は、上昇しました。作成期初から2023年2月上旬にかけては、米物価指標の伸びが鈍化したことなどを背景に米利上げペース減速への期待が高まったことから上昇しました。その後は、堅調な米雇用統計などを受け、米金融引締め長期化観測が強まったことから下落する場面も見られましたが、3月には米金融システム不安の高まりなどを受けた金利低下の動きにつれ上昇しました。

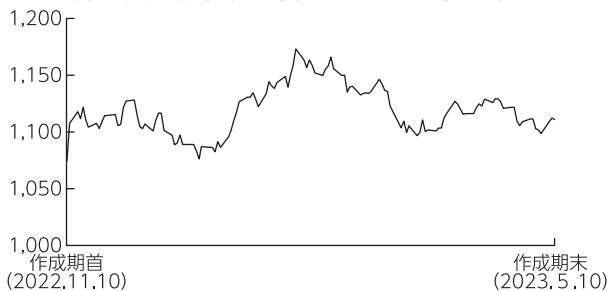
＜ハイイールド債指数（米ドルベース）の推移＞



＜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。作成期初から2023年2月上旬にかけては、米物価指標の伸びが鈍化したことなどを背景に米利上げペース減速への期待が高まったことから上昇しました。その後は、堅調な米雇用統計などを受け、米金融引締め長期化観測が強まったことや、米金融システム不安の高まりなどから下落する場面も見られましたが、作成期末にかけては一部値を戻しました。

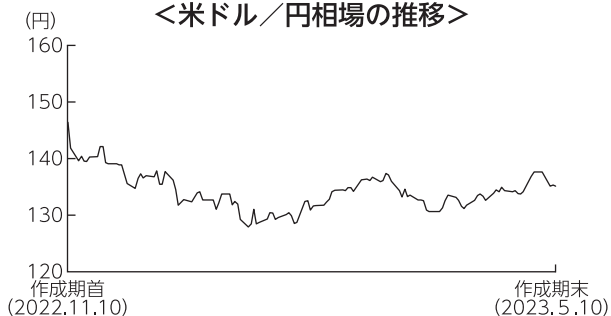
＜株式関連債指数（米ドルベース）の推移＞



＜株式関連債＞

米国株式関連債市場は、上昇しました。2023年1月にかけては米賃金上昇率の下振れなどを背景に米利上げペース減速への期待から上昇しました。その後は、米金融システム不安の高まりなどから下落する場面も見られましたが、作成期末にかけては、過度な警戒感が後退したことなどから反発しました。

<米ドル／円相場の推移>



<為替市場>

米ドルは対円で下落しました。作成期初から2023年1月中旬にかけては、米物価指標の伸びが鈍化したことや日銀が長期金利の許容変動幅の拡大を決定し、実質的な金融緩和縮小と受け止められたことから下落しました。しかしその後は、雇用統計をはじめ堅調な米経済指標の発表が続いたことや、日銀による金融政策の修正観測が後退したことなどから、下落幅を縮小しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

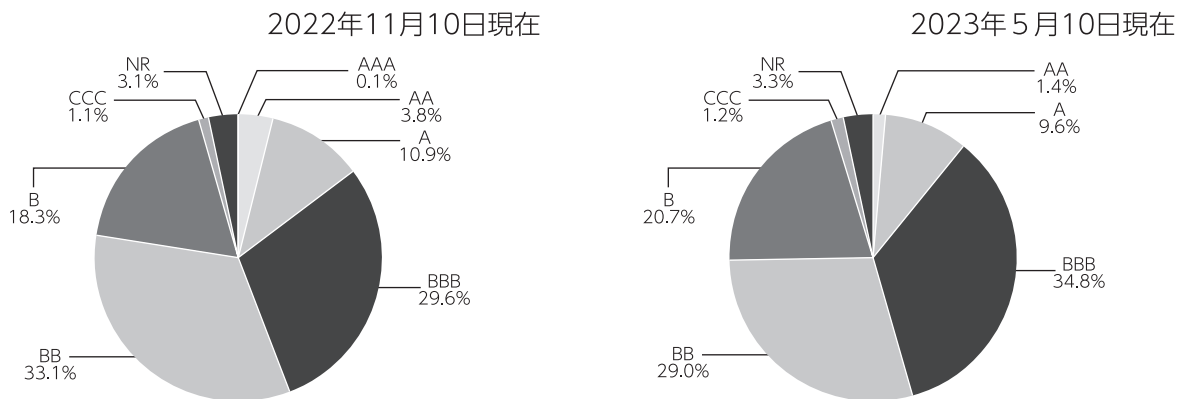
「L A USインカムマザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。また、組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行いませんでした。

●L A USインカムマザーファンド

資産・債券種類別では、ハイイールド債および高格付け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 B B格の比率を引き上げた一方、B B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、保有する債券が上昇したものの、米ドルが対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。

<公社債の格付け別構成>



(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	DPL INC 4.125 07/01/25	4.125	2025/07/01	BB	1.0
2	INSULET CORPORATION 0.375 09/01/26	0.375	2026/09/01	B	1.0
3	CENTRAL JAPAN RAILWAY CO 2.2 10/02/24	2.200	2024/10/02	A	0.9
4	HAT HOLDINGS I LLC/HAT 6.0 04/15/25	6.000	2025/04/15	BB	0.8
5	ORGANON & CO/ORG 4.125 04/30/28	4.125	2028/04/30	BB	0.8
6	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	4.000	2030/11/13	BB	0.8
7	PDC ENERGY INC 5.75 05/15/26	5.750	2026/05/15	BB	0.8
8	US T N/B 3.625 02/15/53	3.625	2053/02/15	AA	0.8
9	VISTRA OPERATIONS CO LLC 5.125 05/13/25	5.125	2025/05/13	BBB	0.7
10	FLUOR CORP 4.25 09/15/28	4.250	2028/09/15	BB	0.6

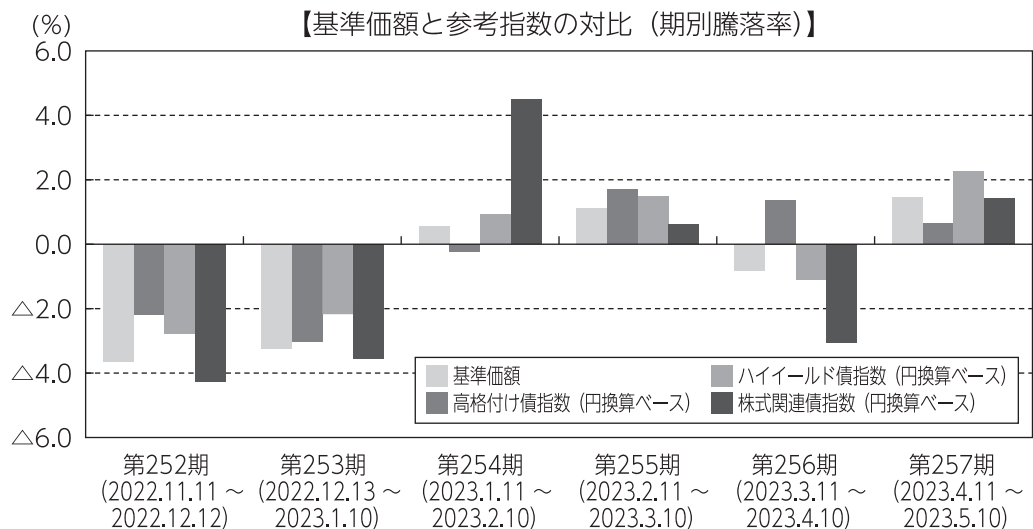
(注1) 比率は、マザーファンド純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

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252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
	2022年11月11日 ～2022年12月12日	2022年12月13日 ～2023年1月10日	2023年1月11日 ～2023年2月10日	2023年2月11日 ～2023年3月10日	2023年3月11日 ～2023年4月10日	2023年4月11日 ～2023年5月10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	0.29%	0.30%	0.30%	0.30%	0.30%	0.30%
当期の収益	20円	16円	26円	30円	24円	30円
当期の収益以外	9円	13円	3円	－円	5円	－円
翌期繰越分配対象額	2,533円	2,520円	2,517円	2,517円	2,512円	2,517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 U S 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 U S 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、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、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	第252期～第257期 (2022年11月11日 ～2023年5月10日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	91 円	
(投信会社)	(44)	(0.436)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(41)	(0.409)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(5)	(0.054)	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) 有価証券取引税	0	0.000	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.000)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用	4	0.039	(c) 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)	(4)	(0.036)	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)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	95	0.938	

(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、有価証券取引税およびその他費用は、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。

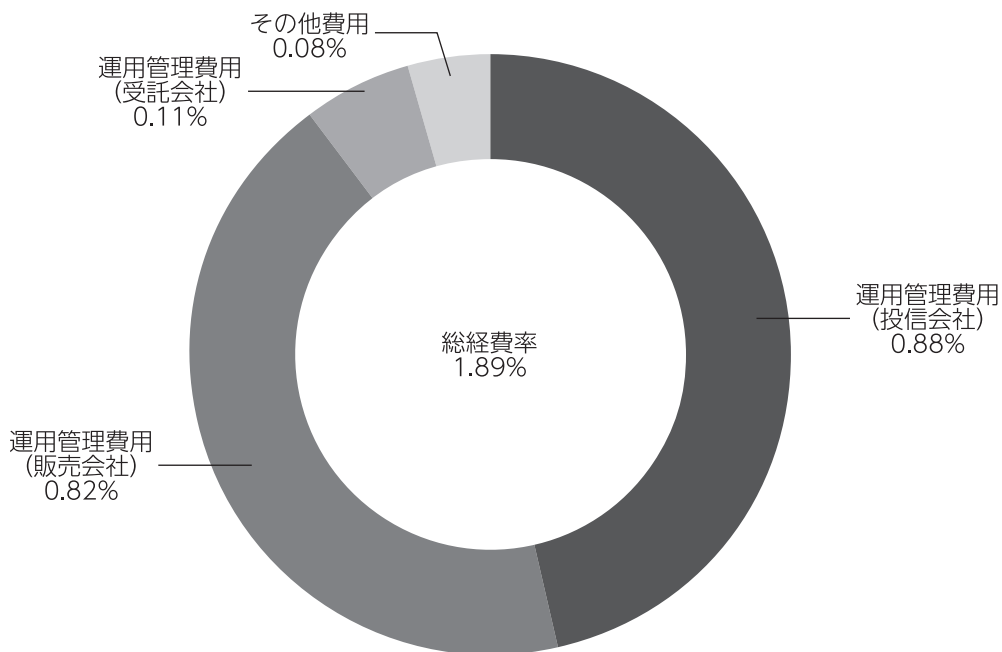
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2022年11月11日から2023年5月10日まで）

	第 252 期 ~ 第 257 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 5,158	千円 30,000	千口 -	千円 -

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 252 期 ~ 第 257 期
	L A U S インカムマザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	21,222千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	10,870千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	1.95

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年11月11日から2023年5月10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42作成期末		第43作成期末	
	□	数	□	数
L A U S インカムマザーファンド		千円 661,479		千円 666,638
				千円 3,924,233

<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 (1,026,856,755□) の内容です。

(1) 外国新株予約権付社債 (転換社債)

銘	柄	2023年5月10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
BENTLEY SYSTEMS INC 0.125 01/15/26		95	92	12,518
MARRIOTT VACATION WORLDW 01/15/26		185	176	23,852
WESTERN DIGITAL CORP 02/01/24		231	224	30,298
AIRBNB INC 03/15/26		100	88	11,954
PENN NATIONAL GAMING INC 2.75 05/15/26		77	100	13,570
NATERA INC 2.25 05/01/27		60	93	12,597
BOOKING HOLDINGS INC 0.75 05/01/25		118	175	23,682
HUBSPOT INC 0.375 06/01/25		145	238	32,168
PALO ALTO NETWORKS 0.375 06/01/25		85	168	22,803
FTI CONSULTING INC 2.0 08/15/23		65	114	15,417
MERCADOLIBRE INC 2.0 08/15/28		78	223	30,238
ZILLOW GROUP INC 0.75 09/01/24		91	110	14,973
INSULET CORPORATION 0.375 09/01/26		294	441	59,691
APELLIS PHARMACEUTICALS 3.5 09/15/26		50	117	15,869
KBR INC 2.5 11/01/23		77	178	24,127
DEXCOM INC 0.25 11/15/25		171	180	24,439
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 2.875 11/15/23		84	90	12,297
SAREPTA THERAPEUTICS INC 1.5 11/15/24		100	180	24,445
UBER TECHNOLOGIES INC 12/15/25		250	226	30,588
WORLD WRESTLING ENTERTAI 3.375 12/15/23		31	131	17,749
合 計	額 面 ・ 金 額	2,387	3,353	453,284
	銘 柄 数<比率>	20銘柄	-	<7.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年5月10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、2023年5月10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	2023年5月10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 43,476	千アメリカ・ドル 40,888	千円 5,526,038	% 91.4	% 38.5	% 40.4	% 42.0	% 9.0
合 計	-	-	千円 5,526,038	91.4	38.5	40.4	42.0	9.0

(注1) 邦貨換算金額は、2023年5月10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、2023年5月10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	2023年5月10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		
US T N/B 3.625 02/15/53	国 債 証 券	3.6250	350	336	45,428	2053/02/15	
PETROLEOS MEXICANOS 5.95 01/28/31	特 殊 債 券	5.9500	32	23	3,124	2031/01/28	
PETROLEOS MEXICANOS 5.35 02/12/28	特 殊 債 券	5.3500	56	45	6,195	2028/02/12	
CADILLAC FAIRVIEW PRP TR 3.875 03/20/27	特 殊 債 券	3.8750	200	188	25,484	2027/03/20	
CITGO PETROLEUM CORP 7.0 06/15/25	特 殊 債 券	7.0000	150	147	19,974	2025/06/15	
AMERICAN TOWER CORP 2.95 01/15/25	社 債 債 券	2.9500	183	176	23,850	2025/01/15	
UNITED RENTALS NORTH AM 4.875 01/15/28	社 債 債 券	4.8750	68	65	8,789	2028/01/15	
ASSURANT INC 2.65 01/15/32	社 債 債 券	2.6500	51	38	5,249	2032/01/15	
CENOVUS ENERGY INC 2.65 01/15/32	社 債 債 券	2.6500	50	40	5,518	2032/01/15	
SM ENERGY CO 6.625 01/15/27	社 債 債 券	6.6250	204	198	26,776	2027/01/15	
OHIO EDISON CO 5.5 01/15/33	社 債 債 券	5.5000	35	35	4,857	2033/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/31	社 債 債 券	4.0000	56	48	6,595	2031/01/15	
TERRAFORM POWER OPERATIN 4.75 01/15/30	社 債 債 券	4.7500	96	87	11,786	2030/01/15	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 6.15 01/15/33	社 債 債 券	6.1500	61	61	8,274	2033/01/15	
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社 債 債 券	4.3750	282	266	36,080	2028/01/15	
NRG ENERGY INC 5.75 01/15/28	社 債 債 券	5.7500	265	254	34,449	2028/01/15	
HILTON DOMESTIC OPERATIN 4.875 01/15/30	社 債 債 券	4.8750	179	169	22,936	2030/01/15	
APACHE CORP 4.25 01/15/30	社 債 債 券	4.2500	250	224	30,369	2030/01/15	
ALLISON TRANSMISSION INC 3.75 01/30/31	社 債 債 券	3.7500	56	47	6,442	2031/01/30	
BANK OF AMERICA CORP 4.0 01/22/25	社 債 債 券	4.0000	95	93	12,585	2025/01/22	
HOME BANCSHARES INC 01/30/32	社 債 債 券	3.1250	39	32	4,355	2030/01/30	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 3.25 01/31/32	社 債 債 券	3.2500	55	45	6,121	2032/01/31	
LAREDO PETROLEUM INC 10.125 01/15/28	社 債 債 券	10.1250	222	218	29,559	2028/01/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	社 債 債 券	6.1250	186	192	25,954	2031/01/01	
PIONEER NATURAL RESOURCE 2.15 01/15/31	社 債 債 券	2.1500	49	40	5,462	2031/01/15	
TRANSDIGM INC 4.625 01/15/29	社 債 債 券	4.6250	100	89	12,151	2029/01/15	
BNP PARIBAS 01/13/29	社 債 債 券	5.1250	200	200	27,122	2029/01/13	
DEUTSCHE BANK NY 01/18/29	社 債 債 券	6.7200	150	151	20,513	2029/01/18	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 9.25 01/15/29	社 債 債 券	9.2500	85	91	12,314	2029/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/30	社 債 債 券	4.0000	47	41	5,628	2030/01/15	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 7.25 01/15/30	社 債 債 券	7.2500	39	39	5,363	2030/01/15	
HAWAIIAN AIRLINES 13-1A 3.9 01/15/26	社 債 債 券	3.9000	203	183	24,805	2026/01/15	

