

高利回り社債オープン (毎月分配型)

運用報告書(全体版)

第236期(決算日2024年8月5日) 第237期(決算日2024年9月5日) 第238期(決算日2024年10月7日)
第239期(決算日2024年11月5日) 第240期(決算日2024年12月5日) 第241期(決算日2025年1月6日)

作成対象期間(2024年7月6日~2025年1月6日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●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 | 2004年11月12日以降、無期限とします。 | |
| 運用方針 | 中長期的に、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。主として米国ドル建ての高利回り事業債(ハイ・イールド・ボンド)に実質的な投資を行います。ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、投資対象の徹底したクレジット分析を行なうことにより、信用リスクのコントロールを行います。ポートフォリオによる分散投資によりリスクの低減を図ることを基本とします。実質組入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。 | |
| 主な投資対象 | 高利回り社債オープン | 高利回り社債オープン マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、債券に直接投資する場合があります。 |
| | 高利回り社債オープン マザーファンド | 米国ドル建ての高利回り事業債(ハイ・イールド・ボンド)を主要投資対象とします。なお、米国ドル建て以外のハイ・イールド・ボンドに投資する場合があります。 |
| 主な投資制限 | 高利回り社債オープン | 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| | 高利回り社債オープン マザーファンド | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。株式への投資は優先証券のうち株券等の性質を有するものまたは転換社債を転換したもの等に限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。 |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。 | |

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

●サポートダイヤル

0120-753104 (受付時間) 営業日の午前9時~午後5時

●ホームページ

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

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配率) | 基準価額 | | | 参考指数 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|------------------|---------------|---------|---------|----------|----------|------|--------|--------|--------|
| | | 税金 分 | 込み 配 | 期中 騰落 | 期中 騰落 | 中率 | | | |
| | 円 | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 | |
| 212期(2022年8月5日) | 6,278 | | 30 | 4.1 | 365.90 | 4.2 | 93.0 | — | 18,503 |
| 213期(2022年9月5日) | 6,377 | | 30 | 2.1 | 373.03 | 2.0 | 95.2 | — | 18,756 |
| 214期(2022年10月5日) | 6,360 | | 30 | 0.2 | 375.27 | 0.6 | 94.4 | — | 18,767 |
| 215期(2022年11月7日) | 6,460 | | 30 | 2.0 | 383.02 | 2.1 | 94.4 | — | 19,209 |
| 216期(2022年12月5日) | 6,138 | | 30 | △4.5 | 363.91 | △5.0 | 93.4 | — | 18,303 |
| 217期(2023年1月5日) | 5,961 | | 30 | △2.4 | 355.70 | △2.3 | 93.1 | — | 17,913 |
| 218期(2023年2月6日) | 6,179 | | 30 | 4.2 | 369.88 | 4.0 | 94.3 | — | 18,636 |
| 219期(2023年3月6日) | 6,183 | | 30 | 0.6 | 371.90 | 0.5 | 95.5 | — | 18,655 |
| 220期(2023年4月5日) | 6,018 | | 30 | △2.2 | 363.56 | △2.2 | 94.1 | — | 18,231 |
| 221期(2023年5月8日) | 6,161 | | 30 | 2.9 | 374.65 | 3.0 | 95.4 | — | 18,655 |
| 222期(2023年6月5日) | 6,373 | | 30 | 3.9 | 389.80 | 4.0 | 94.9 | — | 19,268 |
| 223期(2023年7月5日) | 6,587 | | 30 | 3.8 | 405.49 | 4.0 | 94.5 | — | 19,984 |
| 224期(2023年8月7日) | 6,472 | | 30 | △1.3 | 400.28 | △1.3 | 95.0 | — | 19,698 |
| 225期(2023年9月5日) | 6,720 | | 30 | 4.3 | 417.98 | 4.4 | 95.5 | — | 20,478 |
| 226期(2023年10月5日) | 6,595 | | 30 | △1.4 | 413.53 | △1.1 | 94.9 | — | 20,201 |
| 227期(2023年11月6日) | 6,725 | | 30 | 2.4 | 426.44 | 3.1 | 95.7 | — | 20,465 |
| 228期(2023年12月5日) | 6,744 | | 30 | 0.7 | 429.85 | 0.8 | 95.7 | — | 20,518 |
| 229期(2024年1月5日) | 6,759 | | 30 | 0.7 | 432.75 | 0.7 | 94.6 | — | 20,642 |
| 230期(2024年2月5日) | 6,969 | | 30 | 3.6 | 448.79 | 3.7 | 96.1 | — | 21,158 |
| 231期(2024年3月5日) | 7,056 | | 30 | 1.7 | 456.21 | 1.7 | 95.8 | — | 21,173 |
| 232期(2024年4月5日) | 7,079 | | 30 | 0.8 | 460.19 | 0.9 | 95.6 | — | 21,516 |
| 233期(2024年5月7日) | 7,224 | | 30 | 2.5 | 472.25 | 2.6 | 96.6 | — | 21,543 |
| 234期(2024年6月5日) | 7,277 | | 30 | 1.1 | 477.73 | 1.2 | 96.0 | — | 21,469 |
| 235期(2024年7月5日) | 7,548 | | 30 | 4.1 | 498.47 | 4.3 | 95.0 | — | 22,133 |
| 236期(2024年8月5日) | 6,892 | | 30 | △8.3 | 456.92 | △8.3 | 95.7 | — | 20,047 |
| 237期(2024年9月5日) | 6,915 | | 30 | 0.8 | 460.78 | 0.8 | 95.1 | — | 20,118 |
| 238期(2024年10月7日) | 7,203 | | 30 | 4.6 | 482.35 | 4.7 | 96.1 | — | 20,937 |
| 239期(2024年11月5日) | 7,305 | | 30 | 1.8 | 494.05 | 2.4 | 95.9 | — | 21,120 |
| 240期(2024年12月5日) | 7,278 | | 30 | 0.0 | 493.78 | △0.1 | 95.4 | — | 20,962 |
| 241期(2025年1月6日) | 7,551 | | 30 | 4.2 | 515.78 | 4.5 | 94.8 | — | 21,611 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*参考指数(=ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (円換算ベース))は、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (US\$ベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。

*参考指数は設定時を100として指数化しています。

(出所)ブルームバーグ、(出所および許可)ICE Data Indices, LLC

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基準 価 額 | | 参 考 指 数 | 債 券 債 券 | | |
|-------|---------------------|------------|--------|---------|---------|-----------|---------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | 組 入 比 率 | 先 物 比 率 | 先 物 比 率 |
| 第236期 | (期 首) 2024年7月5日 | 円 7,548 | % — | 498.47 | % — | % 95.0 | % — |
| | 7月末 | 7,253 | △3.9 | 479.52 | △3.8 | 95.6 | — |
| | (期 末) 2024年8月5日 | 6,922 | △8.3 | 456.92 | △8.3 | 95.7 | — |
| 第237期 | (期 首) 2024年8月5日 | 6,892 | — | 456.92 | — | 95.7 | — |
| | 8月末 | 6,993 | 1.5 | 463.83 | 1.5 | 94.7 | — |
| | (期 末) 2024年9月5日 | 6,945 | 0.8 | 460.78 | 0.8 | 95.1 | — |
| 第238期 | (期 首) 2024年9月5日 | 6,915 | — | 460.78 | — | 95.1 | — |
| | 9月末 | 6,973 | 0.8 | 464.50 | 0.8 | 95.4 | — |
| | (期 末) 2024年10月7日 | 7,233 | 4.6 | 482.35 | 4.7 | 96.1 | — |
| 第239期 | (期 首) 2024年10月7日 | 7,203 | — | 482.35 | — | 96.1 | — |
| | 10月末 | 7,398 | 2.7 | 498.16 | 3.3 | 96.3 | — |
| | (期 末) 2024年11月5日 | 7,335 | 1.8 | 494.05 | 2.4 | 95.9 | — |
| 第240期 | (期 首) 2024年11月5日 | 7,305 | — | 494.05 | — | 95.9 | — |
| | 11月末 | 7,298 | △0.1 | 492.89 | △0.2 | 94.9 | — |
| | (期 末) 2024年12月5日 | 7,308 | 0.0 | 493.78 | △0.1 | 95.4 | — |
| 第241期 | (期 首) 2024年12月5日 | 7,278 | — | 493.78 | — | 95.4 | — |
| | 12月末 | 7,573 | 4.1 | 514.97 | 4.3 | 95.0 | — |
| | (期 末) 2025年1月6日 | 7,581 | 4.2 | 515.78 | 4.5 | 94.8 | — |

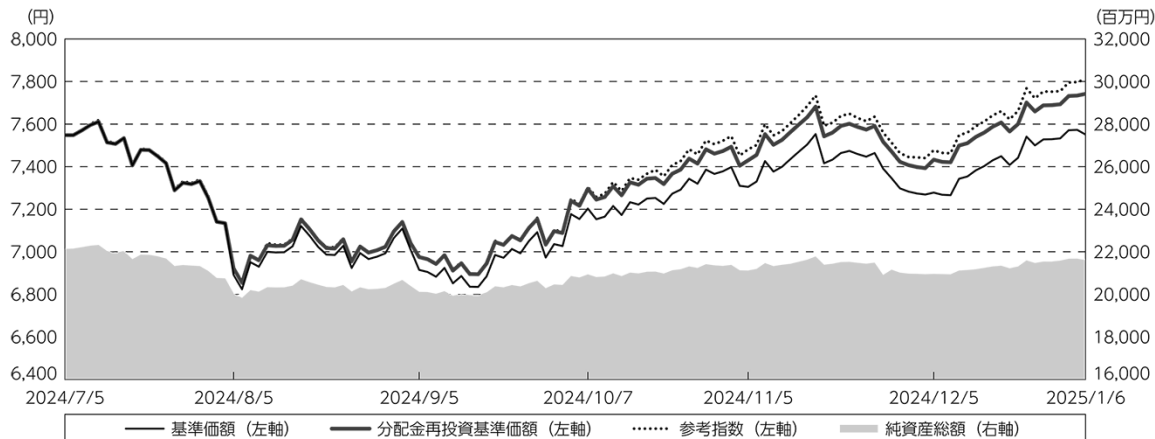
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第236期首：7,548円

第241期末：7,551円 (既払分配金(税込み)：180円)

騰落率：2.6% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に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。作成期首(2024年7月5日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (円換算ベース)です。参考指数は、作成期首(2024年7月5日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の7,548円から当作成期末には7,551円となりました。

- ・ハイ・イールド債券からの利息収入
- ・FRB(米連邦準備制度理事会)が利下げを開始したことなどからハイ・イールド債券の価格が上昇したこと
- ・米ドル/円の為替変動

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間では上昇しました（トータルリターン・現地通貨ベース）。米国内のインフレ率、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融政策などに左右されました。

為替市場は、FRB（米連邦準備制度理事会）が利下げを行なう一方で、日銀が利上げを行ない、日米の金利差が縮小したことで、当作成期間で、円高・ドル安となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[高利回り社債オープン]

主要投資対象である [高利回り社債オープン マザーファンド] の組み入れを高位に維持しました。なお、実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行ないませんでした。

[高利回り社債オープン マザーファンド]

・資産別組入比率

ハイ・イールド債券の組み入れについては、当作成期間を通じて高位を維持しました。

・信用格付け別組入比率

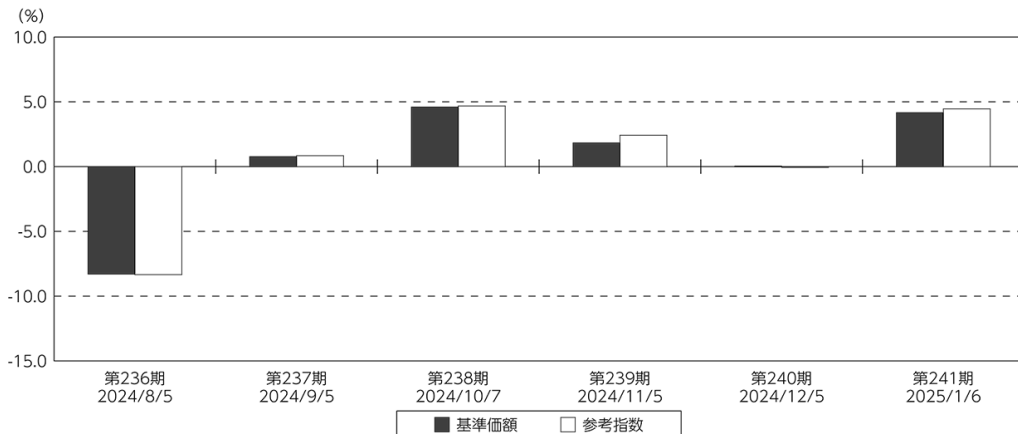
信用格付け別組入比率については、BBB格以上、BB格、B格、CCC格、CC格、C格以下及び無格付けの組入比率は、当作成期末には1.0%、32.2%、42.5%、17.5%、0.8%、2.7%としました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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。
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

当作成期間に、参考指数の騰落率が+3.5%となったのに対し、基準価額の騰落率[※]は+2.6%となりました。[高利回り社債オープン マザーファンド]において、保有していた一部の銘柄のパフォーマンスが軟調であったなどからパフォーマンスは対参考指数で下落となりました。
※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index（円換算ベース）です。

◎分配金

当作成期の収益分配金は、投資している債券から享受するインカムゲイン(利息収入)から、信託報酬等の経費を差し引いたものをベースに決定しました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第236期 | 第237期 | 第238期 | 第239期 | 第240期 | 第241期 |
|-----------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|
| | 2024年7月6日～ 2024年8月5日 | 2024年8月6日～ 2024年9月5日 | 2024年9月6日～ 2024年10月7日 | 2024年10月8日～ 2024年11月5日 | 2024年11月6日～ 2024年12月5日 | 2024年12月6日～ 2025年1月6日 |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| (対基準価額比率) | 0.433% | 0.432% | 0.415% | 0.409% | 0.411% | 0.396% |
| 当期の収益 | 29 | 30 | 30 | 30 | 28 | 30 |
| 当期の収益以外 | 0 | — | — | — | 1 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,215 | 2,220 | 2,228 | 2,235 | 2,233 | 2,246 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[高利回り社債オープン マザーファンド]

- ・当ファンドは、個別発行体の信用力を調査・分析するボトムアップ・アプローチに基づいて運用を行なって参ります。また、銘柄選択では多くの発行体に投資を行なう分散投資を基本とし、ハイ・イールド債券が持つ価格下落リスクをできる限り回避しながら、高水準のインカムゲイン（利息収入）やキャピタルゲイン（値上がり益）の獲得を目指す方針です。
- ・米国ハイ・イールド債券市場は、足もとは、FRB（米連邦準備制度理事会）が今後の利下げを慎重に進める姿勢を示していることや、トランプ次期米政権の関税強化によるインフレの再燃や財政拡張策への懸念などを背景に下落しました。今後はトランプ次期米大統領が掲げる減税や規制緩和などの政策が米景気を押し上げることが、市場の下支えになると考えています。引き続き、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融政策や新政権の政策により影響を受けるセクターなどを注視しながら、銘柄を選定して運用を行ないます。
- ・個別銘柄の選択に際しては、より一層慎重な対応を行なって参りますが、今後も引き続きキャッシュフロー（現金収支）が安定的な企業や良好な収益見通しが期待できる企業を中心に投資を行なう方針です。

[高利回り社債オープン]

主要投資対象である [高利回り社債オープン マザーファンド] の組み入れを高位に維持します。なお、実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年7月6日～2025年1月6日)

| 項 目 | 第236期～第241期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-------------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 69 | 0.948 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (38) | (0.530) | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 |
| （ 販 売 会 社 ） | (28) | (0.390) | 購入後の情報提供、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および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (2) | (0.028) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.000 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 2 | 0.026 | (d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (2) | (0.025) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.001) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 71 | 0.974 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,248円です。 | | | |

* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

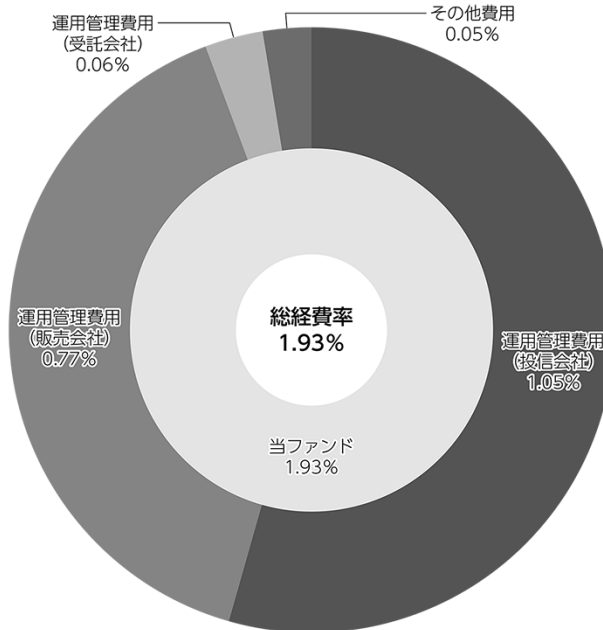
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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1.93%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 当ファンドのその他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託事務の処理に要するその他の諸費用等が含まれます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2024年7月6日～2025年1月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第236期～第241期 | | | |
|--------------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 高利回り社債オープン マザーファンド | 千口 106,622 | 千円 574,400 | 千口 332,196 | 千円 1,811,200 |

* 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2024年7月6日～2025年1月6日)

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236期～第241期 | |
|----------------------|--------------------|--|
| | 高利回り社債オープン マザーファンド | |
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 107,939千円 | |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 442,566千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.24 | |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2024年7月6日～2025年1月6日)

該当事項はございません。

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

(2025年1月6日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第235期末 | 第241期末 | |
|--------------------|-----------------|-----------------|------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 高利回り社債オープン マザーファンド | 千口 3,954,104 | 千口 3,728,530 | 千円 21,398,036 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2025年1月6日現在)

| 項 目 | 第241期末 | |
|--------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 高利回り社債オープン マザーファンド | 千円 21,398,036 | % 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 365,754 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 21,763,790 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*高利回り社債オープン マザーファンドにおいて、第241期末における外貨建純資産（43,715,048千円）の投資信託財産総額（44,159,637千円）に対する比率は99.0%です。

*外貨建資産は、第241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。1米ドル=157.73円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第236期末 | 第237期末 | 第238期末 | 第239期末 | 第240期末 | 第241期末 |
|-------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 2024年8月5日現在 | 2024年9月5日現在 | 2024年10月7日現在 | 2024年11月5日現在 | 2024年12月5日現在 | 2025年1月6日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 20,174,920,634 | 20,244,138,821 | 21,081,183,529 | 21,256,278,070 | 21,099,598,333 | 21,763,790,000 |
| コール・ローン等 | 215,990,922 | 249,466,787 | 198,610,257 | 226,798,978 | 233,811,197 | 250,551,803 |
| 高利回り社債オープン マザーファンド(評価額) | 19,833,628,324 | 19,906,270,414 | 20,731,271,981 | 20,903,477,618 | 20,764,385,615 | 21,398,036,568 |
| 未収入金 | 125,300,000 | 88,400,000 | 151,300,000 | 126,000,000 | 101,400,000 | 115,200,000 |
| 未収利息 | 1,388 | 1,620 | 1,291 | 1,474 | 1,521 | 1,629 |
| (B) 負債 | 127,853,166 | 125,994,128 | 143,922,440 | 135,457,057 | 137,366,754 | 151,843,857 |
| 未払収益分配金 | 87,258,824 | 87,278,390 | 87,205,258 | 86,732,844 | 86,411,811 | 85,867,149 |
| 未払解約金 | 6,202,026 | 6,429,553 | 23,476,518 | 17,438,303 | 18,199,877 | 30,947,489 |
| 未払信託報酬 | 34,351,909 | 32,248,257 | 33,201,615 | 31,249,153 | 32,716,588 | 34,988,066 |
| その他未払費用 | 40,407 | 37,928 | 39,049 | 36,757 | 38,478 | 41,153 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 20,047,067,468 | 20,118,144,693 | 20,937,261,089 | 21,120,821,013 | 20,962,231,579 | 21,611,946,143 |
| 元本 | 29,086,274,670 | 29,092,796,791 | 29,068,419,420 | 28,910,948,319 | 28,803,937,004 | 28,622,383,196 |
| 次期繰越損益金 | △ 9,039,207,202 | △ 8,974,652,098 | △ 8,131,158,331 | △ 7,790,127,306 | △ 7,841,705,425 | △ 7,010,437,053 |
| (D) 受益権総口数 | 29,086,274,670口 | 29,092,796,791口 | 29,068,419,420口 | 28,910,948,319口 | 28,803,937,004口 | 28,622,383,196口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 6,892円 | 6,915円 | 7,203円 | 7,305円 | 7,278円 | 7,551円 |

(注) 第236期首元本額は29,323,050,594円、第236～241期中追加設定元本額は1,518,375,100円、第236～241期中一部解約元本額は2,219,042,498円、1口当たり純資産額は、第236期0.6892円、第237期0.6915円、第238期0.7203円、第239期0.7305円、第240期0.7278円、第241期0.7551円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額124,694,872円。(高利回り社債オープンマザーファンド)

○損益の状況

| 項 目 | 第236期 | 第237期 | 第238期 | 第239期 | 第240期 | 第241期 |
|------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|
| | 2024年7月6日～ 2024年8月5日 | 2024年8月6日～ 2024年9月5日 | 2024年9月6日～ 2024年10月7日 | 2024年10月8日～ 2024年11月5日 | 2024年11月6日～ 2024年12月5日 | 2024年12月6日～ 2025年1月6日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 21,623 | 42,301 | 43,021 | 41,998 | 44,046 | 48,952 |
| 受取利息 | 21,623 | 42,301 | 43,021 | 41,998 | 44,046 | 48,952 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 1,784,369,253 | 182,811,097 | 956,501,376 | 414,316,697 | 33,087,682 | 900,300,920 |
| 売買益 | 5,363,036 | 184,512,442 | 958,326,614 | 417,057,185 | 43,850,013 | 904,318,207 |
| 売買損 | △ 1,789,732,289 | △ 1,701,345 | △ 1,825,238 | △ 2,740,488 | △ 10,762,331 | △ 4,017,287 |
| (C) 信託報酬等 | △ 34,392,316 | △ 32,286,185 | △ 33,240,664 | △ 31,285,910 | △ 32,755,066 | △ 35,029,219 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 1,818,739,946 | 150,567,213 | 923,303,733 | 383,072,785 | 376,662 | 865,320,653 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,920,606,502 | 1,006,927,952 | 1,060,519,647 | 1,878,786,134 | 2,118,413,891 | 2,009,229,588 |
| (F) 追加信託差損益金 | △10,053,814,934 | △10,044,868,873 | △10,027,776,453 | △ 9,965,253,381 | △ 9,874,084,167 | △ 9,799,120,145 |
| (配当等相当額) | (3,526,617,629) | (3,550,427,820) | (3,571,723,128) | (3,564,389,332) | (3,616,194,679) | (3,609,065,754) |
| (売買損益相当額) | (△13,580,432,563) | (△13,595,296,693) | (△13,599,499,581) | (△13,529,642,713) | (△13,490,278,846) | (△13,408,185,899) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 8,951,948,378 | △ 8,887,373,708 | △ 8,043,953,073 | △ 7,703,394,462 | △ 7,755,293,614 | △ 6,924,569,904 |
| (H) 収益分配金 | △ 87,258,824 | △ 87,278,390 | △ 87,205,258 | △ 86,732,844 | △ 86,411,811 | △ 85,867,149 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 9,039,207,202 | △ 8,974,652,098 | △ 8,131,158,331 | △ 7,790,127,306 | △ 7,841,705,425 | △ 7,010,437,053 |
| 追加信託差損益金 | △10,053,814,934 | △10,044,868,873 | △10,027,776,453 | △ 9,965,253,381 | △ 9,874,084,167 | △ 9,799,120,145 |
| (配当等相当額) | (3,526,895,672) | (3,550,774,466) | (3,572,156,077) | (3,564,569,384) | (3,617,539,195) | (3,609,376,390) |
| (売買損益相当額) | (△13,580,710,606) | (△13,595,643,339) | (△13,599,932,530) | (△13,529,822,765) | (△13,491,623,362) | (△13,408,496,535) |
| 分配準備積立金 | 2,917,854,405 | 2,909,498,984 | 2,907,225,741 | 2,897,721,611 | 2,816,562,207 | 2,819,974,272 |
| 繰越損益金 | △ 1,903,246,673 | △ 1,839,282,209 | △ 1,010,607,619 | △ 722,595,536 | △ 784,183,465 | △ 31,291,180 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(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。