銘柄		2023年5月10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	
AVIATION CAPITAL GROUP	1.95 01/30/26	社債	1.9500	25	22	3,019	2026/01/30
HAWAIIAN BRAND INTELLECT	5.75 01/20/26	社債	5.7500	50	47	6,423	2026/01/20
DELTA AIR LINES INC	7.375 01/15/26	社債	7.3750	150	157	21,293	2026/01/15
LIFE TIME INC	5.75 01/15/26	社債	5.7500	115	112	15,168	2026/01/15
ABC SUPPLY CO INC	4.0 01/15/28	社債	4.0000	50	45	6,162	2028/01/15
DANSKE BANK A/S	01/09/26	社債	6.4660	200	200	27,126	2026/01/09
DEUTSCHE BANK NY	02/10/34	社債	7.0790	200	181	24,556	2026/01/10
TOLL BROS FINANCE CORP	4.35 02/15/28	社債	4.3500	34	32	4,368	2028/02/15
CALPINE CORP	5.0 02/01/31	社債	5.0000	206	171	23,160	2031/02/01
HESS CORP	5.6 02/15/41	社債	5.6000	50	47	6,419	2041/02/15
OLIN CORP	5.0 02/01/30	社債	5.0000	51	47	6,377	2030/02/01
OVINTIV INC	6.5 02/01/38	社債	6.5000	79	78	10,543	2038/02/01
L BRANDS INC	5.25 02/01/28	社債	5.2500	41	38	5,267	2028/02/01
TENET HEALTHCARE CORP	6.25 02/01/27	社債	6.2500	107	105	14,323	2027/02/01
AMPHENOL CORP	2.8 02/15/30	社債	2.8000	102	90	12,197	2030/02/15
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4.6 02/23/28	社債	4.6000	59	58	7,882	2028/02/23
ASSURANT INC	3.7 02/22/30	社債	3.7000	48	41	5,657	2030/02/22
OCEANEERING INTL INC	6.0 02/01/28	社債	6.0000	82	78	10,545	2028/02/01
FORD MOTOR COMPANY	3.25 02/12/32	社債	3.2500	53	40	5,499	2032/02/12
PROLOGIS LP	4.375 02/01/29	社債	4.3750	50	49	6,659	2029/02/01
SYNCHRONY FINANCIAL	7.25 02/02/33	社債	7.2500	74	65	8,795	2033/02/02
MEG ENERGY CORP	7.125 02/01/27	社債	7.1250	135	137	18,568	2027/02/01
PATTERSON-UTI ENERGY INC	3.95 02/01/28	社債	3.9500	170	151	20,506	2028/02/01
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.05 02/01/30	社債	4.3000	140	126	17,132	2030/02/01
GENUINE PARTS CO	2.75 02/01/32	社債	2.7500	56	46	6,327	2032/02/01
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	3.0 02/15/29	社債	3.0000	256	223	30,259	2029/02/15
MEG ENERGY CORP	5.875 02/01/29	社債	5.8750	91	86	11,648	2029/02/01
NETFLIX INC	5.875 02/15/25	社債	5.8750	257	260	35,227	2025/02/15
ALLY FINANCIAL INC	6.7 02/14/33	社債	6.7000	92	81	10,960	2033/02/14
PTC INC	4.0 02/15/28	社債	4.0000	47	43	5,913	2028/02/15
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.875 02/15/27	社債	3.8750	94	88	11,921	2027/02/15
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER	5.875 02/01/29	社債	5.8750	106	100	13,608	2029/02/01
RAYTHEON TECH CORP	5.15 02/27/33	社債	5.1500	73	74	10,130	2033/02/27
HECLA MINING CO	7.25 02/15/28	社債	7.2500	131	130	17,636	2028/02/15
PTC INC	3.625 02/15/25	社債	3.6250	92	88	11,994	2025/02/15
SOUTHWESTERN ENERGY CO	5.375 02/01/29	社債	5.3750	39	36	4,936	2029/02/01
CENTENE CORP	3.375 02/15/30	社債	3.3750	163	142	19,253	2030/02/15
OTIS WORLDWIDE CORP	2.565 02/15/30	社債	2.5650	55	48	6,488	2030/02/15
CATALENT PHARMA SOLUTION	3.125 02/15/29	社債	3.1250	100	80	10,824	2029/02/15
GENTING NY LLC/GENNY CAP	3.3 02/15/26	社債	3.3000	200	181	24,480	2026/02/15
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER	5.5 02/01/26	社債	5.5000	91	89	12,084	2026/02/01
CDW LLC/CDW FINANCE	3.25 02/15/29	社債	3.2500	125	108	14,621	2029/02/15
NABORS INDUSTRIES INC	5.75 02/01/25	社債	5.7500	95	91	12,410	2025/02/01
BOMBARDIER INC	7.5 02/01/29	社債	7.5000	42	41	5,582	2029/02/01
NCL CORPORATION LTD	8.375 02/01/28	社債	8.3750	89	91	12,312	2028/02/01
CAESARS ENTERTAIN INC	7.0 02/15/30	社債	7.0000	62	62	8,462	2030/02/15
AMERICAN AIRLINES INC	7.25 02/15/28	社債	7.2500	34	33	4,463	2028/02/15
EXXON MOBIL CORPORATION	3.043 03/01/26	社債	3.0430	31	30	4,068	2026/03/01
TOLL BROS FINANCE CORP	4.875 03/15/27	社債	4.8750	85	83	11,264	2027/03/15
SELECTIVE INSURANCE GROU	5.375 03/01/49	社債	5.3750	75	69	9,442	2049/03/01

銘柄		2023年5月10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	
PENNSYLVANIA ELECTRIC CO	3.25 03/15/28	社債	3.2500	66	61	8,334	2028/03/15
ABN AMRO BANK NV	03/13/37	社債	3.3240	200	153	20,745	2037/03/13
SPRINT CORP	7.625 03/01/26	社債	7.6250	125	131	17,772	2026/03/01
NEUBERGER BERMAN GRP/FIN	4.5 03/15/27	社債	4.5000	100	96	12,974	2027/03/15
BROWN & BROWN INC	2.375 03/15/31	社債	2.3750	140	113	15,301	2031/03/15
GOODMAN US FIN THREE	3.7 03/15/28	社債	3.7000	38	35	4,767	2028/03/15
WEBSTER FINANCIAL CORP	4.1 03/25/29	社債	4.1000	96	86	11,631	2029/03/25
SPRINT CAPITAL CORP	8.75 03/15/32	社債	8.7500	50	60	8,221	2032/03/15
FACTSET RESEARCH SYSTEMS	3.45 03/01/32	社債	3.4500	280	243	32,867	2032/03/01
CALPINE CORP	3.75 03/01/31	社債	3.7500	152	127	17,294	2031/03/01
REPUBLIC SERVICES INC	2.375 03/15/33	社債	2.3750	55	45	6,136	2033/03/15
LEGGETT & PLATT INC	4.4 03/15/29	社債	4.4000	104	101	13,670	2029/03/15
LEVI STRAUSS & CO	3.5 03/01/31	社債	3.5000	71	59	8,047	2031/03/01
SOUTHWEST GAS CORP	4.05 03/15/32	社債	4.0500	46	41	5,636	2032/03/15
TRANSDIGM INC	6.25 03/15/26	社債	6.2500	134	133	18,098	2026/03/15
CIT GROUP INC	6.125 03/09/28	社債	6.1250	156	154	20,846	2028/03/09
EATON CORP	4.15 03/15/33	社債	4.1500	51	48	6,551	2033/03/15
MAGELLAN MIDSTREAM PARTN	3.95 03/01/50	社債	3.9500	103	76	10,331	2050/03/01
COMMERCIAL METALS CO	4.375 03/15/32	社債	4.3750	25	21	2,903	2032/03/15
JACOBS ENGINEERING GROUP	5.9 03/01/33	社債	5.9000	75	75	10,146	2033/03/01
CLEARWAY ENERGY OP LLC	4.75 03/15/28	社債	4.7500	136	128	17,325	2028/03/15
TRANE TECH FIN LTD	5.25 03/03/33	社債	5.2500	46	47	6,395	2033/03/03
AG ISSUER LLC	6.25 03/01/28	社債	6.2500	271	252	34,095	2028/03/01
CONSTELLATION EN GEN LLC	5.8 03/01/33	社債	5.8000	65	67	9,075	2033/03/01
TRIMBLE INC	6.1 03/15/33	社債	6.1000	65	66	8,924	2033/03/15
PEPSICO INC	3.6 03/01/24	社債	3.6000	98	96	13,097	2024/03/01
WILLIAMS COMPANIES INC	5.65 03/15/33	社債	5.6500	92	93	12,677	2033/03/15
UNITED STATES STEEL CORP	6.875 03/01/29	社債	6.8750	88	85	11,517	2029/03/01
FREEMPORT-MCMORAN INC	4.125 03/01/28	社債	4.1250	93	88	11,910	2028/03/01
ONEMAIN FINANCE CORP	7.125 03/15/26	社債	7.1250	175	168	22,739	2026/03/15
HILLENBRAND INC	3.75 03/01/31	社債	3.7500	52	43	5,944	2031/03/01
OCI NV	6.7 03/16/33	社債	6.7000	200	194	26,273	2033/03/16
COMSTOCK RESOURCES INC	6.75 03/01/29	社債	6.7500	86	76	10,304	2029/03/01
GRIFFON CORPORATION	5.75 03/01/28	社債	5.7500	50	46	6,273	2028/03/01
GENERAL MILLS INC	4.95 03/29/33	社債	4.9500	55	55	7,487	2033/03/29
FORTINET INC	2.2 03/15/31	社債	2.2000	46	37	5,097	2031/03/15
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	4.5 03/01/28	社債	4.5000	100	91	12,374	2028/03/01
ANTERO RESOURCES CORP	5.375 03/01/30	社債	5.3750	67	61	8,377	2030/03/01
SOUTHWESTERN ENERGY CO	5.375 03/15/30	社債	5.3750	70	64	8,739	2030/03/15
CARNIVAL CORP	5.75 03/01/27	社債	5.7500	50	42	5,746	2027/03/01
CHARLES RIVER LABORATORI	3.75 03/15/29	社債	3.7500	120	105	14,233	2029/03/15
NAVIENT CORP	4.875 03/15/28	社債	4.8750	116	96	13,080	2028/03/15
BELLRING BRANDS INC	7.0 03/15/30	社債	7.0000	45	46	6,231	2030/03/15
PEPSICO INC	2.25 03/19/25	社債	2.2500	110	105	14,324	2025/03/19
AMGEN INC	5.25 03/02/30	社債	5.2500	37	37	5,107	2030/03/02
NAVIENT CORP	5.5 03/15/29	社債	5.5000	58	47	6,418	2029/03/15
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	5.5 03/01/25	社債	5.5000	170	167	22,578	2025/03/01
POST HOLDINGS INC	5.75 03/01/27	社債	5.7500	155	153	20,697	2027/03/01
CLOUD SOFTWARE GRP HOLDG	6.5 03/31/29	社債	6.5000	75	66	8,990	2029/03/31
LLOYDS BANKING GROUP PLC	03/06/29	社債	5.8710	200	203	27,502	2029/03/06