* 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程(2024年7月6日～2025年1月6日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第236期 | 第237期 | 第238期 | 第239期 | 第240期 | 第241期 |
|------------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|
| | 2024年7月6日～ 2024年8月5日 | 2024年8月6日～ 2024年9月5日 | 2024年9月6日～ 2024年10月7日 | 2024年10月8日～ 2024年11月5日 | 2024年11月6日～ 2024年12月5日 | 2024年12月6日～ 2025年1月6日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 84,506,727円 | 101,008,824円 | 111,294,704円 | 104,562,429円 | 80,804,864円 | 121,360,357円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金相抵後) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 3,526,895,672円 | 3,550,774,466円 | 3,572,156,077円 | 3,564,569,384円 | 3,617,539,195円 | 3,609,376,390円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 2,920,606,502円 | 2,895,768,550円 | 2,883,136,295円 | 2,879,892,026円 | 2,822,169,154円 | 2,784,481,064円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 6,532,008,901円 | 6,547,551,840円 | 6,566,587,076円 | 6,549,023,839円 | 6,520,513,213円 | 6,515,217,811円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,245円 | 2,250円 | 2,258円 | 2,265円 | 2,263円 | 2,276円 |
| g. 分配金 | 87,258,824円 | 87,278,390円 | 87,205,258円 | 86,732,844円 | 86,411,811円 | 85,867,149円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

○分配金のお知らせ

| | 第236期 | 第237期 | 第238期 | 第239期 | 第240期 | 第241期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2025年1月6日現在）

<高利回り社債オープン マザーファンド>

下記は、高利回り社債オープン マザーファンド全体(7,660,802千口)の内容です。

外国株式

| 銘柄 | 株数 | 第241期末 | | | | 業種等 |
|--------------------------------------|---------|--------|-------|---------|--------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | 業種等 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| CLOUD PEAK ENERGY INC | 12 | 12 | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| DIEBOLD NIXDORF INC | 101 | 56 | 243 | 38,367 | コンピュータ・周辺機器 | |
| DIRECTBUY HOLDINGS INC | 48 | 48 | — | — | 専門小売り | |
| ENDO GUC TRUST-CL A | — | 808 | 26 | 4,114 | 医薬品 | |
| ENDO INC | 91 | 93 | 221 | 34,969 | 医薬品 | |
| EXXON MOBIL CORP | 5 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| GULFPORT ENERGY CORP | 24 | 18 | 338 | 53,322 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TALEN ENERGY CORP | 63 | 48 | 1,044 | 164,822 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| UC HOLDINGS INC | 430 | 430 | 172 | 27,145 | 自動車用部品 | |
| WARREN RESOURCES INC | 245 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| BRUIN BLOCKER LLC COM | 731 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG COMMON | 57 | 57 | 171 | 27,042 | 通信 | |
| CARNELIAN POINT HOLDINGS COM | 5 | 5 | 1 | 273 | 各種金融サービス | |
| TPC HOLDINGS INC COM | 23 | 23 | 83 | 13,205 | 公益 | |
| ENDO INC US29290D1090 | 1 | — | — | — | 医薬品 | |
| CURO GROUP HOLDINGS LLC COMMON SHS | — | 35 | 18 | 2,957 | 金融 | |
| CARNELIAN POINT HOLDINGS LP A1 B COM | — | 917 | 301 | 47,543 | 金融 | |
| MALLINCKRODT PLC | 3 | 3 | 26 | 4,174 | 医薬品 | |
| 合計 | 株数・金額 | 1,846 | 2,559 | 2,649 | 417,939 | |
| | 銘柄数<比率> | 15 | 14 | — | <1.0%> | |

* 邦貨換算金額は、第241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。

* 邦貨換算金額欄の< >内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国新株予約権証券

| 銘柄 | 第235期末 | | 第241期末 | | |
|--------------------------------|---------|-------|--------|--------|--------|
| | 証券数 | 証券数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 証券 | 証券 | 千米ドル | 千円 | |
| CURO GROUP HOLDINGS LLC WRT | — | 6,241 | — | — | |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG WARRANT | 8 | 8 | 0.0128 | 2 | |
| CHPPR HOLDINGS 1145 DOT WARR | 140 | 140 | 4 | 750 | |
| CHPPR HOLDINGS TRANCHE 2 WARR | 368 | 368 | — | — | |
| CHPPR HOLDINGS TRANCHE 1 WARR | 778 | 778 | — | — | |
| 合計 | 証券数・金額 | 1,294 | 7,535 | 4 | 752 |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 5 | — | <0.0%> |

*邦貨換算金額は、第241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。

*<>内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区分 | 第241期末 | | | | | | | |
|------|---------|---------|------------|------|-------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB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 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 295,480 | 266,823 | 42,086,014 | 95.7 | 94.1 | 43.2 | 49.2 | 3.3 |
| 合計 | 295,480 | 266,823 | 42,086,014 | 95.7 | 94.1 | 43.2 | 49.2 | 3.3 |

*邦貨換算金額は、第241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。

*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・レーティングスによる格付けを採用しています。なお、無格付けが1.5%あります。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 第241期末 | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1011778 BC / NEW RED FIN | 4.375 | 800 | 770 | 121,576 | 2028/1/15 |
| | 1011778 BC / NEW RED FIN | 4.0 | 800 | 720 | 113,692 | 2030/10/15 |
| | 1839688 ALBERTA ULC | — | 145 | — | — | 2023/2/13 |
| | AAR ESCROW ISSUER LLC | 6.75 | 150 | 152 | 24,111 | 2029/3/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 8.25 | 325 | 338 | 53,340 | 2029/2/1 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 4.25 | 500 | 471 | 74,390 | 2029/2/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 8.5 | 275 | 287 | 45,277 | 2029/6/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 7.5 | 375 | 387 | 61,138 | 2030/11/6 |
| | ACUSHNET CO | 7.375 | 100 | 103 | 16,325 | 2028/10/15 |
| | ADAMS HOMES INC | 9.25 | 1,050 | 1,092 | 172,352 | 2028/10/15 |
| | ADIANT GLOBAL HOLDINGS | 8.25 | 225 | 231 | 36,538 | 2031/4/15 |
| | ADT SEC CORP | 4.125 | 425 | 393 | 61,993 | 2029/8/1 |
| | AES CORP/THE | 7.6 | 175 | 179 | 28,363 | 2055/1/15 |
| | AES CORP/THE | 6.95 | 75 | 73 | 11,617 | 2055/7/15 |
| | AETHON UN/AETHIN UN FIN | 7.5 | 325 | 334 | 52,716 | 2029/10/1 |
| | AFFINITY GAMING | 6.875 | 525 | 394 | 62,187 | 2027/12/15 |
| | AIR CANADA | 3.875 | 300 | 292 | 46,082 | 2026/8/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 6.5 | 400 | 406 | 64,156 | 2028/2/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 3.5 | 250 | 228 | 36,052 | 2029/3/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 4.875 | 425 | 405 | 64,024 | 2030/2/15 |
| | ALCOA NEDERLAND HOLDING | 7.125 | 200 | 207 | 32,726 | 2031/3/15 |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 4.875 | 500 | 475 | 75,059 | 2029/10/1 |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 5.125 | 327 | 308 | 48,626 | 2031/10/1 |
| | ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR | 10.5 | 275 | 125 | 19,758 | 2028/2/15 |
| | ALLIANT HOLD / CO-ISSUER | 7.375 | 100 | 101 | 15,960 | 2032/10/1 |
| | ALLIED UNIVERSAL | 6.0 | 1,000 | 918 | 144,909 | 2029/6/1 |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 9.75 | 650 | 654 | 103,265 | 2027/7/15 |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 7.875 | 750 | 770 | 121,499 | 2031/2/15 |
| | ALLY FINANCIAL INC | 6.7 | 150 | 151 | 23,881 | 2033/2/14 |
| | ALPHA GENERATION LLC | 6.75 | 175 | 175 | 27,609 | 2032/10/15 |
| | ALTA EQUIPMENT GROUP | 9.0 | 150 | 143 | 22,597 | 2029/6/1 |
| | ALTAGAS LTD | 7.2 | 25 | 25 | 3,992 | 2054/10/15 |
| | ALTICE FINANCING SA | 9.625 | 200 | 185 | 29,180 | 2027/7/15 |
| | ALTICE FINANCING SA | 5.0 | 800 | 621 | 97,984 | 2028/1/15 |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 10.5 | 1,100 | 340 | 53,712 | 2027/5/15 |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 6.0 | 600 | 159 | 25,228 | 2028/2/15 |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.125 | 525 | 396 | 62,475 | 2029/7/15 |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.5 | 800 | 605 | 95,507 | 2029/10/15 |
| | AMC ENTERTAINMENT HOLDIN | 10.0 | 336 | 339 | 53,574 | 2026/6/15 |
| | AMC NETWORKS INC | 10.25 | 50 | 53 | 8,394 | 2029/1/15 |
| | AMC NETWORKS INC | 4.25 | 575 | 457 | 72,176 | 2029/2/15 |
| | AMENTUM ESCROW CORP | 7.25 | 300 | 304 | 47,978 | 2032/8/1 |
| | AMERICAN AIRLINES INC | 7.25 | 225 | 230 | 36,413 | 2028/2/15 |
| | AMERICAN AIRLINES INC | 8.5 | 450 | 473 | 74,748 | 2029/5/15 |
| | AMERICAN ELECTRIC POWER | 7.05 | 175 | 181 | 28,597 | 2054/12/15 |

| 銘柄 | 柄 | 第241期末 | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 普通社債券 (含む投資法人横断) | AMERICAN ELECTRIC POWER | 6.95 | 125 | 129 | 20,380 | 2054/12/15 |
| | AMERITEX HOLDCO INTERMED | 10.25 | 350 | 373 | 58,929 | 2028/10/15 |
| | AMN HEALTHCARE INC | 4.625 | 200 | 191 | 30,193 | 2027/10/1 |
| | AMN HEALTHCARE INC | 4.0 | 375 | 340 | 53,631 | 2029/4/15 |
| | AMWINS GROUP INC | 6.375 | 100 | 101 | 15,953 | 2029/2/15 |
| | ANTERO MIDSTREAM PART/FI | 6.625 | 225 | 227 | 35,942 | 2032/2/1 |
| | ANYWHERE REAL EST | 7.0 | 558 | 497 | 78,458 | 2030/4/15 |
| | APH/APH2/APH3/AQUARIAN | 7.875 | 700 | 711 | 112,295 | 2029/11/1 |
| | ARCOSA INC | 6.875 | 100 | 101 | 16,058 | 2032/8/15 |
| | ARD FINANCE SA | — | 1,681 | 243 | 38,457 | 2027/6/30 |
| | ARDAGH PKG FIN/HLDS USA | 5.25 | 400 | 228 | 36,037 | 2027/8/15 |
| | ARDAGH PKG FIN/HLDS USA | 5.25 | 400 | 228 | 36,037 | 2027/8/15 |
| | ARKO CORP | 5.125 | 150 | 136 | 21,606 | 2029/11/15 |
| | ARSENAL AIC PARENT LLC | 8.0 | 225 | 233 | 36,873 | 2030/10/1 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 9.0 | 352 | 428 | 67,654 | 2027/11/1 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 8.25 | 350 | 358 | 56,476 | 2028/12/31 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 6.625 | 125 | 124 | 19,673 | 2032/10/15 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 6.625 | 300 | 300 | 47,388 | 2028/1/15 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 250 | 229 | 36,271 | 2029/8/1 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 300 | 272 | 42,977 | 2030/4/1 |
| | ASSUREDPARTNERS INC | 5.625 | 225 | 227 | 35,940 | 2029/1/15 |
| | ASSUREDPARTNERS INC | 7.5 | 125 | 134 | 21,280 | 2032/2/15 |
| | ASTON MARTIN CAPITAL HOL | 10.0 | 200 | 196 | 30,945 | 2029/3/31 |
| | ATHENAHEALTH GROUP INC | 6.5 | 1,125 | 1,074 | 169,437 | 2030/2/15 |
| | ATI INC | 7.25 | 175 | 180 | 28,460 | 2030/8/15 |
| | ATLANTICA SUSTAIN INFRA | 4.125 | 325 | 306 | 48,357 | 2028/6/15 |
| | ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI | 4.625 | 400 | 378 | 59,705 | 2028/6/1 |
| | AUSTIN BIDCO INC | 7.125 | 625 | 598 | 94,336 | 2028/12/15 |
| | AVANTOR FUNDING INC | 3.875 | 900 | 823 | 129,861 | 2029/11/1 |
| | AVIENT CORP | 7.125 | 275 | 282 | 44,515 | 2030/8/1 |
| | AVIENT CORP | 6.25 | 725 | 719 | 113,564 | 2031/11/1 |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 4.75 | 625 | 588 | 92,873 | 2028/4/1 |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 8.0 | 275 | 283 | 44,650 | 2031/2/15 |
| | AZORRA FINANCE | 7.75 | 175 | 174 | 27,502 | 2030/4/15 |
| | B&G FOODS INC | 8.0 | 100 | 103 | 16,253 | 2028/9/15 |
| | BAFFINLAND IRON CORP/LP | 8.75 | 750 | 710 | 112,030 | 2026/7/15 |
| | BALDWIN INSUR GRP/FIN | 7.125 | 200 | 203 | 32,146 | 2031/5/15 |
| | BARCLAYS PLC | 8.0 | 200 | 207 | 32,722 | 2099/8/8 |
| | BARCLAYS PLC | 9.625 | 200 | 219 | 34,694 | 2099/11/22 |
| | BASIC ENERGY ESCROW | — | 200 | 3 | 473 | 2023/10/15 |
| | BAUSCH & LOMB ESCROW COR | 8.375 | 450 | 470 | 74,172 | 2028/10/1 |
| | BAUSCH HEALTH AMERICAS | 8.5 | 250 | 207 | 32,776 | 2027/1/31 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 6.125 | 300 | 273 | 43,184 | 2027/2/1 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 11.0 | 725 | 686 | 108,206 | 2028/9/30 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 6.25 | 75 | 47 | 7,497 | 2029/2/15 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 5.0 | 725 | 423 | 66,726 | 2029/2/15 |
| | BAYTEX ENERGY CORP | 8.5 | 775 | 798 | 125,876 | 2030/4/30 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人横断) | | | | | |
| | BCPE ULYSSES INTERMEDIAT | 7.75 | 275 | 273 | 43,212 | 2027/4/1 |
| | BEACON ROOFING SUPPLY IN | 6.5 | 775 | 788 | 124,340 | 2030/8/1 |
| | BEAZER HOMES USA | 7.25 | 425 | 431 | 68,102 | 2029/10/15 |
| | BEAZER HOMES USA | 7.5 | 100 | 101 | 16,017 | 2031/3/15 |
| | BELRON UK FINANCE PLC | 5.75 | 200 | 199 | 31,422 | 2029/10/15 |
| | BIG RIVER STEEL/BRS FIN | 6.625 | 230 | 231 | 36,459 | 2029/1/31 |
| | BLACKSTONE MORTGAGE TR | 7.75 | 75 | 77 | 12,200 | 2029/12/1 |
| | BLOCK INC | 6.5 | 475 | 481 | 76,003 | 2032/5/15 |
| | BLUE RACER MID LLC/FINAN | 7.0 | 100 | 102 | 16,150 | 2029/7/15 |
| | BLUE RACER MID LLC/FINAN | 7.25 | 50 | 51 | 8,075 | 2032/7/15 |
| | BOEING CO | 6.528 | 225 | 235 | 37,137 | 2034/5/1 |
| | BOEING CO | 6.858 | 375 | 396 | 62,588 | 2054/5/1 |
| | BOEING CO | 7.008 | 150 | 158 | 25,050 | 2064/5/1 |
| | BOMBARDIER INC | 6.0 | 850 | 848 | 133,816 | 2028/2/15 |
| | BOMBARDIER INC | 7.5 | 200 | 208 | 32,960 | 2029/2/1 |
| | BOMBARDIER INC | 8.75 | 175 | 188 | 29,801 | 2030/11/15 |
| | BOMBARDIER INC | 7.25 | 150 | 154 | 24,445 | 2031/7/1 |
| | BOMBARDIER INC | 7.0 | 200 | 204 | 32,227 | 2032/6/1 |
| | BORR IHC LTD / BORR FIN | 10.0 | 185 | 186 | 29,402 | 2028/11/15 |
| | BORR IHC LTD / BORR FIN | 10.375 | 190 | 191 | 30,146 | 2030/11/15 |
| | BOYD GAMING CORP | 4.75 | 700 | 651 | 102,705 | 2031/6/15 |
| | BRAND INDUSTRIAL SERVICE | 10.375 | 500 | 515 | 81,324 | 2030/8/1 |
| | BREAD FINANCIAL HLDGS | 9.75 | 225 | 242 | 38,235 | 2029/3/15 |
| | BRINK'S CO/THE | 6.5 | 225 | 228 | 36,033 | 2029/6/15 |
| | BRINK'S CO/THE | 6.75 | 300 | 303 | 47,835 | 2032/6/15 |
| | BRISTOW GROUP INC | 6.875 | 850 | 850 | 134,084 | 2028/3/1 |
| | BUCKEYE PARTNERS LP | 6.875 | 300 | 305 | 48,157 | 2029/7/1 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 5.0 | 400 | 382 | 60,364 | 2030/3/1 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 4.25 | 575 | 509 | 80,348 | 2032/2/1 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 6.375 | 550 | 550 | 86,863 | 2032/6/15 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 6.375 | 275 | 273 | 43,108 | 2034/3/1 |
| | CAESARS ENTERTAIN INC | 4.625 | 200 | 187 | 29,557 | 2029/10/15 |
| | CALDERYS FINANCING II | 11.75 | 200 | 203 | 32,124 | 2028/6/1 |
| | CALIFORNIA BUYER/ATLANTI | 6.375 | 300 | 298 | 47,122 | 2032/2/15 |
| | CALIFORNIA RESOURCES CRP | 8.25 | 575 | 586 | 92,500 | 2029/6/15 |
| | CALPINE CORP | 4.5 | 275 | 264 | 41,706 | 2028/2/15 |
| | CALPINE CORP | 4.625 | 300 | 283 | 44,717 | 2029/2/1 |
| | CALPINE CORP | 5.0 | 325 | 305 | 48,215 | 2031/2/1 |
| | CARNIVAL CORP | 5.75 | 2,250 | 2,251 | 355,118 | 2027/3/1 |
| | CARNIVAL CORP | 6.0 | 375 | 376 | 59,323 | 2029/5/1 |
| | CARNIVAL CORP | 10.5 | 200 | 214 | 33,791 | 2030/6/1 |
| | CARPENTER TECHNOLOGY | 6.375 | 300 | 301 | 47,602 | 2028/7/15 |
| | CASTLE US HOLDING CORP | 9.5 | 379 | 176 | 27,887 | 2028/2/15 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 525 | 472 | 74,566 | 2030/8/15 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 125 | 109 | 17,245 | 2031/2/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 7.375 | 100 | 102 | 16,127 | 2031/3/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.75 | 400 | 351 | 55,512 | 2032/2/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | 4.5 | 2,811 | 2,427 | 382,928 | 2032/5/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 275 | 232 | 36,615 | 2033/6/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 675 | 549 | 86,606 | 2034/1/15 |
| | CDI ESCROW ISSUER INC | 5.75 | 375 | 368 | 58,187 | 2030/4/1 |
| | CEMEX SAB DE CV | 5.125 | 200 | 196 | 30,929 | 2099/6/8 |
| | CHAMP ACQUISITION CORP | 8.375 | 75 | 76 | 12,123 | 2031/12/1 |
| | CHAMPIONS FINANCING INC | 8.75 | 150 | 147 | 23,223 | 2029/2/15 |
| | CHART INDUSTRIES INC | 7.5 | 325 | 338 | 53,442 | 2030/1/1 |
| | CHART INDUSTRIES INC | 9.5 | 400 | 429 | 67,798 | 2031/1/1 |
| | CHEMOURS CO | 5.375 | 50 | 48 | 7,604 | 2027/5/15 |
| | CHEMOURS CO | 5.75 | 725 | 675 | 106,614 | 2028/11/15 |
| | CHEMOURS CO | 8.0 | 150 | 147 | 23,187 | 2033/1/15 |
| | CHESAPEAKE ESCROW ISSUER | 5.875 | 150 | 149 | 23,520 | 2029/2/1 |
| | CHOBANI HOLDCO II LLC | — | 50 | 53 | 8,389 | 2029/10/1 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.625 | 525 | 506 | 79,935 | 2027/3/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.0 | 325 | 293 | 46,281 | 2029/1/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.875 | 525 | 401 | 63,277 | 2029/4/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.125 | 625 | 433 | 68,417 | 2030/4/1 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.25 | 575 | 478 | 75,439 | 2030/5/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 4.75 | 825 | 649 | 102,522 | 2031/2/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 10.875 | 575 | 593 | 93,658 | 2032/1/15 |
| | CIENA CORP | 4.0 | 600 | 553 | 87,264 | 2030/1/31 |
| | CIMPRESS PLC | 7.375 | 150 | 149 | 23,578 | 2032/9/15 |
| | CINEMARK USA INC | 7.0 | 150 | 153 | 24,186 | 2032/8/1 |
| | CITGO PETROLEUM CORP | 6.375 | 575 | 577 | 91,101 | 2026/6/15 |
| | CITGO PETROLEUM CORP | 8.375 | 325 | 336 | 53,115 | 2029/1/15 |
| | CITIGROUP INC | 4.7 | 625 | 624 | 98,511 | 2099/1/23 |
| | CITIGROUP INC | 4.0 | 325 | 318 | 50,167 | 2099/12/10 |
| | CIVITAS RESOURCES INC | 8.625 | 925 | 972 | 153,403 | 2030/11/1 |
| | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO | 7.5 | 1,150 | 1,018 | 160,634 | 2029/6/1 |
| | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO | 7.875 | 250 | 258 | 40,838 | 2030/4/1 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 4.75 | 346 | 332 | 52,473 | 2028/3/15 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 255 | 223 | 35,185 | 2031/2/15 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 150 | 128 | 20,270 | 2032/1/15 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 5.875 | 200 | 199 | 31,456 | 2027/6/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.625 | 275 | 256 | 40,491 | 2029/3/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 6.875 | 225 | 223 | 35,271 | 2029/11/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.875 | 200 | 180 | 28,548 | 2031/3/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 7.375 | 175 | 172 | 27,253 | 2033/5/1 |
| | CLOUD PEAK ENRGY | — | 1,400 | — | — | 2024/3/15 |
| | CLOUD SOFTWARE GRP INC | 9.0 | 900 | 916 | 144,505 | 2029/9/30 |
| | CLOUD SOFTWARE GRP INC | 8.25 | 600 | 622 | 98,132 | 2032/6/30 |
| | CLYDESDALE ACQUISITION | 6.625 | 50 | 50 | 7,952 | 2029/4/15 |
| | CLYDESDALE ACQUISITION | 6.875 | 75 | 75 | 11,943 | 2030/1/15 |
| | CLYDESDALE ACQUISITION | 8.75 | 225 | 230 | 36,280 | 2030/4/15 |
| | CNT PRNT/CDK GLO II/FIN | 8.0 | 100 | 102 | 16,097 | 2029/6/15 |
| | CNX RESOURCES CORP | 6.0 | 425 | 418 | 66,051 | 2029/1/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | COEUR MINING INC | 5.125 | 400 | 384 | 60,725 | 2029/2/15 |
| | COGENT COMMS GRP / FIN | 7.0 | 125 | 125 | 19,787 | 2027/6/15 |
| | COINBASE GLOBAL INC | 3.375 | 740 | 664 | 104,851 | 2028/10/1 |
| | COINBASE GLOBAL INC | 3.625 | 525 | 445 | 70,303 | 2031/10/1 |
| | COMMSCOPE INC | 4.75 | 350 | 313 | 49,476 | 2029/9/1 |
| | CONCENTRA ESCROW ISSUER | 6.875 | 275 | 279 | 44,152 | 2032/7/15 |
| | CONNECT FINCO SARL/CONNÉ | 9.0 | 200 | 181 | 28,568 | 2029/9/15 |
| | CONSTELLIUM SE | 6.375 | 250 | 242 | 38,236 | 2032/8/15 |
| | COTY/HFC PRESTIGE/INT US | 6.625 | 400 | 407 | 64,242 | 2030/7/15 |
| | CP ATLAS BUYER INC | 7.0 | 1,338 | 1,174 | 185,329 | 2028/12/1 |
| | CPI CG INC | 10.0 | 125 | 134 | 21,181 | 2029/7/15 |
| | CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN | 5.5 | 750 | 718 | 113,276 | 2031/6/15 |
| | CRESCENT ENERGY FINANCE | 7.625 | 375 | 374 | 59,046 | 2032/4/1 |
| | CRESCENT ENERGY FINANCE | 7.375 | 125 | 122 | 19,370 | 2033/1/15 |
| | CROCS INC | 4.25 | 475 | 440 | 69,426 | 2029/3/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 5.375 | 200 | 173 | 27,291 | 2028/2/1 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 11.25 | 200 | 197 | 31,122 | 2028/5/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 11.75 | 400 | 397 | 62,640 | 2029/1/31 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 5.75 | 750 | 431 | 68,037 | 2030/1/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 3.375 | 500 | 352 | 55,569 | 2031/2/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 4.5 | 600 | 432 | 68,228 | 2031/11/15 |
| | CUSHMAN & WAKEFIELD US | 8.875 | 100 | 108 | 17,041 | 2031/9/1 |
| | CVS HEALTH CORP | 6.75 | 75 | 73 | 11,610 | 2054/12/10 |
| | CVS HEALTH CORP | 7.0 | 125 | 125 | 19,865 | 2055/3/10 |
| | DARLING INGREDIENTS INC | 6.0 | 350 | 346 | 54,718 | 2030/6/15 |
| | DAVITA INC | 6.875 | 175 | 176 | 27,873 | 2032/9/1 |
| | DELEK LOG PART/FINANCE | 8.625 | 900 | 935 | 147,555 | 2029/3/15 |
| | DELUXE CORP | 8.125 | 100 | 102 | 16,092 | 2029/9/15 |
| | DIAMOND FRGN/DIAMOND FIN | 8.5 | 75 | 78 | 12,322 | 2030/10/1 |
| | DIEBOLD NIXDORF INC | 7.75 | 125 | 129 | 20,367 | 2030/3/31 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 263 | 13 | 2,081 | 2030/12/31 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 6 | 3 | 483 | 2030/12/31 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 752 | 7 | 1,186 | 2030/12/31 |
| | DIRECTV FINANCING LLC | 8.875 | 175 | 172 | 27,172 | 2030/2/1 |
| | DIRECTV HOLDINGS/FING | 5.875 | 950 | 931 | 146,915 | 2027/8/15 |
| | DISH DBS CORP | 7.75 | 275 | 233 | 36,757 | 2026/7/1 |
| | DISH DBS CORP | 5.25 | 925 | 847 | 133,696 | 2026/12/1 |
| | DISH DBS CORP | 7.375 | 400 | 291 | 45,972 | 2028/7/1 |
| | DISH DBS CORP | 5.125 | 975 | 632 | 99,735 | 2029/6/1 |
| | DISH NETWORK CORP | 11.75 | 350 | 371 | 58,603 | 2027/11/15 |
| | DORNOCH DEBT MERGER SUB | 6.625 | 1,475 | 1,209 | 190,774 | 2029/10/15 |
| | DREAM FINDERS HOMES INC | 8.25 | 175 | 182 | 28,810 | 2028/8/15 |
| | ECHOSTAR CORP | 10.75 | 550 | 593 | 93,637 | 2029/11/30 |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 5.5 | 625 | 611 | 96,479 | 2028/6/1 |
| | ELECTRICITE DE FRANCE SA | 9.125 | 200 | 225 | 35,631 | 2099/6/15 |
| | EMERALD DEBT MERGER | 6.625 | 675 | 677 | 106,850 | 2030/12/15 |
| | EMPIRE COMMUNITIES CORP | 9.75 | 225 | 236 | 37,353 | 2029/5/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|--------------------------|-------|-------|--------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | EMRLD BOR / EMRLD CO-ISS | 6.75 | 100 | 101 | 16,009 | 2031/7/15 |
| | | ENBRIDGE INC | 7.375 | 25 | 26 | 4,103 | 2055/3/15 |
| | | ENCINO ACQUISITION PARTN | 8.75 | 25 | 26 | 4,169 | 2031/5/1 |
| | | ENCORE CAPITAL GROUP INC | 9.25 | 200 | 213 | 33,739 | 2029/4/1 |
| | | ENCORE CAPITAL GROUP INC | 8.5 | 200 | 211 | 33,311 | 2030/5/15 |
| | | ENDO FINANCE HOLDINGS | 8.5 | 200 | 212 | 33,581 | 2031/4/15 |
| | | ENERFLEX LTD | 9.0 | 270 | 281 | 44,452 | 2027/10/15 |
| | | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.375 | 200 | 185 | 29,318 | 2028/3/30 |
| | | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.875 | 200 | 176 | 27,868 | 2031/3/30 |
| | | ENERGY TRANSFER LP | 8.0 | 50 | 52 | 8,282 | 2054/5/15 |
| | | ENERGY TRANSFER LP | 7.125 | 225 | 229 | 36,129 | 2054/10/1 |
| | | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.6 | 850 | 780 | 123,113 | 2044/4/1 |
| | | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.05 | 200 | 171 | 27,051 | 2045/4/1 |
| | | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.375 | 175 | 176 | 27,840 | 2029/4/1 |
| | | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 7.5 | 200 | 214 | 33,849 | 2030/6/1 |
| | | EQUIPMENTSHARE.COM INC | 8.625 | 625 | 656 | 103,549 | 2032/5/15 |
| | | EQUIPMENTSHARE.COM INC | 8.0 | 175 | 178 | 28,192 | 2033/3/15 |
| | | ESC GCB ENDO LUX | — | 400 | — | — | 2029/4/1 |
| | | ESC PAR PHARMAC | — | 361 | — | — | 2027/4/1 |
| | | EXELA INTERMED/EXELA FIN | 11.5 | 291 | 48 | 7,653 | 2026/4/15 |
| | | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.375 | 500 | 495 | 78,232 | 2026/4/1 |
| | | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.875 | 350 | 324 | 51,153 | 2029/4/1 |
| | | FERTITTA ENTERTAINMENT | 4.625 | 300 | 279 | 44,019 | 2029/1/15 |
| | | FIESTA PURCHASER INC | 7.875 | 25 | 26 | 4,143 | 2031/3/1 |
| | | FIESTA PURCHASER INC | 9.625 | 125 | 131 | 20,754 | 2032/9/15 |
| | | FIRSTCASH INC | 6.875 | 325 | 327 | 51,586 | 2032/3/1 |
| | | FLUTTER TREASURY DAC | 6.375 | 200 | 203 | 32,051 | 2029/4/29 |
| | | FMG RESOURCES AUG 2006 | 4.375 | 675 | 610 | 96,315 | 2031/4/1 |
| | | FMG RESOURCES AUG 2006 | 6.125 | 150 | 148 | 23,436 | 2032/4/15 |
| | | FOCUS FINANCIAL PARTNERS | 6.75 | 175 | 175 | 27,614 | 2031/9/15 |
| | | FORESTAR GROUP INC | 5.0 | 650 | 630 | 99,377 | 2028/3/1 |
| | | FORTREA HOLDINGS INC | 7.5 | 725 | 728 | 114,921 | 2030/7/1 |
| | | FORTRESS INTERMEDIATE | 7.5 | 75 | 76 | 12,100 | 2031/6/1 |
| | | FORTRESS TRANS & INFRAS | 5.5 | 450 | 442 | 69,823 | 2028/5/1 |
| | | FORTRESS TRANS & INFRAS | 7.875 | 50 | 52 | 8,343 | 2030/12/1 |
| | | FORTRESS TRANS & INFRAS | 7.0 | 200 | 205 | 32,404 | 2031/5/1 |
| | | FORTRESS TRANS & INFRAS | 7.0 | 325 | 334 | 52,818 | 2032/6/15 |
| | | FORTRESS TRANS & INFRAS | 5.875 | 325 | 317 | 50,103 | 2033/4/15 |
| | | FOUNDATION BUILDING M | 6.0 | 1,075 | 954 | 150,623 | 2029/3/1 |
| | | FOXTROT ESCROW ISSUER | 12.25 | 325 | 310 | 49,019 | 2026/11/15 |
| | | FREEDOM MORTGAGE | 6.625 | 525 | 526 | 82,968 | 2027/1/15 |
| | | FREEDOM MORTGAGE CORP | 12.0 | 375 | 407 | 64,345 | 2028/10/1 |
| | | FREEDOM MORTGAGE CORP | 12.25 | 375 | 416 | 65,681 | 2030/10/1 |
| | | FREEDOM MORTGAGE HOLD | 9.25 | 525 | 544 | 85,914 | 2029/2/1 |
| | | FREEDOM MORTGAGE HOLD | 9.125 | 400 | 412 | 65,136 | 2031/5/15 |
| | | FRONT RANGE BIDCO INC | 4.0 | 325 | 301 | 47,503 | 2027/3/1 |
| | | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.0 | 775 | 762 | 120,211 | 2028/5/1 |