銘柄		2023年5月10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	61	8,246	2028/03/15
FACTSET RESEARCH SYSTEMS 2.9 03/01/27	社債	債券	2.9000	45	42	5,689	2027/03/01
LPL HOLDINGS INC 4.0 03/15/29	社債	債券	4.0000	50	44	5,995	2029/03/15
CENTERPOINT ENERGY RES 5.25 03/01/28	社債	債券	5.2500	157	161	21,841	2028/03/01
NATWEST GROUP PLC 03/02/27	社債	債券	5.8470	200	201	27,212	2027/03/02
TRIUMPH GROUP INC 9.0 03/15/28	社債	債券	9.0000	44	43	5,939	2028/03/15
NORINCHUKIN BANK 5.43 03/09/28	社債	債券	5.4300	200	206	27,924	2028/03/09
ARROW ELECTRONICS INC 6.125 03/01/26	社債	債券	6.1250	36	35	4,861	2026/03/01
VULCAN MATERIALS CO 5.8 03/01/26	社債	債券	5.8000	54	54	7,333	2026/03/01
WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.412 03/15/26	社債	債券	6.4120	34	34	4,612	2026/03/15
TRANSCANADA PIPELINES 03/09/26	社債	債券	6.1460	192	192	25,962	2026/03/09
NEXTERA ENERGY CAPITAL 6.051 03/01/25	社債	債券	6.0510	43	43	5,912	2025/03/01
PIONEER NATURAL RESOURCE 5.1 03/29/26	社債	債券	5.1000	22	22	2,999	2026/03/29
MERCEDES-BENZ FIN NA 4.8 03/30/28	社債	債券	4.8000	150	151	20,457	2028/03/30
HSBC USA INC 5.625 03/17/25	社債	債券	5.6250	200	200	27,159	2025/03/17
WYNDHAM WORLDWIDE 04/01/27	社債	債券	6.0000	66	64	8,705	2027/04/01
REGAL REXNORD CORP 6.4 04/15/33	社債	債券	6.4000	65	65	8,839	2033/04/15
WORKDAY INC 3.8 04/01/32	社債	債券	3.8000	147	132	17,905	2032/04/01
MCCORMICK & CO 4.95 04/15/33	社債	債券	4.9500	51	50	6,797	2033/04/15
FMG RESOURCES AUG 2006 6.125 04/15/32	社債	債券	6.1250	107	103	13,941	2032/04/15
DT MIDSTREAM INC 4.3 04/15/32	社債	債券	4.3000	47	42	5,677	2032/04/15
CHOBANI LLC/FINANCE CORP 7.5 04/15/25	社債	債券	7.5000	47	46	6,263	2025/04/15
NETFLIX INC 4.875 04/15/28	社債	債券	4.8750	168	167	22,666	2028/04/15
STEEL DYNAMICS INC 3.45 04/15/30	社債	債券	3.4500	49	44	5,967	2030/04/15
FMG RESOURCES AUG 2006 4.375 04/01/31	社債	債券	4.3750	100	86	11,639	2031/04/01
VITERRA FINANCE BV 3.2 04/21/31	社債	債券	3.2000	200	158	21,362	2031/04/21
AMERICAN AIRLINES/AADVAN 5.75 04/20/29	社債	債券	5.7500	175	166	22,555	2029/04/20
MARS INC 4.65 04/20/31	社債	債券	4.6500	22	21	2,969	2031/04/20
T-MOBILE USA INC 3.375 04/15/29	社債	債券	3.3750	140	127	17,258	2029/04/15
BMW US CAPITAL LLC 4.15 04/09/30	社債	債券	4.1500	97	94	12,786	2030/04/09
MCCORMICK & CO 2.5 04/15/30	社債	債券	2.5000	75	64	8,669	2030/04/15
HUNT COS INC 5.25 04/15/29	社債	債券	5.2500	117	90	12,204	2029/04/15
ORGANON & CO/ORG 4.125 04/30/28	社債	債券	4.1250	400	363	49,149	2028/04/30
MGM RESORTS INTL 5.5 04/15/27	社債	債券	5.5000	150	145	19,626	2027/04/15
CAMPBELL SOUP CO 2.375 04/24/30	社債	債券	2.3750	64	54	7,412	2030/04/24
UNITED AIRLINES INC 4.625 04/15/29	社債	債券	4.6250	28	25	3,396	2029/04/15
ALLIANT HOLD / CO-ISSUER 6.75 04/15/28	社債	債券	6.7500	80	79	10,696	2028/04/15
SYSTEM ENERGY RESOURCES 6.0 04/15/28	社債	債券	6.0000	105	108	14,621	2028/04/15
MOZART DEBT MERGER SUB 3.875 04/01/29	社債	債券	3.8750	125	108	14,633	2029/04/01
VITERRA FINANCE BV 2.0 04/21/26	社債	債券	2.0000	200	178	24,187	2026/04/21
MATADOR RESOURCES CO 6.875 04/15/28	社債	債券	6.8750	26	25	3,481	2028/04/15
ENTEGRIS ESCROW CORP 4.75 04/15/29	社債	債券	4.7500	97	90	12,171	2029/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.375 04/15/26	社債	債券	4.3750	70	66	8,976	2026/04/15
ZF NA CAPITAL 6.875 04/14/28	社債	債券	6.8750	150	153	20,777	2028/04/14
MARS INC 4.55 04/20/28	社債	債券	4.5500	46	46	6,272	2028/04/20
HAT HOLDINGS I LLC/HAT 6.0 04/15/25	社債	債券	6.0000	380	365	49,456	2025/04/15
WEATHERFORD INTERNATIONAL 8.625 04/30/30	社債	債券	8.6250	104	104	14,175	2030/04/30
CSC HOLDINGS LLC 5.5 04/15/27	社債	債券	5.5000	200	169	22,955	2027/04/15
WALMART INC 4.0 04/15/30	社債	債券	4.0000	55	54	7,345	2030/04/15
BAYTEX ENERGY CORP 8.5 04/30/30	社債	債券	8.5000	35	34	4,711	2030/04/30

銘柄		2023年5月10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	
GENERAL MOTORS FINL CO 5.4 04/06/26	社債	債券	5.4000	27	26	3,647	2026/04/06
RAYONIER LP 2.75 05/17/31	社債	債券	2.7500	100	82	11,122	2031/05/17
TENET HEALTHCARE CORP 6.75 05/15/31	社債	債券	6.7500	52	52	7,047	2031/05/15
PULTE GROUP INC 6.375 05/15/33	社債	債券	6.3750	48	50	6,812	2033/05/15
MONONGAHELA POWER CO 3.55 05/15/27	社債	債券	3.5500	48	45	6,192	2027/05/15
SABAL TRAIL TRANS 4.246 05/01/28	社債	債券	4.2460	85	81	11,052	2028/05/01
ASHTAD CAPITAL INC 5.55 05/30/33	社債	債券	5.5500	200	195	26,485	2033/05/30
AMERIPRISE FINANCIAL INC 5.15 05/15/33	社債	債券	5.1500	45	45	6,089	2033/05/15
DOLLAR TREE INC 4.2 05/15/28	社債	債券	4.2000	90	87	11,860	2028/05/15
NVENT FINANCE SARL 5.65 05/15/33	社債	債券	5.6500	74	73	9,982	2033/05/15
HERSHEY COMPANY 4.5 05/04/33	社債	債券	4.5000	45	45	6,101	2033/05/04
JETBLUE 2019-1 CLASS A 2.95 05/15/28	社債	債券	2.9500	34	29	3,992	2028/05/15
SCIENTIFIC GAMES INTERNA 7.0 05/15/28	社債	債券	7.0000	15	14	2,019	2028/05/15
GOODMAN US FIN FIVE LLC 4.625 05/04/32	社債	債券	4.6250	40	37	5,045	2032/05/04
NEWS CORP 3.875 05/15/29	社債	債券	3.8750	64	56	7,613	2029/05/15
MIDWEST GAMING BORROWER 4.875 05/01/29	社債	債券	4.8750	119	105	14,303	2029/05/01
RANGE RESOURCES CORP 4.875 05/15/25	社債	債券	4.8750	191	187	25,379	2025/05/15
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.0 05/01/28	社債	債券	5.0000	66	56	7,629	2028/05/01
GLOBAL PAYMENTS INC 2.9 05/15/30	社債	債券	2.9000	41	34	4,699	2030/05/15
PDC ENERGY INC 5.75 05/15/26	社債	債券	5.7500	350	338	45,733	2026/05/15
APPLE INC 3.2 05/11/27	社債	債券	3.2000	196	190	25,782	2027/05/11
KRAFT HEINZ FOODS CO 3.875 05/15/27	社債	債券	3.8750	265	259	35,005	2027/05/15
AMER AIRLN 15-1 A PTT 3.375 05/01/27	社債	債券	3.3750	60	51	7,015	2027/05/01
JPMORGAN CHASE & CO 05/01/28	社債	債券	3.5400	110	104	14,072	2028/05/01
SCIH SALT HOLDINGS INC 6.625 05/01/29	社債	債券	6.6250	50	41	5,669	2029/05/01
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/27	社債	債券	5.1250	180	170	22,996	2027/05/01
CARNIVAL HLDGS BM LTD 10.375 05/01/28	社債	債券	10.3750	40	43	5,836	2028/05/01
BOEING CO 5.04 05/01/27	社債	債券	5.0400	90	90	12,195	2027/05/01
TEVA PHARMACEUTICALS NE 5.125 05/09/29	社債	債券	5.1250	200	183	24,768	2029/05/09
SCIH SALT HOLDINGS INC 4.875 05/01/28	社債	債券	4.8750	100	89	12,076	2028/05/01
VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.5 05/15/29	社債	債券	5.5000	200	182	24,661	2029/05/15
CLARIOS GLOBAL LP/US FIN 6.75 05/15/28	社債	債券	6.7500	57	57	7,724	2028/05/15
DELTA AIR LINES INC 7.0 05/01/25	社債	債券	7.0000	135	139	18,820	2025/05/01
HUNTINGTON INGALLS INDUS 4.2 05/01/30	社債	債券	4.2000	139	129	17,503	2030/05/01
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.5 05/15/30	社債	債券	4.5000	92	87	11,875	2030/05/15
ROBLOX CORP 3.875 05/01/30	社債	債券	3.8750	146	122	16,548	2030/05/01
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.875 05/10/26	社債	債券	2.8750	35	33	4,565	2026/05/10
MINERAL RESOURCES LTD 8.5 05/01/30	社債	債券	8.5000	75	75	10,222	2030/05/01
CRESCENT ENERGY FINANCE 7.25 05/01/26	社債	債券	7.2500	115	106	14,434	2026/05/01
AMERICAN EXPRESS CO 05/01/26	社債	債券	4.9900	157	156	21,150	2026/05/01
VISTRA OPERATIONS CO LLC 5.125 05/13/25	社債	債券	5.1250	300	293	39,723	2025/05/13
CENOVUS ENERGY INC 5.4 06/15/47	社債	債券	5.4000	108	96	13,097	2047/06/15
DTE ENERGY COMPANY 3.4 06/15/29	社債	債券	3.4000	100	91	12,415	2029/06/15
BRITISH AIR 19-1 A PTT 3.35 06/15/29	社債	債券	3.3500	34	30	4,163	2029/06/15
XILINX INC 2.95 06/01/24	社債	債券	2.9500	238	232	31,469	2024/06/01
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75 06/01/28	社債	債券	5.7500	102	100	13,542	2028/06/01
ROCHESTER GAS & ELECTRIC 3.1 06/01/27	社債	債券	3.1000	217	204	27,680	2027/06/01
VULCAN MATERIALS CO 4.5 06/15/47	社債	債券	4.5000	49	42	5,693	2047/06/15
HCA INC 5.5 06/01/33	社債	債券	5.5000	46	45	6,206	2033/06/01
EDWARDS LIFESCIENCES COR 4.3 06/15/28	社債	債券	4.3000	89	89	12,029	2028/06/15

銘柄		2023年5月10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	
KAISER ALUMINUM CORP	4.5 06/01/31	社債	4.5000	62	49	6,694	2031/06/01
AUTODESK INC	3.5 06/15/27	社債	3.5000	118	114	15,436	2027/06/15
HCA INC	7.69 06/15/25	社債	7.6900	96	100	13,537	2025/06/15
VERISIGN INC	2.7 06/15/31	社債	2.7000	53	44	6,039	2031/06/15
CABOT CORP	5.0 06/30/32	社債	5.0000	60	58	7,871	2032/06/30
SM ENERGY CO	5.625 06/01/25	社債	5.6250	65	63	8,546	2025/06/01
WESTERN ALLIANCE BANCORP	06/15/31	社債	3.0000	47	29	3,922	2031/06/15
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3.0 06/01/31	社債	3.0000	23	18	2,534	2031/06/01
MILEAGE PLUS HLDINGS LLC	6.5 06/20/27	社債	6.5000	115	115	15,643	2027/06/20
MADISON IAQ LLC	4.125 06/30/28	社債	4.1250	96	83	11,290	2028/06/30
PUGET ENERGY INC	4.1 06/15/30	社債	4.1000	78	72	9,745	2030/06/15
ALBEMARLE CORP	4.65 06/01/27	社債	4.6500	88	86	11,734	2027/06/01
BOMBARDIER INC	7.125 06/15/26	社債	7.1250	90	89	12,111	2026/06/15
TENET HEALTHCARE CORP	4.25 06/01/29	社債	4.2500	48	43	5,853	2029/06/01
VISTAJET MALTA/VM HOLDS	9.5 06/01/28	社債	9.5000	58	56	7,574	2028/06/01
CALLON PETROLEUM CO	7.5 06/15/30	社債	7.5000	56	53	7,179	2030/06/15
CALPINE CORP	5.25 06/01/26	社債	5.2500	130	126	17,037	2026/06/01
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	8.625 06/01/30	社債	8.6250	51	51	7,005	2030/06/01
PACIFIC GAS & ELECTRIC	4.95 06/08/25	社債	4.9500	210	208	28,122	2025/06/08
MORGAN STANLEY	3.125 07/27/26	社債	3.1250	90	85	11,551	2026/07/27
VERISIGN INC	4.75 07/15/27	社債	4.7500	82	80	10,929	2027/07/15
FIRSTENERGY CORP	3.9 07/15/27	社債	4.1500	90	87	11,781	2027/07/15
TENET HEALTHCARE CORP	4.625 07/15/24	社債	4.6250	125	124	16,884	2024/07/15
NGPL PIPECO LLC	3.25 07/15/31	社債	3.2500	75	63	8,552	2031/07/15
PG&E CORP	5.25 07/01/30	社債	5.2500	47	43	5,861	2030/07/01
BAFFINLAND IRON CORP/LP	8.75 07/15/26	社債	8.7500	46	44	5,992	2026/07/15
PARTNERRE FINANCE B LLC	3.7 07/02/29	社債	3.7000	93	86	11,716	2029/07/02
NEXSTAR ESCROW INC	5.625 07/15/27	社債	5.6250	46	42	5,781	2027/07/15
COSTAR GROUP INC	2.8 07/15/30	社債	2.8000	28	23	3,135	2030/07/15
VALE OVERSEAS LIMITED	3.75 07/08/30	社債	3.7500	47	41	5,640	2030/07/08
US BANCORP	3.0 07/30/29	社債	3.0000	30	25	3,473	2029/07/30
GXO LOGISTICS INC	2.65 07/15/31	社債	2.6500	31	23	3,235	2031/07/15
VERTICAL HOLDCO GMBH	7.625 07/15/28	社債	7.6250	200	176	23,856	2028/07/15
PG&E CORP	5.0 07/01/28	社債	5.0000	59	55	7,473	2028/07/01
MURPHY OIL CORP	6.375 07/15/28	社債	6.3750	47	46	6,271	2028/07/15
TECK RESOURCES LIMITED	3.9 07/15/30	社債	3.9000	102	94	12,732	2030/07/15
BACARDI LTD	2.75 07/15/26	社債	2.7500	300	279	37,814	2026/07/15
INTUIT INC	0.95 07/15/25	社債	0.9500	273	253	34,220	2025/07/15
CALLON PETROLEUM CO	6.375 07/01/26	社債	6.3750	111	106	14,356	2026/07/01
CELANESE US HOLDINGS LLC	6.165 07/15/27	社債	6.1650	128	128	17,409	2027/07/15
NTT	4.372 07/27/27	社債	4.3720	200	200	27,114	2027/07/27
IMPERIAL BRANDS FIN PLC	6.125 07/27/27	社債	6.1250	200	206	27,851	2027/07/27
DPL INC	4.125 07/01/25	社債	4.1250	490	468	63,304	2025/07/01
CELANESE US HOLDINGS LLC	5.9 07/05/24	社債	5.9000	85	85	11,501	2024/07/05
AUSGRID FINANCE PTY LTD	4.35 08/01/28	社債	4.3500	58	55	7,553	2028/08/01
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	5.25 08/01/26	社債	5.2500	92	87	11,794	2026/08/01
MSCI INC	3.25 08/15/33	社債	3.2500	22	17	2,384	2033/08/15
MURPHY OIL CORP	5.75 08/15/25	社債	5.7500	12	11	1,602	2025/08/15
ASHTREAD CAPITAL INC	5.5 08/11/32	社債	5.5000	200	194	26,300	2032/08/11
FORD MOTOR COMPANY	6.1 08/19/32	社債	6.1000	43	40	5,538	2032/08/19

銘柄		2023年5月10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	
PATTERN ENERGY OP LP/PAT 4.5 08/15/28	社債	債券	4.5000	187	172	23,247	2028/08/15
FLIR SYSTEMS INC 2.5 08/01/30	社債	債券	2.5000	51	42	5,777	2030/08/01
NGPL PIPECO LLC 4.875 08/15/27	社債	債券	4.8750	122	118	16,001	2027/08/15
BALL CORP 2.875 08/15/30	社債	債券	2.8750	55	46	6,235	2030/08/15
LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35 08/01/25	社債	債券	1.3500	41	37	5,078	2025/08/01
ALASKA AIRLINES 2020 TR 4.8 08/15/27	社債	債券	4.8000	41	39	5,361	2027/08/15
LAS VEGAS SANDS CORP 3.5 08/18/26	社債	債券	3.5000	190	176	23,914	2026/08/18
CALLON PETROLEUM 8.0 08/01/28	社債	債券	8.0000	70	69	9,381	2028/08/01
CARNIVAL CORP 4.0 08/01/28	社債	債券	4.0000	75	65	8,876	2028/08/01
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 3.875 08/15/29	社債	債券	3.8750	47	42	5,694	2029/08/15
AIR CANADA 3.875 08/15/26	社債	債券	3.8750	94	87	11,770	2026/08/15
CARNIVAL CORP 9.875 08/01/27	社債	債券	9.8750	85	87	11,855	2027/08/01
PRIME SECSRVC BRW/FINANC 3.375 08/31/27	社債	債券	3.3750	50	44	5,964	2027/08/31
BERKLEY (WVR) CORPORATION 3.15 09/30/61	社債	債券	3.1500	38	23	3,162	2061/09/30
LEAR CORP 3.8 09/15/27	社債	債券	3.8000	41	38	5,248	2027/09/15
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.2 09/15/28	社債	債券	4.2000	44	43	5,902	2028/09/15
BRITISH AIR 18-1 A PTT 4.125 09/20/31	社債	債券	4.1250	27	24	3,281	2031/09/20
OLIN CORP 5.125 09/15/27	社債	債券	5.1250	47	45	6,099	2027/09/15
BRITISH AIR 18-1 AA PTT 3.8 09/20/31	社債	債券	3.8000	125	115	15,601	2031/09/20
FLUOR CORP 4.25 09/15/28	社債	債券	4.2500	309	282	38,203	2028/09/15
HCA INC 3.5 09/01/30	社債	債券	3.5000	85	75	10,210	2030/09/01
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.625 09/01/30	社債	債券	6.6250	36	37	5,114	2030/09/01
ONEOK INC 4.45 09/01/49	社債	債券	4.4500	75	56	7,626	2049/09/01
MURPHY OIL USA INC 4.75 09/15/29	社債	債券	4.7500	164	151	20,528	2029/09/15
SM ENERGY CO 6.75 09/15/26	社債	債券	6.7500	42	40	5,528	2026/09/15
HELMERICH & PAYNE INC 2.9 09/29/31	社債	債券	2.9000	100	82	11,108	2031/09/29
GLENCORE FUNDING LLC 2.5 09/01/30	社債	債券	2.5000	90	74	10,043	2030/09/01
USA COM PART/USA COM FIN 6.875 09/01/27	社債	債券	6.8750	115	110	14,918	2027/09/01
MATADOR RESOURCES CO 5.875 09/15/26	社債	債券	5.8750	287	277	37,545	2026/09/15
BANK OF IRELAND GROUP 09/30/27	社債	債券	2.0290	200	174	23,640	2027/09/30
ENEL FINANCE INTL NV 2.65 09/10/24	社債	債券	2.6500	200	193	26,115	2024/09/10
ON SEMICONDUCTOR CORP 3.875 09/01/28	社債	債券	3.8750	145	131	17,836	2028/09/01
NORTONLIFELOCK INC 6.75 09/30/27	社債	債券	6.7500	88	88	11,904	2027/09/30
ITC HOLDINGS CORP 4.95 09/22/27	社債	債券	4.9500	17	17	2,324	2027/09/22
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 6.375 09/01/29	社債	債券	6.3750	57	54	7,320	2029/09/01
VICI PROPERTIES / NOTE 4.5 09/01/26	社債	債券	4.5000	100	94	12,822	2026/09/01
BANK OF IRELAND GROUP 09/16/26	社債	債券	6.2530	200	199	26,997	2026/09/16
CLOUD SOFTWARE GRP INC 9.0 09/30/29	社債	債券	9.0000	85	72	9,733	2029/09/30
MIRABELA NICKEL 144-A 1%	社債	債券	0.0000	1	0.00012	0.016	2044/09/10
MARRIOTT INTERNATIONAL 3.5 10/15/32	社債	債券	3.5000	50	43	5,855	2032/10/15
BANK OZK 10/01/31	社債	債券	2.7500	100	74	10,074	2031/10/01
BAT CAPITAL CORP 7.75 10/19/32	社債	債券	7.7500	41	45	6,109	2032/10/19
GOODMAN US FIN FOUR 4.5 10/15/37	社債	債券	4.5000	43	36	4,976	2037/10/15
TIFFANY & CO 4.9 10/01/44	社債	債券	4.9000	75	69	9,377	2044/10/01
CONSTELLATION EN GEN LLC 6.25 10/01/39	社債	債券	6.2500	120	125	16,975	2039/10/01
AIB GROUP PLC 4.75 10/12/23	社債	債券	4.7500	200	198	26,868	2023/10/12
NEWMONT CORP 2.25 10/01/30	社債	債券	2.2500	93	77	10,524	2030/10/01
FMC CORP 3.45 10/01/29	社債	債券	3.4500	44	40	5,451	2029/10/01
TENET HEALTHCARE CORP 6.125 10/01/28	社債	債券	6.1250	195	186	25,170	2028/10/01
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 7.5 10/15/27	社債	債券	7.5000	90	88	11,954	2027/10/15

銘柄		2023年5月10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	
DELTA AIR LINES/SKYMILES	4.75 10/20/28	社債	4.7500	45	43	5,914	2028/10/20
NEXTERA ENERGY OPERATING	3.875 10/15/26	社債	3.8750	204	189	25,566	2026/10/15
CONNECT FINCO SARL/CONNÉ	6.75 10/01/26	社債	6.7500	91	86	11,700	2026/10/01
QORVO INC	4.375 10/15/29	社債	4.3750	99	89	12,111	2029/10/15
MOHEGAN GAMING & ENT	7.875 10/15/24	社債	7.8750	55	54	7,394	2024/10/15
GAP INC/THE	3.625 10/01/29	社債	3.6250	60	40	5,506	2029/10/01
FRONTIER COMMUNICATIONS	5.875 10/15/27	社債	5.8750	68	61	8,275	2027/10/15
ROLLER BEARING CO OF AME	4.375 10/15/29	社債	4.3750	94	83	11,349	2029/10/15
SUNTORY HOLDINGS LTD	2.25 10/16/24	社債	2.2500	200	191	25,855	2024/10/16
UNITED AIR 2020-1 A PTT	5.875 10/15/27	社債	5.8750	143	142	19,196	2027/10/15
AMER AIRLINE 16-3 AA PTT	3.0 10/15/28	社債	3.0000	24	21	2,938	2028/10/15
EVERARC ESCROW SARL	5.0 10/30/29	社債	5.0000	52	44	5,981	2029/10/30
DELTA AIR LINES/SKYMILES	4.5 10/20/25	社債	4.5000	54	54	7,305	2025/10/20
EDP FINANCE BV	6.3 10/11/27	社債	6.3000	200	210	28,398	2027/10/11
CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	2.2 10/02/24	社債	2.2000	400	385	52,105	2024/10/02
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	4.625 10/15/27	社債	4.6250	150	143	19,362	2027/10/15
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10/21/27	社債	1.9480	23	20	2,780	2027/10/21
HP ENTERPRISE CO	5.9 10/01/24	社債	5.9000	39	39	5,333	2024/10/01
CARGILL INC	4.875 10/10/25	社債	4.8750	53	53	7,224	2025/10/10
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	4.125 11/16/28	社債	4.1250	184	180	24,422	2028/11/16
FREEMPORT-MCMORAN INC	5.4 11/14/34	社債	5.4000	91	88	11,911	2034/11/14
NETFLIX INC	5.875 11/15/28	社債	5.8750	109	113	15,372	2028/11/15
BRITISH AIR 20-1 A PPT	4.25 11/15/32	社債	4.2500	67	62	8,409	2032/11/15
SUNCOR ENERGY INC	4.0 11/15/47	社債	4.0000	95	72	9,838	2047/11/15
WABTEC CORP	3.45 11/15/26	社債	3.4500	169	161	21,783	2026/11/15
NETFLIX INC	5.375 11/15/29	社債	5.3750	91	92	12,510	2029/11/15
OVINTIV INC	5.15 11/15/41	社債	5.1500	23	19	2,684	2041/11/15
MSCI INC	3.625 11/01/31	社債	3.6250	195	164	22,164	2031/11/01
BANK OF IRELAND GROUP	4.5 11/25/23	社債	4.5000	200	197	26,735	2023/11/25
SPRINT CAPITAL CORP	6.875 11/15/28	社債	6.8750	192	206	27,944	2028/11/15
OCEANEERING INTL INC	4.65 11/15/24	社債	4.6500	94	91	12,391	2024/11/15
CABLE ONE INC	4.0 11/15/30	社債	4.0000	25	20	2,744	2030/11/15
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	7.25 11/15/29	社債	7.2500	27	27	3,654	2029/11/15
MOLINA HEALTHCARE INC	3.875 11/15/30	社債	3.8750	155	135	18,364	2030/11/15
BANKUNITED INC	4.875 11/17/25	社債	4.8750	120	101	13,686	2025/11/17
INGEVITY CORP	3.875 11/01/28	社債	3.8750	101	85	11,603	2028/11/01
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	4.0 11/13/30	社債	4.0000	400	338	45,752	2030/11/13
NVENT FINANCE SARL	2.75 11/15/31	社債	2.7500	42	34	4,637	2031/11/15
TRANSDIGM INC	5.5 11/15/27	社債	5.5000	260	247	33,417	2027/11/15
SVB FINANCIAL GROUP	11/15/26	社債	0.0000	155	9	1,289	2026/11/15
ABBVIE INC	3.2 11/21/29	社債	3.2000	80	73	9,944	2029/11/21
JETBLUE 2019-1 CLASS B	8.0 11/15/27	社債	8.0000	13	13	1,863	2027/11/15
NOVELIS CORP	3.25 11/15/26	社債	3.2500	95	86	11,674	2026/11/15
NEXSTAR MEDIA INC	4.75 11/01/28	社債	4.7500	50	43	5,834	2028/11/01
NATWEST GROUP PLC	11/10/26	社債	7.4720	200	208	28,181	2026/11/10
SMYRNA READY MIX CONCRET	6.0 11/01/28	社債	6.0000	95	88	11,935	2028/11/01
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	7.35 11/04/27	社債	7.3500	200	204	27,658	2027/11/04
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS	5.85 11/15/27	社債	5.8500	60	62	8,476	2027/11/15
DISH NETWORK CORP	11.75 11/15/27	社債	11.7500	132	123	16,755	2027/11/15
ARCELORMITTAL SA	6.55 11/29/27	社債	6.5500	122	127	17,173	2027/11/29

銘柄	2023年5月10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	
LIVE NATION ENTERTAINMEN 4.875 11/01/24	社債	4.8750	110	108	14,695	2024/11/01
ZOETIS INC 5.4 11/14/25	社債	5.4000	20	20	2,757	2025/11/14
GLOBAL PAYMENTS INC 1.5 11/15/24	社債	1.5000	45	42	5,739	2024/11/15
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7 12/15/25	社債	3.7000	210	206	27,841	2025/12/15
BRITISH AIR 19-1 AA PTT 3.3 12/15/32	社債	3.3000	93	80	10,911	2032/12/15
ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.011 12/15/26	社債	4.0110	84	82	11,095	2026/12/15
AMAZON.COM INC 5.2 12/03/25	社債	5.2000	205	209	28,279	2025/12/03
CF INDUSTRIES INC 4.5 12/01/26	社債	4.5000	86	84	11,430	2026/12/01
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社債	3.5000	170	156	21,090	2029/12/01
AUST & NZ BANKING GROUP 6.742 12/08/32	社債	6.7420	200	207	28,099	2032/12/08
GO DADDY OPCO/FINCO 5.25 12/01/27	社債	5.2500	114	109	14,850	2027/12/01
NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD 7.75 12/15/25	社債	7.7500	46	46	6,226	2025/12/15
TRIMBLE INC 4.75 12/01/24	社債	4.7500	181	180	24,340	2024/12/01
MURPHY OIL CORP 5.875 12/01/27	社債	5.8750	44	42	5,782	2027/12/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社債	4.6250	237	222	30,084	2029/12/15
H&E EQUIPMENT SERVICES 3.875 12/15/28	社債	3.8750	102	87	11,794	2028/12/15
EMERALD DEBT MERGER 6.625 12/15/30	社債	6.6250	115	114	15,442	2030/12/15
WMG ACQUISITION CORP 3.75 12/01/29	社債	3.7500	77	67	9,063	2029/12/01
VICI PROPERTIES / NOTE 4.625 12/01/29	社債	4.6250	90	83	11,283	2029/12/01
WARRIOR MET COAL INC 7.875 12/01/28	社債	7.8750	89	90	12,242	2028/12/01
BOYD GAMING CORP 4.75 12/01/27	社債	4.7500	190	182	24,625	2027/12/01
SERVICE PROPERTIES TRUST 5.5 12/15/27	社債	5.5000	145	127	17,171	2027/12/15
PHILLIPS 66 4.95 12/01/27	社債	4.9500	111	112	15,156	2027/12/01
合計	-	-	43,476	40,888	5,526,038	-

■投資信託財産の構成

2023年5月10日現在

項目	第43作成期末	
	評価額	比率
L A U S インカム マザー ファンド	千円 3,924,233	% 99.2
コーポレートローン等、その他	29,963	0.8
投資信託財産総額	3,954,197	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、6,041,505千円、97.8%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、2023年5月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.15円、1ユーロ=148.23円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月12日)、 (2023年1月10日)、 (2023年2月10日)、 (2023年3月10日)、 (2023年4月10日)、 (2023年5月10日)現在

項 目	第252期末	第253期末	第254期末	第255期末	第256期末	第257期末
(A)資産	3,949,614,820円	3,875,877,506円	3,915,569,757円	3,980,831,175円	3,944,736,742円	3,954,197,001円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	47,149,554	95,521,381	108,357,559	93,796,261	84,234,034	29,963,667
L A U S イ ン カ ム マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	3,902,465,266	3,780,356,125	3,807,212,198	3,887,034,914	3,860,502,708	3,924,233,334
(B)負債	18,977,651	17,271,041	18,915,101	18,740,108	19,142,748	19,148,855
未 払 収 益 分 配 金	11,425,843	11,626,952	11,714,493	11,811,403	11,834,643	11,725,462
未 払 解 約 金	1,158,372	55,415	1,250,506	1,433,482	1,296,410	1,506,503
未 払 信 託 報 酬	6,380,731	5,577,563	5,938,278	5,484,298	5,999,749	5,905,130
そ の 他 未 払 費 用	12,705	11,111	11,824	10,925	11,946	11,760
(C)純資産総額(A-B)	3,930,637,169	3,858,606,465	3,896,654,656	3,962,091,067	3,925,593,994	3,935,048,146
元 本	3,808,614,473	3,875,650,872	3,904,831,139	3,937,134,377	3,944,881,021	3,908,487,621
次 期 繰 越 損 益 金	122,022,696	△17,044,407	△8,176,483	24,956,690	△19,287,027	26,560,525
(D)受益権総口数	3,808,614,473口	3,875,650,872口	3,904,831,139口	3,937,134,377口	3,944,881,021口	3,908,487,621口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,320円	9,956円	9,979円	10,063円	9,951円	10,068円