| 銘柄 | 柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 | |
|------|--------------------------|--------------------------|-------|-------|---------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | FRONTIER COMMUNICATIONS | 6.75 | 450 | 452 | 71,366 | 2029/5/1 |
| | | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.875 | 274 | 273 | 43,103 | 2029/11/1 |
| | | GARDA WORLD SECURITY | 7.75 | 175 | 181 | 28,643 | 2028/2/15 |
| | | GARDA WORLD SECURITY | 8.25 | 150 | 152 | 24,124 | 2032/8/1 |
| | | GATES CORPORATION | 6.875 | 75 | 76 | 12,080 | 2029/7/1 |
| | | GENESEE & WYOMING INC | 6.25 | 400 | 403 | 63,645 | 2032/4/15 |
| | | GENESIS ENERGY LP/FIN | 7.75 | 350 | 352 | 55,566 | 2028/2/1 |
| | | GENESIS ENERGY LP/FIN | 8.875 | 350 | 357 | 56,439 | 2030/4/15 |
| | | GENESIS ENERGY LP/FIN | 7.875 | 250 | 247 | 39,000 | 2032/5/15 |
| | | GENESIS ENERGY LP/FIN | 8.0 | 200 | 197 | 31,098 | 2033/5/15 |
| | | GENON ESCROW CORP | — | 1,798 | — | — | 2022/10/15 |
| | | GEO GROUP INC/THE | 8.625 | 175 | 185 | 29,268 | 2029/4/15 |
| | | GEO GROUP INC/THE | 10.25 | 350 | 382 | 60,388 | 2031/4/15 |
| | | GFL ENVIRONMENTAL INC | 6.75 | 425 | 438 | 69,086 | 2031/1/15 |
| | | GGAM FINANCE LTD | 8.0 | 150 | 155 | 24,448 | 2027/2/15 |
| | | GGAM FINANCE LTD | 6.875 | 100 | 101 | 16,063 | 2029/4/15 |
| | | GGAM FINANCE LTD | 5.875 | 225 | 221 | 34,940 | 2030/3/15 |
| | | GLATFELTER | 4.75 | 425 | 379 | 59,823 | 2029/11/15 |
| | | GLOBAL AUTO HO/AAG FH UK | 11.5 | 200 | 203 | 32,043 | 2029/8/15 |
| | | GO DADDY OPCO/FINCO | 5.25 | 250 | 245 | 38,746 | 2027/12/1 |
| | | GOAT HOLDCO LLC | 6.75 | 125 | 124 | 19,643 | 2032/2/1 |
| | | GOEASY LTD | 9.25 | 125 | 133 | 21,001 | 2028/12/1 |
| | | GOEASY LTD | 7.625 | 425 | 435 | 68,679 | 2029/7/1 |
| | | GOEASY LTD | 6.875 | 225 | 227 | 35,831 | 2030/5/15 |
| | | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 5.25 | 325 | 292 | 46,115 | 2031/7/15 |
| | | GOTO GROUP INC | 5.5 | 339 | 289 | 45,660 | 2028/5/1 |
| | | GOTO GROUP INC | 5.5 | 468 | 192 | 30,325 | 2028/5/1 |
| | | GPS HOSPITALITY HOLDING | 7.0 | 575 | 357 | 56,351 | 2028/8/15 |
| | | GRAFTECH GLOBAL ENTERPRI | 9.875 | 825 | 776 | 122,482 | 2028/12/15 |
| | | GRAPHIC PACKAGING INTERN | 6.375 | 100 | 100 | 15,848 | 2032/7/15 |
| | | GRAY ESCROW II INC | 5.375 | 800 | 442 | 69,868 | 2031/11/15 |
| | | GREYSTAR REAL ESTATE PAR | 7.75 | 675 | 716 | 112,991 | 2030/9/1 |
| | | GRIFOLS SA | 4.75 | 275 | 252 | 39,895 | 2028/10/15 |
| | | GROUP 1 AUTOMOTIVE INC | 6.375 | 275 | 276 | 43,635 | 2030/1/15 |
| | | GTCR W-2 MERGER SUB LLC | 7.5 | 800 | 839 | 132,481 | 2031/1/15 |
| | | GULFPORT ENERGY CORP | 6.75 | 150 | 152 | 24,011 | 2029/9/1 |
| | | HAH GROUP HOLDING CO LLC | 9.75 | 75 | 75 | 11,982 | 2031/10/1 |
| | | HANESBRANDS INC | 9.0 | 400 | 428 | 67,568 | 2031/2/15 |
| | | HARVEST MIDSTREAM I LP | 7.5 | 350 | 354 | 55,898 | 2028/9/1 |
| | | HARVEST MIDSTREAM I LP | 7.5 | 200 | 204 | 32,278 | 2032/5/15 |
| | HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 3.75 | 1,039 | 918 | 144,871 | 2030/9/15 | |
| | HAWKER BEEHCRAFT ESCROW | — | 200 | — | — | 2017/4/1 | |
| | HELIX ENERGY SOLUTIONS | 9.75 | 400 | 427 | 67,479 | 2029/3/1 | |
| | HELLAS II | — | 1,700 | — | — | 2015/1/15 | |
| | HERC HOLDINGS INC | 6.625 | 175 | 177 | 28,061 | 2029/6/15 | |
| | HERTZ CORP/THE | 12.625 | 100 | 107 | 16,885 | 2029/7/15 | |
| | HESS MIDSTREAM OPERATION | 6.5 | 125 | 126 | 19,966 | 2029/6/1 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | |
|------|--------------------------|---------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | HESS MIDSTREAM OPERATION | 5.5 | 150 | 145 | 23,015 | 2030/10/15 |
| | HIGHTOWER HOLDING LLC | 9.125 | 125 | 132 | 20,882 | 2030/1/31 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.25 | 498 | 486 | 76,767 | 2028/11/1 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.25 | 250 | 233 | 36,768 | 2032/4/15 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 8.375 | 550 | 566 | 89,431 | 2033/11/1 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 7.25 | 275 | 261 | 41,232 | 2035/2/15 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 4.0 | 725 | 654 | 103,181 | 2031/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 3.625 | 300 | 261 | 41,311 | 2032/2/15 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 5.875 | 450 | 444 | 70,105 | 2033/3/15 |
| | HILTON GRAND VAC BOR ESC | 5.0 | 465 | 438 | 69,175 | 2029/6/1 |
| | HLF FIN SARL LLC/HERBALI | 4.875 | 675 | 485 | 76,632 | 2029/6/1 |
| | HOWARD MIDSTREAM ENERGY | 8.875 | 375 | 394 | 62,299 | 2028/7/15 |
| | HOWARD MIDSTREAM ENERGY | 7.375 | 350 | 357 | 56,440 | 2032/7/15 |
| | HOWDEN UK REFINANCE / US | 7.25 | 200 | 204 | 32,213 | 2031/2/15 |
| | HUB INTERNATIONAL LTD | 7.25 | 550 | 566 | 89,287 | 2030/6/15 |
| | HUB INTERNATIONAL LTD | 7.375 | 225 | 229 | 36,186 | 2032/1/31 |
| | HUDSON AUTOMOTIVE GROUP | 8.0 | 25 | 25 | 4,100 | 2032/5/15 |
| | HUSKY INJECTION / TITAN | 9.0 | 150 | 157 | 24,796 | 2029/2/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 6.25 | 339 | 335 | 52,984 | 2026/5/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 5.25 | 350 | 330 | 52,190 | 2027/5/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 9.75 | 175 | 175 | 27,735 | 2029/1/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 4.375 | 350 | 293 | 46,255 | 2029/2/1 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 10.0 | 125 | 125 | 19,784 | 2029/11/15 |
| | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 7.0 | 440 | 336 | 53,102 | 2031/1/15 |
| | IHO VERWALTUNGS GMBH | 6.375 | 550 | 532 | 83,923 | 2030/5/15 |
| | IHO VERWALTUNGS GMBH | 7.75 | 400 | 399 | 62,940 | 2030/11/15 |
| | IHO VERWALTUNGS GMBH | 8.0 | 400 | 399 | 63,001 | 2032/11/15 |
| | ILFC E-CAPITAL TRUST I | 6.14892 | 850 | 701 | 110,625 | 2065/12/21 |
| | ILIAD HOLDING SAS | 7.0 | 400 | 407 | 64,230 | 2028/10/15 |
| | ILIAD HOLDING SAS | 8.5 | 200 | 213 | 33,687 | 2031/4/15 |
| | ILIAD HOLDING SAS | 7.0 | 200 | 202 | 31,862 | 2032/4/15 |
| | IMOLA MERGER CORP | 4.75 | 600 | 571 | 90,082 | 2029/5/15 |
| | INEOS FINANCE PLC | 7.5 | 200 | 205 | 32,422 | 2029/4/15 |
| | INNOPHOS HOLDINGS INC | 9.375 | 1,275 | 1,274 | 200,983 | 2028/2/15 |
| | INSIGHT ENTERPRS | 6.625 | 100 | 100 | 15,926 | 2032/5/15 |
| | IRIS HOLDINGS INC | 8.75 | 325 | 325 | 51,278 | 2026/2/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 5.25 | 100 | 98 | 15,464 | 2028/3/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 7.0 | 300 | 307 | 48,531 | 2029/2/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 4.875 | 390 | 371 | 58,629 | 2029/9/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 5.625 | 550 | 528 | 83,390 | 2032/7/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 6.25 | 175 | 175 | 27,623 | 2033/1/15 |
| | IRON MOUNTAIN INFO MGMT | 5.0 | 575 | 532 | 84,003 | 2032/7/15 |
| | JACOBS ENTERTAINMENT INC | 6.75 | 250 | 240 | 37,998 | 2029/2/15 |
| | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 5.5 | 600 | 584 | 92,183 | 2029/7/15 |
| | JANE STREET GRP/JSG FIN | 6.125 | 275 | 273 | 43,134 | 2032/11/1 |
| | JB POINDEXTER & CO INC | 8.75 | 200 | 210 | 33,248 | 2031/12/15 |
| | JEFFERIES FIN LLC / JFIN | 5.0 | 325 | 306 | 48,330 | 2028/8/15 |