(注) 第251期末における元本額は3,821,545,982円、当作成期間(第252期~第257期)中における追加設定元本額は307,299,531円、同解約元本額は220,357,892円です。

■損益の状況

[自 2022年11月11日] [自 2022年12月13日] [自 2023年1月11日] [自 2023年2月11日] [自 2023年3月11日] [自 2023年4月11日]
 [至 2022年12月12日] [至 2023年1月10日] [至 2023年2月10日] [至 2023年3月10日] [至 2023年4月10日] [至 2023年5月10日]

項 目	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
(A)配 当 等 収 益	△5,812円	△2,528円	△1,614円	△1,139円	△1,490円	△1,217円
受 取 利 息	70	167	90	34	89	1
支 払 利 息	△5,882	△2,695	△1,704	△1,173	△1,579	△1,218
(B)有価証券売買損益	△141,279,787	△121,318,968	26,975,046	49,684,593	△25,780,338	63,230,276
売 買 益	2,777,129	842,681	26,976,324	49,823,432	730,208	63,730,626
売 買 損	△144,056,916	△122,161,649	△1,278	△138,839	△26,510,546	△500,350
(C)信 託 報 酬 等	△6,393,436	△5,588,674	△5,950,102	△5,495,223	△6,011,695	△5,916,890
(D)当期損益金(A+B+C)	△147,679,035	△126,910,170	21,023,330	44,188,231	△31,793,523	57,312,169
(E)前期繰越損益金	587,023,282	424,366,004	284,420,451	292,484,271	322,246,517	275,610,421
(F)追加信託差損益金	△305,895,708	△302,873,289	△301,905,771	△299,904,409	△297,905,378	△294,636,603
(配当等相当額)	(302,980,222)	(325,597,827)	(336,341,205)	(347,307,390)	(354,505,087)	(352,331,302)
(売買損益相当額)	(△608,875,930)	(△628,471,116)	(△638,246,976)	(△647,211,799)	(△652,410,465)	(△646,967,905)
(G)合 計(D+E+F)	133,448,539	△5,417,455	3,538,010	36,768,093	△7,452,384	38,285,987
(H)収 益 分 配 金	△11,425,843	△11,626,952	△11,714,493	△11,811,403	△11,834,643	△11,725,462
次期繰越損益金(G+H)	122,022,696	△17,044,407	△8,176,483	24,956,690	△19,287,027	26,560,525
追加信託差損益金	△305,895,708	△302,873,289	△301,905,771	△299,904,409	△297,905,378	△294,636,603
(配当等相当額)	(303,122,094)	(325,779,507)	(336,436,557)	(347,374,126)	(354,602,987)	(352,344,230)
(売買損益相当額)	(△609,017,802)	(△628,652,796)	(△638,342,328)	(△647,278,535)	(△652,508,365)	(△646,980,833)
分配準備積立金	661,730,108	650,976,687	646,409,744	643,728,326	636,399,610	631,620,515
繰 越 損 益 金	△233,811,704	△365,147,805	△352,680,456	△318,867,227	△357,781,259	△310,423,387

(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252期から第257期まではL A U S インカムマザーファンド 7,295,364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252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
(a)経費控除後の配当等収益	7,917,145円	6,366,945円	10,355,258円	11,869,895円	9,686,848円	13,816,857円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c)収 益 調 整 金	303,122,094	325,779,507	336,436,557	347,374,126	354,602,987	352,344,230
(d)分 配 準 備 積 立 金	665,238,806	656,236,694	647,768,979	643,669,834	638,547,405	629,529,120
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	976,278,045	988,383,146	994,560,794	1,002,913,855	1,002,837,240	995,690,207
(f)1万円当たり当期分配対象額	2,563.34	2,550.24	2,547.00	2,547.32	2,542.12	2,547.51
(g)分 配 金	11,425,843	11,626,952	11,714,493	11,811,403	11,834,643	11,725,462
(h)1万円当たり分配金	30	30	30	30	30	30

■分配金のお知らせ

決算期	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257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。

LA USインカムマザーファンド

運用報告書

第51期（決算日 2023年1月30日）

（計算期間 2022年8月2日～2023年1月30日）

LA USインカムマザーファンドの第51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				
47期(2021年2月1日)	50,299	8.6	297.91	△1.6	427.60	6.8	747.98	30.4	2.2	19.9	74.1	5,403
48期(2021年7月30日)	52,941	5.3	312.18	4.8	463.34	8.4	808.84	8.1	2.8	13.4	81.4	5,501
49期(2022年1月31日)	53,960	1.9	318.83	2.1	480.74	3.8	776.48	△4.0	3.1	6.6	87.1	5,459
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

(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)。

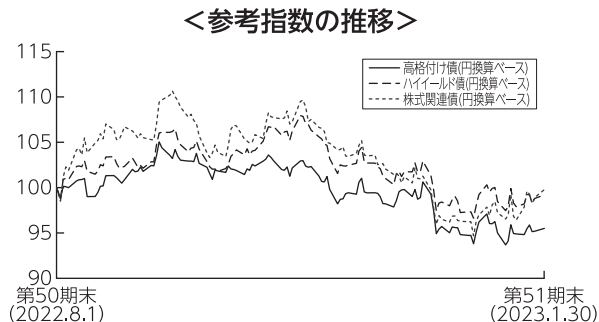
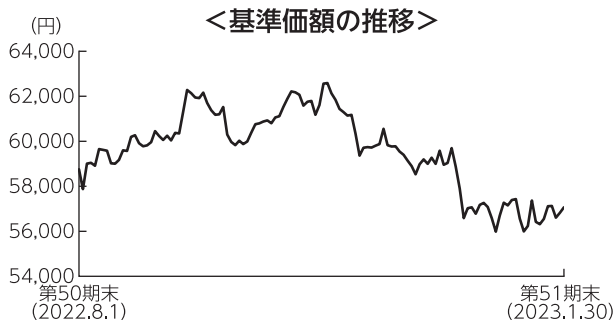
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2022年 8 月 1 日	円	%	341.52	%	519.64	%	826.53	%	%	%	%
8 月末	58,752	-	347.73	-	531.35	-	871.73	-	0.2	9.1	88.4
9 月末	60,057	2.2	347.81	1.8	528.99	2.3	858.66	5.5	1.2	12.6	83.4
10月末	59,877	1.9	351.57	1.8	560.86	1.8	904.93	3.9	1.0	7.4	86.0
11月末	62,562	6.5	338.11	2.9	530.53	7.9	847.91	9.5	-	7.0	88.1
12月末	59,398	1.1	323.84	△1.0	505.37	2.1	795.88	2.6	-	15.3	82.6
(期 末) 2023年 1 月30日	56,583	△3.7	326.15	△5.2	515.47	△2.7	824.77	△3.7	0.2	17.4	77.4
	57,065	△2.9	326.15	△4.5	515.47	△0.8	824.77	△0.2	-	15.6	82.4

(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 (2022年8月2日から2023年1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。

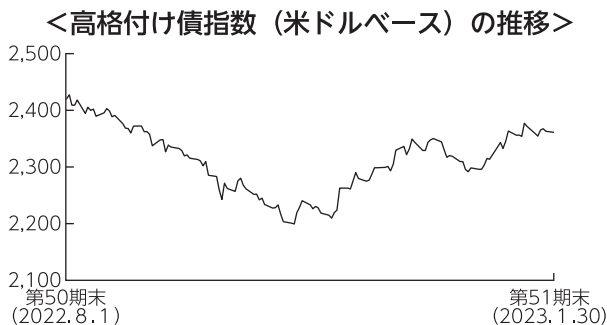
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は、前期末比で2.9%下落しました。

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、高格付け債市場が下落したことや米ドルが対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。

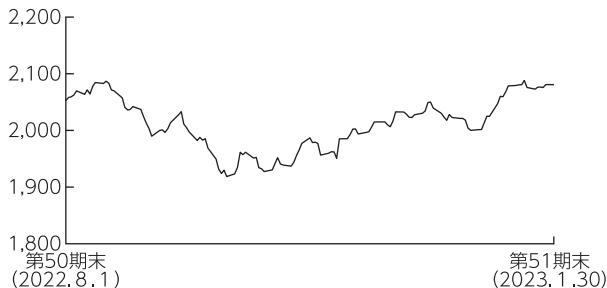
投資環境



＜高格付け債＞

米国高格付け債市場は、下落しました。F R B (米連邦準備理事会) 議長がインフレ抑制に向けて利上げ継続姿勢を示したことやF O M C (米連邦公開市場委員会) の投票権を持つメンバーの政策金利見通しが引き上げられたことなどから、2022年10月にかけては下落 (利回りは上昇) しました。その後は、米C P I (消費者物価指数) の伸びが市場予想を下回ったことなどを背景にF R Bによる利上げペース鈍化への期待が高まったことから下落幅を縮小しました。

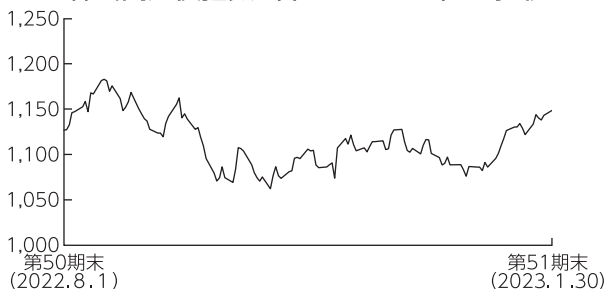
<ハイイールド債指数（米ドルベース）の推移>



<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。インフレ高進による収益圧迫など米企業業績を巡る懸念の高まりなどから、2022年9月にかけては下落基調で推移しました。その後は、米CPIの伸びが市場予想を下回ったことなどを背景にFRBによる利上げペース鈍化への期待が高まったことから上昇に転じ、期を通じては上昇しました。

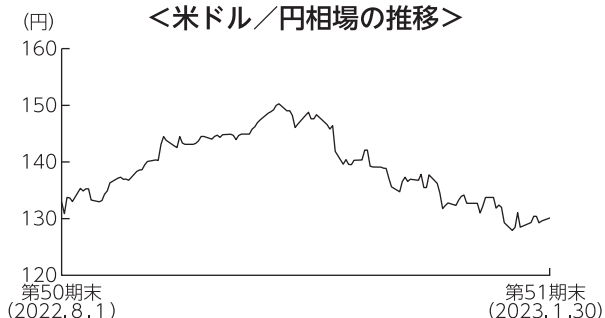
<株式関連債指数（米ドルベース）の推移>



<株式関連債>

米国株式関連債市場は、上昇しました。期初は急速な利上げに対する懸念が和らいだことなどから上昇する場面も見られましたが、インフレ高進による収益圧迫など米企業業績を巡る懸念の高まりなどから、2022年9月にかけては下落しました。その後は一進一退で推移しましたが、期末にかけては米CPIの伸びが市場予想を下回ったことなどを背景にFRBによる利上げペース鈍化への期待が高まったことから上昇し、期を通じては上昇しました。

<米ドル／円相場の推移>



<為替市場>

米ドルは、対円で下落しました。インフレ加速に対する懸念が高まるなか、FRBによる利上げペースの加速が意識されたことなどから2022年10月中旬にかけて上昇しました。その後はFRBが年内に利上げ幅を縮小するとの観測が高まったほか、日本政府・日本銀行が円買い・ドル売りの為替介入を実施したことや、日本銀行が長期金利の許容変動幅の拡大を決定し実質的な金融緩和縮小と受け止められたことなどから下落し、期を通じては下落しました。

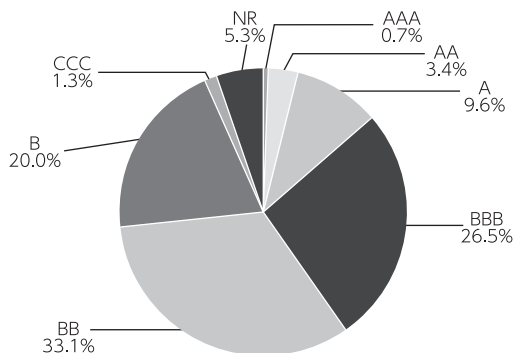
ポートフォリオについて

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上げた一方、ハイイールド債や高格付け債の比率を引き下げました。格付け別では、BBB格の比率を引き上げた一方、B格やBB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。

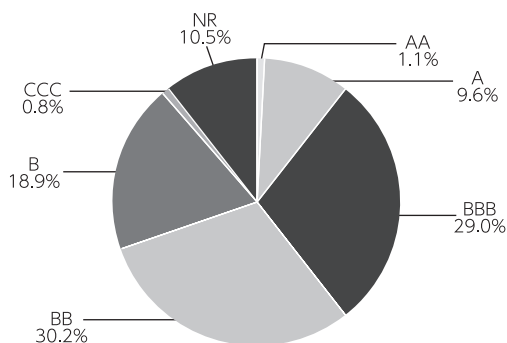
上記の運用を行った結果、高格付け債市場が下落したことや米ドルが対円で下落したことなどから、基準価額は2.9%下落しました。

<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	DEXCOM INC 0.75 12/01/23	0.750	2023/12/01	—	1.7
2	DPL INC 4.125 07/01/25	4.125	2025/07/01	BB	1.1
3	UBER TECHNOLOGIES INC 12/15/25	—	2025/12/15	B	1.0
4	WESTERN DIGITAL CORP 02/01/24	1.500	2024/02/01	BB	0.9
5	INSULET CORPORATION 0.375 09/01/26	0.375	2026/09/01	B	0.9
6	HAT HOLDINGS I LLC/HAT 6.0 04/15/25	6.000	2025/04/15	BB	0.8
7	ORGANON & CO/ORG 4.125 04/30/28	4.125	2028/04/30	BB	0.8
8	ALTERYX INC 0.5 08/01/24	0.500	2024/08/01	—	0.8
9	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	4.000	2030/11/13	BB	0.8
10	PDC ENERGY INC 5.75 05/15/26	5.750	2026/05/15	BB	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) 有価証券取引税 (株式)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	23 (22) (1)	0.039 (0.037) (0.002)	(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
合計	23	0.039	
期中の平均基準価額は59,589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 (2022年8月2日から2023年1月30日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外国	ア メ リ カ	百株 105 (-)	千アメリカ・ドル 847 (-)	百株 123	千アメリカ・ドル 814

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 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 7,400	千アメリカ・ドル 9,200	千アメリカ・ドル 4,583 (100)	千アメリカ・ドル 5,808 (100)

(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。

(3) 公社債

		買付額		売付額	
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 472	千アメリカ・ドル 1,270 (-)	
		特殊債証券	307	195 (-)	
		社債証券	8,922	8,607 (239)	

(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。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	237,108千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	46,274千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	5.12

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等(2022年8月2日から2023年1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) 外国株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ) DTE ENERGY CO PFD 6.25	百株 18	百株 -	-	-	総合公益事業
合 計	株数・金額 18	-	-	-	
	銘柄数<比率>	1銘柄	-	<->	

(注1) PFDは優先証券です。

(注2) 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3) < >内は、期末の純資産総額に対する株式評価額の比率です。