| 銘柄 | 柄 | 第241期末 | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | JEFFERIES FIN LLC / JFIN | 6.625 | 200 | 200 | 31,633 | 2031/10/15 |
| | JEFFERSON CAPITAL HOLDIN | 9.5 | 325 | 345 | 54,422 | 2029/2/15 |
| | JELD-WEN INC | 7.0 | 175 | 162 | 25,655 | 2032/9/1 |
| | JETBLUE AIRWAYS/LOYALTY | 9.875 | 275 | 293 | 46,217 | 2031/9/20 |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 4.6 | 375 | 374 | 59,124 | 2099/1/23 |
| | KAISER ALUMINUM CORP | 4.625 | 269 | 255 | 40,257 | 2028/3/1 |
| | KAISER ALUMINUM CORP | 4.5 | 750 | 665 | 105,020 | 2031/6/1 |
| | KB HOME | 4.8 | 350 | 330 | 52,139 | 2029/11/15 |
| | KB HOME | 7.25 | 150 | 154 | 24,307 | 2030/7/15 |
| | KB HOME | 4.0 | 350 | 309 | 48,804 | 2031/6/15 |
| | KEHE DIST/FIN / NEXTWAVE | 9.0 | 675 | 701 | 110,716 | 2029/2/15 |
| | KINETIK HOLDINGS LP | 5.875 | 325 | 321 | 50,672 | 2030/6/15 |
| | KNIFE RIVER HOLD CO | 7.75 | 375 | 391 | 61,717 | 2031/5/1 |
| | KRAKEN OIL & GAS PARTNER | 7.625 | 250 | 246 | 38,898 | 2029/8/15 |
| | KROGER CO | 5.65 | 75 | 70 | 11,043 | 2064/9/15 |
| | L BRANDS INC | 6.625 | 150 | 151 | 23,889 | 2030/10/1 |
| | L BRANDS INC | 6.75 | 950 | 965 | 152,344 | 2036/7/1 |
| | LABL INC | 5.875 | 300 | 268 | 42,389 | 2028/11/1 |
| | LABL INC | 9.5 | 50 | 50 | 7,910 | 2028/11/1 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 4.75 | 175 | 165 | 26,137 | 2029/6/15 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 7.0 | 150 | 154 | 24,330 | 2031/7/15 |
| | LAREDO PETROLEUM INC | 7.75 | 325 | 325 | 51,342 | 2029/7/31 |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 7.875 | 250 | 254 | 40,152 | 2030/4/15 |
| | LBM ACQUISITION LLC | 6.25 | 425 | 393 | 62,110 | 2029/1/15 |
| | LCM INVESTMENTS HOLDINGS | 8.25 | 200 | 207 | 32,767 | 2031/8/1 |
| | LD HOLDINGS GROUP LLC | 6.125 | 850 | 741 | 116,909 | 2028/4/1 |
| | LEEWARD RENEWABL | 4.25 | 625 | 574 | 90,564 | 2029/7/1 |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 4.25 | 900 | 805 | 127,051 | 2028/7/1 |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 3.75 | 1,400 | 1,098 | 173,230 | 2029/7/15 |
| | LGI HOMES INC | 8.75 | 275 | 288 | 45,438 | 2028/12/15 |
| | LGI HOMES INC | 4.0 | 595 | 532 | 83,913 | 2029/7/15 |
| | LGI HOMES INC | 7.0 | 100 | 99 | 15,620 | 2032/11/15 |
| | LIFE TIME INC | 6.0 | 650 | 644 | 101,675 | 2031/11/15 |
| | LIFEPOINT HEALTH INC | 9.875 | 175 | 189 | 29,878 | 2030/8/15 |
| | LIFEPOINT HEALTH INC | 11.0 | 275 | 302 | 47,692 | 2030/10/15 |
| | LIFEPOINT HEALTH INC | 10.0 | 400 | 407 | 64,234 | 2032/6/1 |
| | LIGHT & WONDER INTER | 7.5 | 125 | 128 | 20,305 | 2031/9/1 |
| | LIGHTNING POWER LLC | 7.25 | 300 | 310 | 48,947 | 2032/8/15 |
| | LINDBLAD EXPEDITIONS LLC | 6.75 | 150 | 150 | 23,816 | 2027/2/15 |
| | LITHIA MOTORS INC | 3.875 | 712 | 652 | 102,924 | 2029/6/1 |
| | MACQUARIE AIRFINANCE HLD | 8.375 | 150 | 157 | 24,836 | 2028/5/1 |
| | MACQUARIE AIRFINANCE HLD | 6.5 | 125 | 129 | 20,407 | 2031/3/26 |
| | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.875 | 75 | 72 | 11,376 | 2030/3/15 |
| | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.125 | 700 | 523 | 82,533 | 2042/1/15 |
| | MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN | 6.875 | 400 | 398 | 62,797 | 2032/12/1 |
| | MAJORDRIVE HOLDINGS IV L | 6.375 | 525 | 463 | 73,119 | 2029/6/1 |
| | MASTERBRAND INC | 7.0 | 100 | 101 | 15,941 | 2032/7/15 |

| 銘柄 | 柄 | 第241期末 | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | MATADOR RESOURCES CO | 6.875 | 375 | 382 | 60,288 | 2028/4/15 |
| | MATADOR RESOURCES CO | 6.5 | 75 | 74 | 11,778 | 2032/4/15 |
| | MATADOR RESOURCES CO | 6.25 | 250 | 245 | 38,796 | 2033/4/15 |
| | MATCH GROUP HLD II LLC | 3.625 | 420 | 358 | 56,618 | 2031/10/1 |
| | MATIV HOLDINGS INC | 8.0 | 125 | 121 | 19,152 | 2029/10/1 |
| | MATTAMY GROUP CORP | 4.625 | 525 | 489 | 77,235 | 2030/3/1 |
| | MATTHEWS INTERNATIONAL C | 8.625 | 275 | 286 | 45,194 | 2027/10/1 |
| | MAV ACQUISITION CORP | 8.0 | 525 | 528 | 83,360 | 2029/8/1 |
| | MCGRAW-HILL EDUCATION | 7.375 | 100 | 102 | 16,130 | 2031/9/1 |
| | MEDLINE BORROWER/MEDL CO | 6.25 | 175 | 177 | 27,984 | 2029/4/1 |
| | MELCO RESORTS FINANCE | 7.625 | 200 | 201 | 31,710 | 2032/4/17 |
| | MERISANT ESCROW | 12.25 | 600 | — | — | 2014/5/15 |
| | MERLIN ENTERTAINMENTS GR | 7.375 | 200 | 194 | 30,623 | 2031/2/15 |
| | METHANEX US OPERATIONS | 6.25 | 175 | 173 | 27,384 | 2032/3/15 |
| | METIS MERGER SUB LLC | 6.5 | 1,392 | 1,332 | 210,246 | 2029/5/15 |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 4.75 | 200 | 194 | 30,624 | 2027/2/1 |
| | MGM RESORTS INTL | 6.5 | 275 | 274 | 43,365 | 2032/4/15 |
| | MIDCONTINENT COMMUNICATI | 8.0 | 150 | 154 | 24,307 | 2032/8/15 |
| | MIDWEST VANADIUM PTY LTD | — | 139 | — | — | 2033/2/15 |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 9.25 | 225 | 236 | 37,224 | 2028/10/1 |
| | MITER BRAND / MIWD BORR | 6.75 | 225 | 226 | 35,802 | 2032/4/1 |
| | MOLINA HEALTHCARE INC | 3.875 | 1,125 | 978 | 154,325 | 2032/5/15 |
| | MOLINA HEALTHCARE INC | 6.25 | 125 | 123 | 19,553 | 2033/1/15 |
| | MOTION BONDCO DAC | 6.625 | 600 | 569 | 89,750 | 2027/11/15 |
| | MOZART DEBT MERGER SUB | 3.875 | 850 | 789 | 124,556 | 2029/4/1 |
| | MOZART DEBT MERGER SUB | 5.25 | 675 | 652 | 102,953 | 2029/10/1 |
| | MPH ACQUISITION HOLDINGS | 5.5 | 75 | 62 | 9,853 | 2028/9/1 |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 4.625 | 700 | 517 | 81,568 | 2029/8/1 |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 3.5 | 575 | 372 | 58,747 | 2031/3/15 |
| | MRT MID PART/MRT MID FIN | 11.5 | 375 | 409 | 64,573 | 2028/2/15 |
| | MURPHY OIL CORP | 6.0 | 250 | 240 | 37,863 | 2032/10/1 |
| | MURPHY OIL USA INC | 3.75 | 250 | 221 | 34,932 | 2031/2/15 |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 9.125 | 83 | 85 | 13,477 | 2030/1/31 |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 8.875 | 350 | 331 | 52,363 | 2031/8/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 6.0 | 225 | 224 | 35,393 | 2027/1/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.5 | 425 | 414 | 65,368 | 2028/8/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 6.5 | 475 | 475 | 75,004 | 2029/8/1 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.125 | 200 | 186 | 29,450 | 2030/12/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.75 | 150 | 143 | 22,600 | 2031/11/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 7.125 | 250 | 253 | 40,003 | 2032/2/1 |
| | NAVIENT CORP | 5.5 | 525 | 496 | 78,338 | 2029/3/15 |
| | NAVIENT CORP | 9.375 | 375 | 400 | 63,151 | 2030/7/25 |
| | NAVIENT CORP | 11.5 | 250 | 279 | 44,117 | 2031/3/15 |
| | NCL CORPORATION LTD | 5.875 | 1,100 | 1,100 | 173,529 | 2026/3/15 |
| | NCL CORPORATION LTD | 8.375 | 275 | 287 | 45,366 | 2028/2/1 |
| | NCL CORPORATION LTD | 8.125 | 175 | 184 | 29,170 | 2029/1/15 |
| | NCL FINANCE LTD | 6.125 | 350 | 351 | 55,415 | 2028/3/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | | |
|------|---------------------|---------------------------|-------|-------|---------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | NCR ATLEOS ESCROW CORP | 9.5 | 575 | 624 | 98,431 | 2029/4/1 |
| | | NCR CORP | 5.0 | 375 | 360 | 56,892 | 2028/10/1 |
| | | NEPTUNE BIDCO US INC | 9.29 | 825 | 768 | 121,203 | 2029/4/15 |
| | | NEW ENTERPRISE STONE & L | 9.75 | 675 | 695 | 109,639 | 2028/7/15 |
| | | NEW ENTERPRISE STONE & L | 5.25 | 425 | 411 | 64,963 | 2028/7/15 |
| | | NEW FORTRESS ENERGY INC | 8.75 | 75 | 65 | 10,311 | 2029/3/15 |
| | | NEW HOME CO INC/THE | 9.25 | 150 | 157 | 24,853 | 2029/10/1 |
| | | NEWELL BRANDS INC | 6.625 | 100 | 101 | 15,955 | 2032/5/15 |
| | | NEWS CORP | 3.875 | 300 | 278 | 43,993 | 2029/5/15 |
| | | NEWS CORP | 5.125 | 350 | 331 | 52,339 | 2032/2/15 |
| | | NEXTERA ENERGY OPERATING | 7.25 | 775 | 794 | 125,275 | 2029/1/15 |
| | | NFE FINANCING LLC | 12.0 | 350 | 370 | 58,408 | 2029/11/15 |
| | | NGL ENERGY PARTNERS LP | 8.125 | 225 | 228 | 36,115 | 2029/2/15 |
| | | NGL ENERGY PARTNERS LP | 8.375 | 275 | 279 | 44,107 | 2032/2/15 |
| | | NOBLE FINANCE II LLC | 8.0 | 400 | 405 | 63,936 | 2030/4/15 |
| | | NORTHERN OIL AND GAS INC | 8.75 | 200 | 208 | 32,871 | 2031/6/15 |
| | | NORTHRIVER MIDSTREAM FIN | 6.75 | 325 | 326 | 51,575 | 2032/7/15 |
| | | NORTHWEST ACQ/DOMINION | — | 475 | 0.57475 | 90 | 2022/11/1 |
| | | NORTONLIFELOCK INC | 6.75 | 525 | 533 | 84,097 | 2027/9/30 |
| | | NORTONLIFELOCK INC | 7.125 | 425 | 437 | 69,028 | 2030/9/30 |
| | | NOVA CHEMICALS CORP | 8.5 | 275 | 291 | 46,044 | 2028/11/15 |
| | | NOVA CHEMICALS CORP | 9.0 | 400 | 424 | 66,933 | 2030/2/15 |
| | | NOVA CHEMICALS CORP | 7.0 | 225 | 225 | 35,515 | 2031/12/1 |
| | | NOVELIS CORP | 4.75 | 800 | 743 | 117,338 | 2030/1/30 |
| | | NRG ENERGY INC | 5.25 | 450 | 438 | 69,165 | 2029/6/15 |
| | | NRG ENERGY INC | 5.75 | 375 | 370 | 58,445 | 2029/7/15 |
| | | NRG ENERGY INC | 6.0 | 225 | 219 | 34,577 | 2033/2/1 |
| | | NRG ENERGY INC | 7.0 | 250 | 269 | 42,506 | 2033/3/15 |
| | | NRG ENERGY INC | 6.25 | 175 | 172 | 27,203 | 2034/11/1 |
| | | NRG ENERGY INC | 10.25 | 250 | 277 | 43,830 | 2099/3/9 |
| | | NUSTAR LOGISTICS LP | 6.375 | 625 | 629 | 99,298 | 2030/10/1 |
| | | OCEANEERING INTL INC | 6.0 | 150 | 148 | 23,486 | 2028/2/1 |
| | | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 4.25 | 325 | 306 | 48,271 | 2028/10/1 |
| | | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 9.75 | 900 | 954 | 150,611 | 2028/11/15 |
| | | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 6.25 | 250 | 239 | 37,776 | 2029/10/1 |
| | | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 7.25 | 200 | 203 | 32,145 | 2031/6/15 |
| | | ONEMAIN FINANCE CORP | 9.0 | 400 | 424 | 67,024 | 2029/1/15 |
| | | ONEMAIN FINANCE CORP | 6.625 | 125 | 126 | 19,989 | 2029/5/15 |
| | | ONEMAIN FINANCE CORP | 7.875 | 575 | 601 | 94,887 | 2030/3/15 |
| | | ONEMAIN FINANCE CORP | 4.0 | 254 | 226 | 35,736 | 2030/9/15 |
| | | ONEMAIN FINANCE CORP | 7.5 | 300 | 309 | 48,869 | 2031/5/15 |
| | | ONEMAIN FINANCE CORP | 7.125 | 275 | 281 | 44,349 | 2031/11/15 |
| | | ONESKY FLIGHT LLC | 8.875 | 450 | 453 | 71,491 | 2029/12/15 |
| | | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 3.875 | 700 | 636 | 100,453 | 2029/12/1 |
| | | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 4.125 | 450 | 400 | 63,236 | 2031/12/1 |
| | | OPTICS BIDCO S P A | 6.0 | 867 | 837 | 132,058 | 2034/9/30 |
| | | ORGANON & CO./ORGANON FOR | 6.75 | 200 | 199 | 31,526 | 2034/5/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | |
|------|--------------------------|--------|------|-------|---------|------------|
| | | 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 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | ORGANON FINANCE 1 LLC | 5.125 | 400 | 360 | 56,877 | 2031/4/30 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 5.0 | 122 | 119 | 18,799 | 2027/8/15 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 4.25 | 450 | 419 | 66,178 | 2029/1/15 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 7.375 | 250 | 261 | 41,256 | 2031/2/15 |
| | OWENS-BROCKWAY | 6.625 | 550 | 549 | 86,661 | 2027/5/13 |
| | OWENS-BROCKWAY | 7.25 | 200 | 195 | 30,875 | 2031/5/15 |
| | OWENS-BROCKWAY | 7.375 | 50 | 48 | 7,598 | 2032/6/1 |
| | PANTHER ESCROW ISSUER | 7.125 | 350 | 355 | 56,060 | 2031/6/1 |
| | PARK INTERMED HOLDINGS | 7.0 | 150 | 152 | 24,061 | 2030/2/1 |
| | PARK RIVER HOLDINGS INC | 5.625 | 725 | 622 | 98,257 | 2029/2/1 |
| | PARK-OHIO INDUSTRIES INC | 6.625 | 371 | 365 | 57,671 | 2027/4/15 |
| | PARKLAND CORP/CANADA | 4.5 | 925 | 855 | 134,960 | 2029/10/1 |
| | PARKLAND CORP/CANADA | 4.625 | 475 | 437 | 69,027 | 2030/5/1 |
| | PATTERN ENERGY OP LP/PAT | 4.5 | 525 | 492 | 77,746 | 2028/8/15 |
| | PBF HOLDING CO LLC | 7.875 | 275 | 273 | 43,097 | 2030/9/15 |
| | PEBBLEBROOK HOTEL/FINANC | 6.375 | 100 | 98 | 15,611 | 2029/10/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 4.25 | 625 | 579 | 91,405 | 2029/2/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 7.875 | 150 | 157 | 24,804 | 2029/12/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 7.125 | 250 | 253 | 39,979 | 2030/11/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 5.75 | 150 | 142 | 22,502 | 2031/9/15 |
| | PERFORMANCE FOOD GROUP I | 6.125 | 225 | 225 | 35,537 | 2032/9/15 |
| | PERMIAN RESOURC OPTG LLC | 7.0 | 700 | 713 | 112,543 | 2032/1/15 |