(注4) 金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。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(2) 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
MARRIOTT VACATION WORLDW 01/15/26	100	108	14,077
MAKEMYTRIP LIMITED 02/15/28	105	108	14,153
PELTON INTERACTIVE INC 02/15/26	92	70	9,133
WESTERN DIGITAL CORP 02/01/24	434	418	54,491
AIRBNB INC 03/15/26	200	173	22,535
GREEN PLAINS INC 2.25 03/15/27	85	103	13,453
ENPHASE ENERGY INC 03/01/28	85	89	11,685
CERIDIAN HCM HOLDING INC 0.25 03/15/26	124	113	14,705
GUIDEWIRE SOFTWARE INC 1.25 03/15/25	116	112	14,587
CHEGG INC 0.125 03/15/25	280	247	32,204
PENN NATIONAL GAMING INC 2.75 05/15/26	40	65	8,493
NATERA INC 2.25 05/01/27	35	48	6,300
BLOCK INC 05/01/26	337	286	37,270
WOLFSPEED INC 1.75 05/01/26	190	335	43,681
BOOKING HOLDINGS INC 0.75 05/01/25	80	115	15,027
NEUROCRINE BIOSCIENCES 2.25 05/15/24	127	183	23,811
NEW RELIC INC 0.5 05/01/23	108	106	13,883
CHEESECAKE FACTORY (THE) 0.375 06/15/26	103	90	11,717
COUPA SOFTWARE INC 0.125 06/15/25	310	303	39,479
PALO ALTO NETWORKS 0.375 06/01/25	85	140	18,325
LIVENT CORP 4.125 07/15/25	11	34	4,425
REPLIGEN CORP 0.375 07/15/24	65	115	14,969
ALTERYX INC 0.5 08/01/24	385	358	46,679
FTI CONSULTING INC 2.0 08/15/23	65	102	13,320
CLOUDFLARE INC 08/15/26	135	113	14,753
RH 09/15/24	75	116	15,135
INSULET CORPORATION 0.375 09/01/26	294	405	52,788
ANTERO RESOURCES CORP 4.25 09/01/26	8	53	6,999
APELLIS PHARMACEUTICALS 3.5 09/15/26	45	70	9,166
ETSY INC 0.125 10/01/26	134	230	30,031
PINDUODUO INC 10/01/24	70	171	22,277
KBR INC 2.5 11/01/23	40	79	10,403
FIVERR INTERNATIONAL LTD 11/01/25	258	220	28,715
SAREPTA THERAPEUTICS INC 1.5 11/15/24	65	116	15,138
CYBERARK SOFTWARE LTD 11/15/24	95	104	13,584
UBER TECHNOLOGIES INC 12/15/25	500	440	57,358
BILL.COM HOLDINGS INC 12/01/25	165	176	22,917
SUNNOVA ENERGY INTL INC 0.25 12/01/26	175	141	18,352
DEXCOM INC 0.75 12/01/23	300	779	101,427
合 計	額 面 ・ 金 額	5,921	7,051
	銘 柄 数<比率>	39銘柄	-
			<15.6%>

(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。

(3) 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 39,409	千アメリカ・ドル 37,253	千円 4,847,052	% 82.4	% 34.9	% 42.4	% 34.2	% 5.8
合 計	-	-	千円 4,847,052	82.4	34.9	42.4	34.2	5.8

(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		債 選 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		
PETROLEOS MEXICANOS 5.95 01/28/31	特 殊 債 券	5.9500	73	58	7,626	2031/01/28	
PETROLEOS MEXICANOS 5.35 02/12/28	特 殊 債 券	5.3500	56	49	6,436	2028/02/12	
CADILLAC FAIRVIEW PRP TR 3.875 03/20/27	特 殊 債 券	3.8750	200	187	24,373	2027/03/20	
CITGO PETROLEUM CORP 7.0 06/15/25	特 殊 債 券	7.0000	150	149	19,475	2025/06/15	
AMERICAN TOWER CORP 2.95 01/15/25	社 債 券	2.9500	183	175	22,866	2025/01/15	
UNITED RENTALS NORTH AM 4.875 01/15/28	社 債 券	4.8750	68	65	8,573	2028/01/15	
ASSURANT INC 2.65 01/15/32	社 債 券	2.6500	51	39	5,113	2032/01/15	
BLACKSTONE HOLDINGS FINA 2.0 01/30/32	社 債 券	2.0000	62	47	6,123	2032/01/30	
CENOVUS ENERGY INC 2.65 01/15/32	社 債 券	2.6500	50	41	5,416	2032/01/15	
SM ENERGY CO 6.625 01/15/27	社 債 券	6.6250	159	155	20,168	2027/01/15	
OHIO EDISON CO 5.5 01/15/33	社 債 券	5.5000	35	36	4,707	2033/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/31	社 債 券	4.0000	56	49	6,439	2031/01/15	
TERRAFORM POWER OPERATIN 4.75 01/15/30	社 債 券	4.7500	96	86	11,283	2030/01/15	
PACIFIC GAS & ELECTRIC 6.15 01/15/33	社 債 券	6.1500	61	62	8,136	2033/01/15	
CONTINENTAL RESOURCES 4.375 01/15/28	社 債 券	4.3750	207	195	25,474	2028/01/15	
NRG ENERGY INC 5.75 01/15/28	社 債 券	5.7500	265	252	32,913	2028/01/15	
HILTON DOMESTIC OPERATIN 4.875 01/15/30	社 債 券	4.8750	179	168	21,961	2030/01/15	
ALLISON TRANSMISSION INC 3.75 01/30/31	社 債 券	3.7500	101	85	11,118	2031/01/30	
BANK OF AMERICA CORP 4.0 01/22/25	社 債 券	4.0000	95	93	12,138	2025/01/22	
HOME BANCSHARES INC 01/30/32	社 債 券	3.1250	39	31	4,077	2032/01/30	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 3.25 01/31/32	社 債 券	3.2500	55	45	5,957	2032/01/31	
LAREDO PETROLEUM INC 10.125 01/15/28	社 債 券	10.1250	222	221	28,882	2028/01/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	社 債 券	6.1250	186	194	25,320	2031/01/01	
PIONEER NATURAL RESOURCE 2.15 01/15/31	社 債 券	2.1500	49	40	5,267	2031/01/15	
TRANSDIGM INC 4.625 01/15/29	社 債 券	4.6250	100	90	11,758	2029/01/15	
BNP PARIBAS 01/13/29	社 債 券	5.1250	200	201	26,171	2029/01/13	
DEUTSCHE BANK NY 01/18/29	社 債 券	6.7200	150	157	20,470	2029/01/18	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 9.25 01/15/29	社 債 券	9.2500	85	89	11,676	2029/01/15	
GLP CAPITAL LP / FIN II 4.0 01/15/30	社 債 券	4.0000	47	42	5,522	2030/01/15	
HAWAIIAN AIRLINES 13-1A 3.9 01/15/26	社 債 券	3.9000	203	181	23,658	2026/01/15	
AVIATION CAPITAL GROUP 1.95 01/30/26	社 債 券	1.9500	25	22	2,876	2026/01/30	
HAWAIIAN BRAND INTELLECT 5.75 01/20/26	社 債 券	5.7500	50	48	6,329	2026/01/20	
DELTA AIR LINES INC 7.375 01/15/26	社 債 券	7.3750	150	156	20,413	2026/01/15	
LIFE TIME INC 5.75 01/15/26	社 債 券	5.7500	115	111	14,485	2026/01/15	
DANSKE BANK A/S 01/09/26	社 債 券	6.4660	200	202	26,371	2026/01/09	
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社 債 券	4.3500	34	31	4,151	2028/02/15	
CALPINE CORP 5.0 02/01/31	社 債 券	5.0000	206	177	23,150	2031/02/01	
HESS CORP 5.6 02/15/41	社 債 券	5.6000	50	49	6,505	2041/02/15	
OLIN CORP 5.0 02/01/30	社 債 券	5.0000	51	47	6,223	2030/02/01	
OVINTIV INC 6.5 02/01/38	社 債 券	6.5000	79	82	10,685	2038/02/01	
L BRANDS INC 5.25 02/01/28	社 債 券	5.2500	41	38	5,062	2028/02/01	

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		
TENET HEALTHCARE CORP 6.25 02/01/27	社債	6.2500	107	104	13,615	2027/02/01	
AMPHENOL CORP 2.8 02/15/30	社債	2.8000	102	90	11,751	2030/02/15	
MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.6 02/23/28	社債	4.6000	59	58	7,621	2028/02/23	
ASSURANT INC 3.7 02/22/30	社債	3.7000	48	42	5,561	2030/02/22	
OCEANEERING INTL INC 6.0 02/01/28	社債	6.0000	82	79	10,308	2028/02/01	
FORD MOTOR COMPANY 3.25 02/12/32	社債	3.2500	53	42	5,481	2032/02/12	
PROLOGIS LP 4.375 02/01/29	社債	4.3750	50	48	6,372	2029/02/01	
MEG ENERGY CORP 7.125 02/01/27	社債	7.1250	135	138	17,982	2027/02/01	
PATTERSON-UTI ENERGY INC 3.95 02/01/28	社債	3.9500	170	154	20,112	2028/02/01	
HILCORP ENERGY I/HILCORP 5.75 02/01/29	社債	5.7500	17	15	2,081	2029/02/01	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 4.05 02/01/30	社債	4.3000	140	128	16,757	2030/02/01	
GENUINE PARTS CO 2.75 02/01/32	社債	2.7500	56	46	6,067	2032/02/01	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.0 02/15/29	社債	3.0000	256	221	28,837	2029/02/15	
MEG ENERGY CORP 5.875 02/01/29	社債	5.8750	91	87	11,412	2029/02/01	
CHARLES SCHWAB CORP 3.45 02/13/26	社債	3.4500	58	56	7,346	2026/02/13	
NETFLIX INC 5.875 02/15/25	社債	5.8750	257	262	34,108	2025/02/15	
PTC INC 4.0 02/15/28	社債	4.0000	47	43	5,660	2028/02/15	
SBA COMMUNICATIONS CORP 3.875 02/15/27	社債	3.8750	139	129	16,809	2027/02/15	
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER 5.875 02/01/29	社債	5.8750	106	101	13,223	2029/02/01	
HECLA MINING CO 7.25 02/15/28	社債	7.2500	131	130	16,979	2028/02/15	
PTC INC 3.625 02/15/25	社債	3.6250	172	165	21,500	2025/02/15	
SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.375 02/01/29	社債	5.3750	39	37	4,826	2029/02/01	
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社債	3.3750	163	143	18,645	2030/02/15	
CATALENT PHARMA SOLUTION 3.125 02/15/29	社債	3.1250	100	83	10,830	2029/02/15	
GENTING NY LLC/GENNY CAP 3.3 02/15/26	社債	3.3000	200	178	23,209	2026/02/15	
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER 5.5 02/01/26	社債	5.5000	91	88	11,528	2026/02/01	
CDW LLC/CDW FINANCE 3.25 02/15/29	社債	3.2500	125	109	14,184	2029/02/15	
BOMBARDIER INC 7.5 02/01/29	社債	7.5000	42	42	5,491	2029/02/01	
NCL CORPORATION LTD 8.375 02/01/28	社債	8.3750	24	24	3,170	2028/02/01	
CAESARS ENTERTAIN INC 7.0 02/15/30	社債	7.0000	62	63	8,244	2030/02/15	
MAGALLANES INC 5.141 03/15/52	社債	5.1410	92	76	9,906	2052/03/15	
EXXON MOBIL CORPORATION 3.043 03/01/26	社債	3.0430	31	29	3,888	2026/03/01	
TOLL BROS FINANCE CORP 4.875 03/15/27	社債	4.8750	85	82	10,778	2027/03/15	
BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75 03/15/23	社債	2.7500	178	177	23,106	2023/03/15	
SELECTIVE INSURANCE GROU 5.375 03/01/49	社債	5.3750	75	69	9,007	2049/03/01	
PENNSYLVANIA ELECTRIC CO 3.25 03/15/28	社債	3.2500	66	61	7,963	2028/03/15	
KLA CORP 4.1 03/15/29	社債	4.1000	95	93	12,187	2029/03/15	
ABN AMRO BANK NV 03/13/37	社債	3.3240	200	156	20,306	2037/03/13	
SPRINT CORP 7.625 03/01/26	社債	7.6250	75	79	10,343	2026/03/01	
NEUBERGER BERMAN GRP/FIN 4.5 03/15/27	社債	4.5000	100	96	12,557	2027/03/15	
BROWN & BROWN INC 2.375 03/15/31	社債	2.3750	140	112	14,673	2031/03/15	
GOODMAN US FIN THREE 3.7 03/15/28	社債	3.7000	38	34	4,545	2028/03/15	
WEBSTER FINANCIAL CORP 4.1 03/25/29	社債	4.1000	96	90	11,751	2029/03/25	
SPRINT CAPITAL CORP 8.75 03/15/32	社債	8.7500	50	61	8,011	2032/03/15	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS 3.45 03/01/32	社債	3.4500	280	246	32,007	2032/03/01	
CALPINE CORP 3.75 03/01/31	社債	3.7500	152	127	16,585	2031/03/01	
REPUBLIC SERVICES INC 2.375 03/15/33	社債	2.3750	55	45	5,937	2033/03/15	
LEGGETT & PLATT INC 4.4 03/15/29	社債	4.4000	104	100	13,040	2029/03/15	
LEVI STRAUSS & CO 3.5 03/01/31	社債	3.5000	71	59	7,725	2031/03/01	
SOUTHWEST GAS CORP 4.05 03/15/32	社債	4.0500	46	42	5,497	2032/03/15	
TRANSIDIGM INC 6.25 03/15/26	社債	6.2500	134	134	17,452	2026/03/15	
CIT GROUP INC 6.125 03/09/28	社債	6.1250	156	163	21,251	2028/03/09	
EATON CORP 4.15 03/15/33	社債	4.1500	51	49	6,430	2033/03/15	
MAGELLAN MIDSTREAM PARTN 3.95 03/01/50	社債	3.9500	84	66	8,675	2050/03/01	
CLEARWAY ENERGY OP LLC 4.75 03/15/28	社債	4.7500	136	127	16,648	2028/03/15	
AG ISSUER LLC 6.25 03/01/28	社債	6.2500	271	255	33,254	2028/03/01	
PEPSICO INC 3.6 03/01/24	社債	3.6000	98	97	12,628	2024/03/01	
UNITED STATES STEEL CORP 6.875 03/01/29	社債	6.8750	88	88	11,576	2029/03/01	
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.125 03/01/28	社債	4.1250	93	88	11,466	2028/03/01	
HILLENBRAND INC 3.75 03/01/31	社債	3.7500	97	81	10,624	2031/03/01	
COMSTOCK RESOURCES INC 6.75 03/01/29	社債	6.7500	86	79	10,397	2029/03/01	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 03/01/28	社債	4.5000	100	90	11,801	2028/03/01	
ANTERO RESOURCES CORP 5.375 03/01/30	社債	5.3750	67	63	8,210	2030/03/01	

銘柄	当 期 未						償還日
	種類	利率	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			
SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.375 03/15/30	社債	5.3750	70	65		8,574	2030/03/15
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.2 03/15/28	社債	4.2000	27	26		3,389	2028/03/15
CHARLES RIVER LABORATORI 3.75 03/15/29	社債	3.7500	120	107		13,987	2029/03/15
NAVIENT CORP 4.875 03/15/28	社債	4.8750	7	6		804	2028/03/15
OWENS & MINOR INC 4.5 03/31/29	社債	4.5000	50	41		5,376	2029/03/31
BELLRING BRANDS INC 7.0 03/15/30	社債	7.0000	45	44		5,834	2030/03/15
PEPSICO INC 2.25 03/19/25	社債	2.2500	110	105		13,693	2025/03/19
HSBC HOLDINGS PLC 03/10/26	社債	2.9990	200	190		24,731	2026/03/10
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP 5.5 03/01/25	社債	5.5000	170	165		21,545	2025/03/01
POST HOLDINGS INC 5.75 03/01/27	社債	5.7500	155	152		19,886	2027/03/01
HUMANA INC 5.75 03/01/28	社債	5.7500	40	41		5,427	2028/03/01
BALL CORP 6.875 03/15/28	社債	6.8750	59	60		7,925	2028/03/15
FACTSET RESEARCH SYSTEMS 2.9 03/01/27	社債	2.9000	45	41		5,446	2027/03/01
WYNDHAM WORLDWIDE 04/01/27	社債	6.0000	66	64		8,420	2027/04/01
REGAL REXNORD CORP 6.4 04/15/33	社債	6.4000	66	66		8,663	2033/04/15
WORKDAY INC 3.8 04/01/32	社債	3.8000	72	65		8,559	2032/04/01
FMG RESOURCES AUG 2006 6.125 04/15/32	社債	6.1250	107	104		13,657	2032/04/15
DT MIDSTREAM INC 4.3 04/15/32	社債	4.3000	47	43		5,639	2032/04/15
APACHE CORP 4.75 04/15/43	社債	4.7500	59	46		6,064	2043/04/15
CHOBANI LLC/FINANCE CORP 7.5 04/15/25	社債	7.5000	47	46		6,030	2025/04/15
NETFLIX INC 4.875 04/15/28	社債	4.8750	168	167		21,829	2028/04/15
STEEL DYNAMICS INC 3.45 04/15/30	社債	3.4500	49	45		5,877	2030/04/15
FMG RESOURCES AUG 2006 4.375 04/01/31	社債	4.3750	100	88		11,559	2031/04/01
ORACLE CORP 3.6 04/01/50	社債	3.6000	64	47		6,133	2050/04/01
VITERRA FINANCE BV 3.2 04/21/31	社債	3.2000	200	156		20,357	2031/04/21
AMERICAN AIRLINES/AADVAN 5.75 04/20/29	社債	5.7500	70	67		8,821	2029/04/20
T-MOBILE USA INC 3.375 04/15/29	社債	3.3750	140	127		16,596	2029/04/15
CVS HEALTH CORP 3.625 04/01/27	社債	3.6250	57	55		7,162	2027/04/01
BMW US CAPITAL LLC 4.15 04/09/30	社債	4.1500	97	94		12,279	2030/04/09
MCCORMICK & CO 2.5 04/15/30	社債	2.5000	75	64		8,382	2030/04/15
HUNT COS INC 5.25 04/15/29	社債	5.2500	117	99		12,981	2029/04/15
STELLANTIS NV 5.25 04/15/23	社債	5.2500	200	199		25,991	2023/04/15
ORGANON & CO/ORG 4.125 04/30/28	社債	4.1250	400	365		47,497	2028/04/30
MGM RESORTS INTL 5.5 04/15/27	社債	5.5000	150	144		18,790	2027/04/15
CAMPBELL SOUP CO 2.375 04/24/30	社債	2.3750	64	55		7,171	2030/04/24
UNITED AIRLINES INC 4.625 04/15/29	社債	4.6250	28	25		3,347	2029/04/15
MOZART DEBT MERGER SUB 3.875 04/01/29	社債	3.8750	125	107		14,009	2029/04/01
VITERRA FINANCE BV 2.0 04/21/26	社債	2.0000	200	176		22,930	2026/04/21
ENTEGRIS ESCROW CORP 4.75 04/15/29	社債	4.7500	37	34		4,524	2029/04/15
UNITED AIRLINES INC 4.375 04/15/26	社債	4.3750	70	66		8,664	2026/04/15
HAT HOLDINGS I LLC/HAT 6.0 04/15/25	社債	6.0000	380	370		48,255	2025/04/15
WEATHERFORD INTERNATIONAL 8.625 04/30/30	社債	8.6250	104	104		13,616	2030/04/30
CSC HOLDINGS LLC 5.5 04/15/27	社債	5.5000	200	176		22,916	2027/04/15
BOEING CO 5.805 05/01/50	社債	5.8050	154	157		20,439	2050/05/01
RAYONIER LP 2.75 05/17/31	社債	2.7500	100	83		10,803	2031/05/17
PULTE GROUP INC 6.375 05/15/33	社債	6.3750	48	49		6,505	2033/05/15
MONONGAHELA POWER CO 3.55 05/15/27	社債	3.5500	48	45		5,968	2027/05/15
SABAL TRAIL TRANS 4.246 05/01/28	社債	4.2460	85	80		10,473	2028/05/01
ASHTAD CAPITAL INC 5.55 05/30/33	社債	5.5500	200	200		26,145	2033/05/30
JETBLUE 2019-1 CLASS A 2.95 05/15/28	社債	2.9500	34	30		3,910	2028/05/15
SCIENTIFIC GAMES INTERNA 7.0 05/15/28	社債	7.0000	15	14		1,947	2028/05/15
VICI PROPERTIES LP 5.125 05/15/32	社債	5.1250	44	42		5,499	2032/05/15
FRONTIER COMMUNICATIONS 6.75 05/01/29	社債	6.7500	22	18		2,452	2029/05/01
ANTHEM INC 2.25 05/15/30	社債	2.2500	80	68		8,871	2030/05/15
GOODMAN US FIN FIVE LLC 4.625 05/04/32	社債	4.6250	40	37		4,920	2032/05/04
NEWS CORP 3.875 05/15/29	社債	3.8750	64	57		7,440	2029/05/15
UNITEDHEALTH GROUP INC 4.2 05/15/32	社債	4.2000	59	58		7,573	2032/05/15
MIDWEST GAMING BORROWER 4.875 05/01/29	社債	4.8750	119	105		13,711	2029/05/01
RANGE RESOURCES CORP 4.875 05/15/25	社債	4.8750	191	184		24,019	2025/05/15
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.0 05/01/28	社債	5.0000	66	59		7,741	2028/05/01
GLOBAL PAYMENTS INC 2.9 05/15/30	社債	2.9000	64	54		7,142	2030/05/15
PDC ENERGY INC 5.75 05/15/26	社債	5.7500	350	340		44,243	2026/05/15
APPLE INC 3.2 05/11/27	社債	3.2000	196	189		24,613	2027/05/11

銘柄	当 期 未						償還日
	種類	利率	額面金額	評 価 額		外貨建金額	
				千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
KRAFT HEINZ FOODS CO 3.875 05/15/27	社債	券	3.8750	265	258	33,590	2027/05/15
AMER AIRLN 15-1 A PTT 3.375 05/01/27	社債	券	3.3750	62	53	6,980	2027/05/01
JPMORGAN CHASE & CO 05/01/28	社債	券	3.5400	110	104	13,570	2028/05/01
SCIH SALT HOLDINGS INC 6.625 05/01/29	社債	券	6.6250	50	42	5,578	2029/05/01
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/27	社債	券	5.1250	180	171	22,248	2027/05/01
CARNIVAL HLDGS BM LTD 10.375 05/01/28	社債	券	10.3750	40	43	5,597	2028/05/01
TEVA PHARMACEUTICALS NE 5.125 05/09/29	社債	券	5.1250	200	185	24,109	2029/05/09
VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.5 05/15/29	社債	券	5.5000	200	187	24,343	2029/05/15
DELTA AIR LINES INC 7.0 05/01/25	社債	券	7.0000	135	139	18,098	2025/05/01
HUNTINGTON INGALLS INDUS 4.2 05/01/30	社債	券	4.2000	139	129	16,912	2030/05/01
SABINE PASS LIQUEFACTION 4.5 05/15/30	社債	券	4.5000	185	179	23,309	2030/05/15
ROBLOX CORP 3.875 05/01/30	社債	券	3.8750	146	122	15,985	2030/05/01
SHELL INTERNATIONAL FIN 2.875 05/10/26	社債	券	2.8750	35	33	4,343	2026/05/10
LEIDOS INC 3.625 05/15/25	社債	券	3.6250	21	20	2,650	2025/05/15
VISTRA OPERATIONS CO LLC 5.125 05/13/25	社債	券	5.1250	300	294	38,304	2025/05/13
CENOVUS ENERGY INC 5.4 06/15/47	社債	券	5.4000	108	104	13,565	2047/06/15
BRITISH AIR 19-1 A PTT 3.35 06/15/29	社債	券	3.3500	35	31	4,041	2029/06/15
XILINX INC 2.95 06/01/24	社債	券	2.9500	238	232	30,233	2024/06/01
GLP CAPITAL LP / FIN II 5.75 06/01/28	社債	券	5.7500	102	102	13,387	2028/06/01
ROCHESTER GAS & ELECTRIC 3.1 06/01/27	社債	券	3.1000	217	203	26,494	2027/06/01
VULCAN MATERIALS CO 4.5 06/15/47	社債	券	4.5000	49	43	5,691	2047/06/15
EDWARDS LIFESCIENCES COR 4.3 06/15/28	社債	券	4.3000	89	87	11,358	2028/06/15
KAISER ALUMINUM CORP 4.5 06/01/31	社債	券	4.5000	62	53	6,959	2031/06/01
AUTODESK INC 3.5 06/15/27	社債	券	3.5000	118	112	14,677	2027/06/15
HCA INC 7.69 06/15/25	社債	券	7.6900	96	100	13,095	2025/06/15
VERISIGN INC 2.7 06/15/31	社債	券	2.7000	53	45	5,917	2031/06/15
CABOT CORP 5.0 06/30/32	社債	券	5.0000	49	47	6,215	2032/06/30
SM ENERGY CO 5.625 06/01/25	社債	券	5.6250	65	63	8,296	2025/06/01
WESTERN ALLIANCE BANCORP 06/15/31	社債	券	3.0000	36	31	4,087	2031/06/15
MILEAGE PLUS HLDINGS LLC 6.5 06/20/27	社債	券	6.5000	122	123	16,067	2027/06/20
MADISON IAQ LLC 4.125 06/30/28	社債	券	4.1250	96	84	10,956	2028/06/30
PUGET ENERGY INC 4.1 06/15/30	社債	券	4.1000	78	71	9,367	2030/06/15
ALBEMARLE CORP 4.65 06/01/27	社債	券	4.6500	88	87	11,379	2027/06/01
BOMBARDIER INC 7.125 06/15/26	社債	券	7.1250	90	90	11,716	2026/06/15
CALLON PETROLEUM CO 7.5 06/15/30	社債	券	7.5000	56	54	7,075	2030/06/15
CALPINE CORP 5.25 06/01/26	社債	券	5.2500	130	126	16,404	2026/06/01
PACIFIC GAS & ELECTRIC 4.95 06/08/25	社債	券	4.9500	210	207	27,031	2025/06/08
ORACLE CORP 4.5 07/08/44	社債	券	4.5000	47	41	5,361	2044/07/08
MORGAN STANLEY 3.125 07/27/26	社債	券	3.1250	90	85	11,099	2026/07/27
VERISIGN INC 4.75 07/15/27	社債	券	4.7500	82	81	10,583	2027/07/15
FIRSTENERGY CORP 3.9 07/15/27	社債	券	4.1500	90	85	11,186	2027/07/15
TENET HEALTHCARE CORP 4.625 07/15/24	社債	券	4.6250	125	123	16,099	2024/07/15
NGPL PIPECO LLC 3.25 07/15/31	社債	券	3.2500	75	63	8,233	2031/07/15
FIRSTENERGY CORP 07/15/47	社債	券	5.1000	46	42	5,505	2047/07/15
BAFFINLAND IRON CORP/LP 8.75 07/15/26	社債	券	8.7500	46	45	5,877	2026/07/15
PARTNERRE FINANCE B LLC 3.7 07/02/29	社債	券	3.7000	93	86	11,288	2029/07/02
KLA CORP 4.65 07/15/32	社債	券	4.6500	26	26	3,440	2032/07/15
NEXSTAR ESCROW INC 5.625 07/15/27	社債	券	5.6250	46	44	5,736	2027/07/15
COSTAR GROUP INC 2.8 07/15/30	社債	券	2.8000	28	23	3,072	2030/07/15
VALE OVERSEAS LIMITED 3.75 07/08/30	社債	券	3.7500	47	41	5,457	2030/07/08
US BANCORP 3.0 07/30/29	社債	券	3.0000	44	40	5,207	2029/07/30
GXO LOGISTICS INC 2.65 07/15/31	社債	券	2.6500	7	5	716	2031/07/15
VERTICAL HOLDCO GMBH 7.625 07/15/28	社債	券	7.6250	200	178	23,192	2028/07/15
PG&E CORP 5.0 07/01/28	社債	券	5.0000	59	55	7,172	2028/07/01
MURPHY OIL CORP 6.375 07/15/28	社債	券	6.3750	47	46	6,032	2028/07/15
TECK RESOURCES LIMITED 3.9 07/15/30	社債	券	3.9000	102	94	12,329	2030/07/15
BACARDI LTD 2.75 07/15/26	社債	券	2.7500	300	275	35,900	2026/07/15
INTUIT INC 0.95 07/15/25	社債	券	0.9500	273	250	32,559	2025/07/15
CALLON PETROLEUM CO 6.375 07/01/26	社債	券	6.3750	111	107	13,939	2026/07/01
CELANESE US HOLDINGS LLC 6.165 07/15/27	社債	券	6.1650	128	129	16,832	2027/07/15
NTT 4.372 07/27/27	社債	券	4.3720	200	198	25,874	2027/07/27
IMPERIAL BRANDS FIN PLC 6.125 07/27/27	社債	券	6.1250	200	204	26,620	2027/07/27
DPL INC 4.125 07/01/25	社債	券	4.1250	540	516	67,178	2025/07/01

銘柄	当 期 未						償還日
	種類	利率	額面金額	評 価 額		外貨建金額	
				千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
CELANESE US HOLDINGS LLC 5.9 07/05/24	社債	5.9000	85	85	11,096	2024/07/05	
META PLATFORMS INC 4.45 08/15/52	社債	4.4500	112	96	12,616	2025/08/15	
AUSGRID FINANCE PTY LTD 4.35 08/01/28	社債	4.3500	58	55	7,172	2028/08/01	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS 5.25 08/01/26	社債	5.2500	92	89	11,676	2026/08/01	
MSCI INC 3.25 08/15/33	社債	3.2500	22	17	2,329	2033/08/15	
WILLIAMS COMPANIES INC 4.65 08/15/32	社債	4.6500	92	89	11,668	2032/08/15	
MURPHY OIL CORP 5.75 08/15/25	社債	5.7500	12	11	1,554	2025/08/15	
ASHTAD CAPITAL INC 5.5 08/11/32	社債	5.5000	200	201	26,170	2032/08/11	
FIDELITY NATL FINANCIAL 4.5 08/15/28	社債	4.5000	70	68	8,857	2028/08/15	
FORD MOTOR COMPANY 6.1 08/19/32	社債	6.1000	43	42	5,468	2032/08/19	
PATTERN ENERGY OP LP/PAT 4.5 08/15/28	社債	4.5000	187	171	22,371	2028/08/15	
FLIR SYSTEMS INC 2.5 08/01/30	社債	2.5000	51	42	5,567	2030/08/01	
NGPL PIPECO LLC 4.875 08/15/27	社債	4.8750	122	118	15,437	2027/08/15	
BALL CORP 2.875 08/15/30	社債	2.8750	125	103	13,418	2030/08/15	
LENNOX INTERNATIONAL INC 1.35 08/01/25	社債	1.3500	41	37	4,877	2025/08/01	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 4.125 08/15/31	社債	4.1250	34	30	3,936	2031/08/15	
ALASKA AIRLINES 2020 TR 4.8 08/15/27	社債	4.8000	43	41	5,438	2027/08/15	
LAS VEGAS SANDS CORP 3.5 08/18/26	社債	3.5000	140	131	17,114	2026/08/18	
CALLON PETROLEUM 8.0 08/01/28	社債	8.0000	70	70	9,137	2028/08/01	
CARNIVAL CORP 4.0 08/01/28	社債	4.0000	75	64	8,410	2028/08/01	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 3.875 08/15/29	社債	3.8750	72	64	8,398	2029/08/15	
AIR CANADA 3.875 08/15/26	社債	3.8750	94	87	11,328	2026/08/15	
CARNIVAL CORP 9.875 08/01/27	社債	9.8750	85	87	11,373	2027/08/01	
BERKLEY (WR) CORPORATION 3.15 09/30/61	社債	3.1500	38	25	3,278	2061/09/30	
APACHE CORP 5.1 09/01/40	社債	5.1000	385	334	43,457	2040/09/01	
LEAR CORP 3.8 09/15/27	社債	3.8000	41	39	5,096	2027/09/15	
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.2 09/15/28	社債	4.2000	44	43	5,658	2028/09/15	
BRITISH AIR 18-1 A PTT 4.125 09/20/31	社債	4.1250	28	24	3,143	2031/09/20	
OLIN CORP 5.125 09/15/27	社債	5.1250	47	45	5,917	2027/09/15	
BRITISH AIR 18-1 AA PTT 3.8 09/20/31	社債	3.8000	128	118	15,401	2031/09/20	
NORTHWESTERN MUTUAL LIFE 3.85 09/30/47	社債	3.8500	48	39	5,181	2047/09/30	
APPLE INC 2.9 09/12/27	社債	2.9000	52	49	6,418	2027/09/12	
FLUOR CORP 4.25 09/15/28	社債	4.2500	309	287	37,407	2028/09/15	
HCA INC 3.5 09/01/30	社債	3.5000	85	76	9,915	2030/09/01	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.625 09/01/30	社債	6.6250	36	38	5,015	2030/09/01	
WISCONSIN ELECTRIC POWER 4.75 09/30/32	社債	4.7500	42	42	5,556	2032/09/30	
ONEOK INC 4.45 09/01/49	社債	4.4500	47	37	4,922	2049/09/01	
MURPHY OIL USA INC 4.75 09/15/29	社債	4.7500	164	152	19,795	2029/09/15	
SM ENERGY CO 6.75 09/15/26	社債	6.7500	42	41	5,359	2026/09/15	
HELMERICH & PAYNE INC 2.9 09/29/31	社債	2.9000	100	84	11,012	2031/09/29	
USA COM PART/USA COM FIN 6.875 09/01/27	社債	6.8750	115	111	14,502	2027/09/01	
MATADOR RESOURCES CO 5.875 09/15/26	社債	5.8750	287	283	36,919	2026/09/15	
BANK OF IRELAND GROUP 09/30/27	社債	2.0290	200	174	22,658	2027/09/30	
ENEL FINANCE INTL NV 2.65 09/10/24	社債	2.6500	200	192	24,985	2024/09/10	
ON SEMICONDUCTOR CORP 3.875 09/01/28	社債	3.8750	145	131	17,113	2028/09/01	
NORTONLIFELOCK INC 6.75 09/30/27	社債	6.7500	43	43	5,675	2027/09/30	
ITC HOLDINGS CORP 4.95 09/22/27	社債	4.9500	17	17	2,233	2027/09/22	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 6.375 09/01/29	社債	6.3750	57	55	7,164	2029/09/01	
VICI PROPERTIES / NOTE 4.5 09/01/26	社債	4.5000	100	95	12,465	2026/09/01	
BANK OF IRELAND GROUP 09/16/26	社債	6.2530	200	201	26,219	2026/09/16	
MIRABELA NICKEL 144-A 1%	社債	0.0000	1	0.00012	0.015	2044/09/10	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.25 10/21/25	社債	4.2500	36	35	4,606	2025/10/21	
ATLANTIC CITY ELECTRIC 4.0 10/15/28	社債	4.0000	52	50	6,608	2028/10/15	
BANK OZK 10/01/31	社債	2.7500	100	86	11,205	2031/10/01	
BAT CAPITAL CORP 7.75 10/19/32	社債	7.7500	41	45	5,953	2032/10/19	
GOODMAN US FIN FOUR 4.5 10/15/37	社債	4.5000	43	37	4,896	2037/10/15	
TIFFANY & CO 4.9 10/01/44	社債	4.9000	75	69	9,068	2044/10/01	
CONSTELLATION EN GEN LLC 6.25 10/01/39	社債	6.2500	120	129	16,866	2039/10/01	
AIB GROUP PLC 4.75 10/12/23	社債	4.7500	200	197	25,681	2023/10/12	
NEWMONT CORP 2.25 10/01/30	社債	2.2500	93	77	10,085	2030/10/01	
FMC CORP 3.45 10/01/29	社債	3.4500	44	40	5,229	2029/10/01	
TENET HEALTHCARE CORP 6.125 10/01/28	社債	6.1250	195	182	23,756	2028/10/01	
DELTA AIR LINES/SKYMILES 4.75 10/20/28	社債	4.7500	45	43	5,711	2028/10/20	

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	
NEXTERA ENERGY OPERATING 3.875 10/15/26	社債	3.8750	204	189	24,711	2026/10/15
CONNECT FINCO SARL/CONNIE 6.75 10/01/26	社債	6.7500	91	87	11,378	2026/10/01
MOHEGAN GAMING & ENT 7.875 10/15/24	社債	7.8750	55	55	7,169	2024/10/15
GAP INC/THE 3.625 10/01/29	社債	3.6250	60	46	5,997	2029/10/01
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.875 10/15/27	社債	5.8750	68	64	8,417	2027/10/15
ROLLER BEARING CO OF AME 4.375 10/15/29	社債	4.3750	94	85	11,070	2029/10/15
SUNTORY HOLDINGS LTD 2.25 10/16/24	社債	2.2500	200	188	24,578	2024/10/16
UNITED AIR 2020-1 A PTT 5.875 10/15/27	社債	5.8750	150	151	19,693	2027/10/15
EVERARC ESCROW SARL 5.0 10/30/29	社債	5.0000	102	84	10,966	2029/10/30
DELTA AIR LINES/SKYMILES 4.5 10/20/25	社債	4.5000	60	60	7,855	2025/10/20
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.95 10/15/27	社債	2.9500	26	24	3,191	2027/10/15
EDP FINANCE BV 6.3 10/11/27	社債	6.3000	200	210	27,388	2027/10/11
CENTRAL JAPAN RAILWAY CO 2.2 10/02/24	社債	2.2000	200	191	24,899	2024/10/02
CARGILL INC 4.875 10/10/25	社債	4.8750	53	53	6,939	2025/10/10
GE HEALTHCARE HLDG LLC 6.377 11/22/52	社債	6.3770	100	115	15,025	2052/11/22
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.125 11/16/28	社債	4.1250	184	180	23,482	2028/11/16
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.4 11/14/34	社債	5.4000	91	90	11,802	2034/11/14
NETFLIX INC 5.875 11/15/28	社債	5.8750	109	113	14,779	2028/11/15
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 3.875 11/01/33	社債	3.8750	42	35	4,611	2033/11/01
BRITISH AIR 20-1 A PPT 4.25 11/15/32	社債	4.2500	68	62	8,169	2032/11/15
SUNCOR ENERGY INC 4.0 11/15/47	社債	4.0000	95	78	10,164	2047/11/15
WABTEC CORP 3.45 11/15/26	社債	3.4500	169	158	20,635	2026/11/15
NETFLIX INC 5.375 11/15/29	社債	5.3750	91	92	11,993	2029/11/15
OVINTIV INC 5.15 11/15/41	社債	5.1500	23	21	2,779	2041/11/15
MSCI INC 3.625 11/01/31	社債	3.6250	195	166	21,719	2031/11/01
BANK OF IRELAND GROUP 4.5 11/25/23	社債	4.5000	200	197	25,740	2023/11/25
SPRINT CAPITAL CORP 6.875 11/15/28	社債	6.8750	192	206	26,853	2028/11/15
OCEANEERING INTL INC 4.65 11/15/24	社債	4.6500	94	91	11,946	2024/11/15
CABLE ONE INC 4.0 11/15/30	社債	4.0000	25	20	2,672	2030/11/15
SCIENTIFIC GAMES INTERNA 7.25 11/15/29	社債	7.2500	27	27	3,517	2029/11/15
MOLINA HEALTHCARE INC 3.875 11/15/30	社債	3.8750	220	189	24,675	2030/11/15
BANKUNITED INC 4.875 11/17/25	社債	4.8750	120	119	15,495	2025/11/17
INGEVITY CORP 3.875 11/01/28	社債	3.8750	101	90	11,712	2028/11/01
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	社債	4.0000	400	349	45,452	2030/11/13
NVENT FINANCE SARL 2.75 11/15/31	社債	2.7500	42	34	4,461	2031/11/15
TRANSDIGM INC 5.5 11/15/27	社債	5.5000	260	247	32,210	2027/11/15
SVB FINANCIAL GROUP 11/15/26	社債	4.2500	136	109	14,200	2026/11/15
ABBVIE INC 3.2 11/21/29	社債	3.2000	80	74	9,654	2029/11/21
JETBLUE 2019-1 CLASS B 8.0 11/15/27	社債	8.0000	13	13	1,777	2027/11/15
NOVELIS CORP 3.25 11/15/26	社債	3.2500	95	86	11,255	2026/11/15
NEXSTAR MEDIA INC 4.75 11/01/28	社債	4.7500	50	44	5,841	2028/11/01
NATWEST GROUP PLC 11/10/26	社債	7.4720	200	210	27,448	2026/11/10
LOCKHEED MARTIN CORP 5.1 11/15/27	社債	5.1000	127	131	17,172	2027/11/15
COMCAST CORP 5.35 11/15/27	社債	5.3500	22	22	2,980	2027/11/15
AMERICAN ELECTRIC POWER 5.75 11/01/27	社債	5.7500	53	55	7,189	2027/11/01
AMERICAN EXPRESS CO 5.85 11/05/27	社債	5.8500	67	70	9,194	2027/11/05
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35 11/04/27	社債	7.3500	200	209	27,296	2027/11/04
PUBLIC SERVICE ENTERPRIS 5.85 11/15/27	社債	5.8500	60	62	8,190	2027/11/15
DISH NETWORK CORP 11.75 11/15/27	社債	11.7500	132	137	17,922	2027/11/15
ARCELORMITTAL SA 6.55 11/29/27	社債	6.5500	122	127	16,563	2027/11/29
LIVE NATION ENTERTAINMEN 4.875 11/01/24	社債	4.8750	110	107	13,980	2024/11/01
ZOETIS INC 5.4 11/14/25	社債	5.4000	20	20	2,659	2025/11/14
GLOBAL PAYMENTS INC 1.5 11/15/24	社債	1.5000	45	42	5,490	2024/11/15
UNITEDHEALTH GROUP INC 3.7 12/15/25	社債	3.7000	210	206	26,852	2025/12/15
BRITISH AIR 19-1 AA PTT 3.3 12/15/32	社債	3.3000	94	82	10,747	2032/12/15
ENTERGY ARKANSAS LLC 4.95 12/15/44	社債	4.9500	93	86	11,209	2044/12/15
ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.011 12/15/26	社債	4.0110	84	83	10,835	2026/12/15
VERIZON COMMUNICATIONS 12/03/29	社債	4.0160	142	136	17,714	2029/12/03
AMAZON.COM INC 5.2 12/03/25	社債	5.2000	205	209	27,224	2025/12/03
CF INDUSTRIES INC 4.5 12/01/26	社債	4.5000	86	84	11,057	2026/12/01
DIAMONDBACK ENERGY INC 3.5 12/01/29	社債	3.5000	110	99	13,004	2029/12/01
AUST & NZ BANKING GROUP 6.742 12/08/32	社債	6.7420	200	212	27,676	2032/12/08
CDW LLC/CDW FINANCE 3.569 12/01/31	社債	3.5690	47	39	5,203	2031/12/01

銘柄	当 期 末						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		
GO DADDY OPCO/FINCO 5.25 12/01/27	社 債 券	5.2500	114	110	14,334	2027/12/01	
NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD 7.75 12/15/25	社 債 券	7.7500	46	45	5,902	2025/12/15	
TRIMBLE INC 4.75 12/01/24	社 債 券	4.7500	181	179	23,376	2024/12/01	
MURPHY OIL CORP 5.875 12/01/27	社 債 券	5.8750	44	43	5,617	2027/12/01	
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	177	167	21,844	2029/12/15	
H&E EQUIPMENT SERVICES 3.875 12/15/28	社 債 券	3.8750	102	90	11,803	2028/12/15	
WMG ACQUISITION CORP 3.75 12/01/29	社 債 券	3.7500	147	129	16,853	2029/12/01	
VICI PROPERTIES / NOTE 4.625 12/01/29	社 債 券	4.6250	90	84	10,933	2029/12/01	
WARRIOR MET COAL INC 7.875 12/01/28	社 債 券	7.8750	89	88	11,488	2028/12/01	
BOYD GAMING CORP 4.75 12/01/27	社 債 券	4.7500	190	181	23,570	2027/12/01	
合 計	—	—	39,409	37,253	4,847,052	—	

■投資信託財産の構成

2023年1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)	917,460	15.3
公 社 債	4,847,052	81.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	218,050	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	5,982,563	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、5,853,596千円、97.8%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、2023年1月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.11円、1ユーロ=141.47円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月30日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,982,563,314円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	151,782,755
公 社 債(評価額)	5,764,513,210
未 収 入 金	4,049,398
未 収 利 息	58,774,888
前 払 費 用	3,443,063
(B) 負 債	100,620,968
未 払 金	100,620,968
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	5,881,942,346
元 本	1,030,743,969
次 期 繰 越 損 益 金	4,851,198,377
(D) 受 益 権 総 口 数	1,030,743,969口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D)	57,065円

(注1) 期首元本額 991,287,540円

追加設定元本額 50,670,853円

一部解約元本額 11,214,424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) 127,286,760円

MHAM USインカムオープンBコース(為替ヘッジなし) 241,977,572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) 661,479,637円

期末元本合計 1,030,743,969円

■損益の状況

当期 自2022年8月2日 至2023年1月30日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	118,699,165円
受 取 配 当 金	164,783
受 取 利 息	118,080,112
そ の 他 収 益 金	468,962
支 払 利 息	△14,692
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△290,461,897
売 買 益	110,807,930
売 買 損	△401,269,827
(C) そ の 他 費 用	△2,319,799
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△174,082,531
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,832,737,337
(F) 解 約 差 損 益 金	△57,785,576
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	250,329,147
(H) 合 計(D + E + F + G)	4,851,198,377
次 期 繰 越 損 益 金(H)	4,851,198,377

(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。

(注3) (G)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。