| | PERRIGO FINANCE UNLIMITE | 6.125 | 100 | 98 | 15,504 | 2032/9/30 |
| | PG&E CORP | 5.0 | 150 | 147 | 23,193 | 2028/7/1 |
| | PG&E CORP | 5.25 | 462 | 451 | 71,283 | 2030/7/1 |
| | PG&E CORP | 7.375 | 100 | 102 | 16,235 | 2055/3/15 |
| | PHH ESCROW ISSUER LLC | 9.875 | 125 | 124 | 19,585 | 2029/11/1 |
| | PHINIA INC | 6.75 | 50 | 51 | 8,049 | 2029/4/15 |
| | PHINIA INC | 6.625 | 175 | 173 | 27,428 | 2032/10/15 |
| | PICARD MIDCO INC | 6.5 | 600 | 591 | 93,315 | 2029/3/31 |
| | PIKE CORP | 8.625 | 125 | 132 | 20,868 | 2031/1/31 |
| | PLANET FINANCIAL GROUP | 10.5 | 100 | 102 | 16,113 | 2029/12/15 |
| | PLAYTIKA HOLDING CORP | 4.25 | 750 | 684 | 107,947 | 2029/3/15 |
| | PM GENERAL PURCHASER LLC | 9.5 | 250 | 248 | 39,163 | 2028/10/1 |
| | POST HOLDINGS INC | 4.5 | 525 | 474 | 74,786 | 2031/9/15 |
| | POST HOLDINGS INC | 6.25 | 150 | 149 | 23,629 | 2032/2/15 |
| | POST HOLDINGS INC | 6.375 | 325 | 319 | 50,366 | 2033/3/1 |
| | POST HOLDINGS INC | 6.25 | 100 | 98 | 15,499 | 2034/10/15 |
| | PRA GROUP INC | 8.375 | 175 | 180 | 28,504 | 2028/2/1 |
| | PRA GROUP INC | 8.875 | 175 | 182 | 28,753 | 2030/1/31 |
| | PRAIRIE ACQUIROR LP | 9.0 | 200 | 207 | 32,684 | 2029/8/1 |
| | PRECISION DRILLING CORP | 7.125 | 186 | 186 | 29,422 | 2026/1/15 |
| | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.625 | 475 | 371 | 58,661 | 2029/9/1 |
| | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.875 | 475 | 347 | 54,757 | 2031/9/1 |
| | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 6.25 | 300 | 298 | 47,139 | 2028/1/15 |
| | PRIMO WATER HOLDINGS INC | 4.375 | 400 | 372 | 58,794 | 2029/4/30 |
| | QUICKEN LOANS LLC/QUICKN | 3.625 | 800 | 728 | 114,847 | 2029/3/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | RAIN CARBON INC | 12.25 | 725 | 770 | 121,560 | 2029/9/1 |
| | RAISING CANE'S RESTAURAN | 9.375 | 175 | 187 | 29,606 | 2029/5/1 |
| | RAKUTEN GROUP INC | 11.25 | 200 | 218 | 34,483 | 2027/2/15 |
| | RAKUTEN GROUP INC | 9.75 | 200 | 217 | 34,307 | 2029/4/15 |
| | RAKUTEN GROUP INC | 8.125 | 200 | 199 | 31,504 | 2099/12/13 |
| | RAND PARENT LLC | 8.5 | 325 | 328 | 51,881 | 2030/2/15 |
| | RAVEN ACQUISITION HOLDIN | 6.875 | 675 | 672 | 106,004 | 2031/11/15 |
| | REALOGY GROUP/CO-ISSUER | 5.75 | 975 | 789 | 124,508 | 2029/1/15 |
| | REALOGY GROUP/CO-ISSUER | 5.25 | 14 | 10 | 1,683 | 2030/4/15 |
| | RESIDEO FUNDING INC | 6.5 | 325 | 325 | 51,302 | 2032/7/15 |
| | RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN | 7.25 | 100 | 103 | 16,257 | 2028/7/15 |
| | RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN | 6.5 | 300 | 302 | 47,635 | 2032/4/1 |
| | RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 7.75 | 700 | 734 | 115,894 | 2031/3/15 |
| | RITHM CAPITAL CORP | 8.0 | 225 | 227 | 35,813 | 2029/4/1 |
| | ROCKET SOFTWARE INC | 9.0 | 425 | 440 | 69,454 | 2028/11/28 |
| | ROCKETMTGE CO-ISSUER INC | 4.0 | 775 | 647 | 102,173 | 2033/10/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 3.7 | 50 | 47 | 7,485 | 2028/3/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.5 | 775 | 773 | 121,928 | 2028/4/1 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.625 | 325 | 320 | 50,570 | 2031/9/30 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 6.25 | 175 | 177 | 27,962 | 2032/3/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 6.0 | 475 | 475 | 75,066 | 2033/2/1 |
| | RR DONNELLEY & SONS CO | 9.5 | 150 | 153 | 24,185 | 2029/8/1 |
| | RR DONNELLEY & SONS CO | 10.875 | 200 | 201 | 31,756 | 2029/8/1 |
| | RRD INTERMEDIATE HLDS | 11.0 | 250 | 231 | 36,467 | 2030/12/1 |
| | RYAN SPECIALTY | 5.875 | 250 | 248 | 39,139 | 2032/8/1 |
| | SABLE INTL FINANCE LTD | 7.125 | 200 | 197 | 31,213 | 2032/10/15 |
| | SAKS GLOBAL ENTERPRISES | 11.0 | 1,200 | 1,169 | 184,489 | 2029/12/15 |
| | SALLY HOLDINGS/SALLY CAP | 6.75 | 175 | 176 | 27,809 | 2032/3/1 |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 2,182 | 40 | 6,453 | 2021/6/15 |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 1,425 | 26 | 4,214 | 2023/1/15 |
| | SATURN OIL & GAS INC | 9.625 | 122 | 120 | 19,000 | 2029/6/15 |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.0 | 225 | 225 | 35,638 | 2028/5/15 |
| | SCIH SALT HOLDINGS INC | 6.625 | 1,210 | 1,162 | 183,432 | 2029/5/1 |
| | SCIL IV LLC / SCIL USA H | 5.375 | 700 | 687 | 108,372 | 2026/11/1 |
| | SEADRILL FINANCE LTD | 8.375 | 400 | 410 | 64,706 | 2030/8/1 |
| | SEALED AIR CORP | 6.125 | 75 | 75 | 11,913 | 2028/2/1 |
| | SEALED AIR CORP | 5.0 | 75 | 72 | 11,379 | 2029/4/15 |
| | SEALED AIR CORP | 6.5 | 125 | 125 | 19,834 | 2032/7/15 |
| | SEALED AIR/SEALED AIR US | 7.25 | 125 | 129 | 20,386 | 2031/2/15 |
| | SEASPAN CORP | 5.5 | 700 | 657 | 103,632 | 2029/8/1 |
| | SELECT MEDICAL CORP | 6.25 | 125 | 120 | 19,028 | 2032/12/1 |
| | SERVICE CORP INTL | 5.75 | 275 | 268 | 42,286 | 2032/10/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.25 | 181 | 176 | 27,792 | 2026/2/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.75 | 250 | 236 | 37,343 | 2026/10/1 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.5 | 200 | 188 | 29,730 | 2027/12/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.375 | 425 | 324 | 51,124 | 2030/2/15 |
| | SHEA HOMES LP/FNDG CP | 4.75 | 200 | 192 | 30,289 | 2028/2/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | SHELF DRILL HOLD LTD | 9.625 | 439 | 376 | 59,448 | 2029/4/15 |
| | SIGMA HOLDCO BV | 7.875 | 173 | 172 | 27,204 | 2026/5/15 |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 5.5 | 275 | 187 | 29,549 | 2030/3/1 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 4.0 | 1,200 | 1,112 | 175,431 | 2028/7/15 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 5.5 | 475 | 457 | 72,123 | 2029/7/1 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 3.875 | 75 | 63 | 9,981 | 2031/9/1 |
| | SM ENERGY CO | 6.75 | 175 | 174 | 27,452 | 2029/8/1 |
| | SM ENERGY CO | 7.0 | 175 | 173 | 27,383 | 2032/8/1 |
| | SMYRNA READY MIX CONCRET | 8.875 | 500 | 526 | 83,006 | 2031/11/15 |
| | SOTERA HEALTH HLDGS LLC | 7.375 | 275 | 279 | 44,127 | 2031/6/1 |
| | SOUTH BOW CAN INFRA HOLD | 7.625 | 125 | 128 | 20,231 | 2055/3/1 |
| | SPECIALTY BUILDING PRODU | 7.75 | 225 | 229 | 36,238 | 2029/10/15 |
| | SPECTRUM BRANDS INC | 3.875 | 60 | 51 | 8,189 | 2031/3/15 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 4.6 | 225 | 213 | 33,740 | 2028/6/15 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 9.375 | 275 | 295 | 46,644 | 2029/11/30 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 9.75 | 225 | 249 | 39,345 | 2030/11/15 |
| | SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP | 8.0 | 600 | 465 | 73,344 | 2025/9/20 |
| | SPRINGLEAF FINANCE CORP | 6.625 | 415 | 420 | 66,296 | 2028/1/15 |
| | SRM ESCROW ISSUER LLC | 6.0 | 425 | 416 | 65,753 | 2028/11/1 |
| | SS&C TECHNOLOGIES INC | 5.5 | 875 | 869 | 137,123 | 2027/9/30 |
| | SS&C TECHNOLOGIES INC | 6.5 | 400 | 404 | 63,840 | 2032/6/1 |
| | STANDARD INDUSTR INC/NJ | 6.5 | 700 | 704 | 111,055 | 2032/8/15 |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 5.0 | 100 | 98 | 15,514 | 2027/2/15 |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 4.375 | 775 | 709 | 111,978 | 2030/7/15 |
| | STAPLES INC | 10.75 | 375 | 370 | 58,410 | 2029/9/1 |
| | STAPLES INC | 12.75 | 615 | 484 | 76,366 | 2030/1/15 |
| | STAR HOLDING LLC | 8.75 | 150 | 149 | 23,629 | 2031/8/1 |
| | STAR PARENT INC | 9.0 | 625 | 653 | 103,096 | 2030/10/1 |
| | STARWOOD PROPERTY TRUST | 7.25 | 275 | 282 | 44,592 | 2029/4/1 |
| | STARWOOD PROPERTY TRUST | 6.0 | 325 | 320 | 50,487 | 2030/4/15 |
| | STARWOOD PROPERTY TRUST | 6.5 | 125 | 125 | 19,802 | 2030/7/1 |
| | STENA INTERNATIONAL SA | 7.25 | 200 | 205 | 32,349 | 2031/1/15 |
| | STENA INTERNATIONAL SA | 7.625 | 200 | 207 | 32,662 | 2031/2/15 |
| | STL HOLDING CO LLC | 8.75 | 200 | 212 | 33,476 | 2029/2/15 |
| | STUDIO CITY CO LTD | 7.0 | 200 | 202 | 31,870 | 2027/2/15 |
| | STUDIO CITY FINANCE LTD | 5.0 | 300 | 273 | 43,064 | 2029/1/15 |
| | SUMMIT MATERIALS LLC/FIN | 7.25 | 175 | 186 | 29,387 | 2031/1/15 |
| | SUMMIT MIDSTREAM HOLDING | 8.625 | 200 | 208 | 32,941 | 2029/10/31 |
| | SUNNOVA ENERGY CORP | 5.875 | 325 | 275 | 43,499 | 2026/9/1 |
| | SUNOCO LP | 7.0 | 125 | 128 | 20,318 | 2029/5/1 |
| | SUNOCO LP | 7.25 | 125 | 129 | 20,479 | 2032/5/1 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 6.0 | 425 | 426 | 67,329 | 2027/4/15 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 7.0 | 200 | 204 | 32,304 | 2028/9/15 |
| | SURGERY CENTER HOLDINGS | 7.25 | 225 | 230 | 36,282 | 2032/4/15 |
| | SYNCHRONY FINANCIAL | 7.25 | 425 | 437 | 69,030 | 2033/2/2 |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | 8.625 | 250 | 267 | 42,187 | 2030/6/1 |
| | TALLGRASS NRG PRTNR/FIN | 7.375 | 225 | 226 | 35,773 | 2029/2/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|--------------------------|-------|-------|--------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | TALLGRASS NRG PRTRN/FIN | 6.0 | 450 | 426 | 67,272 | 2031/9/1 |
| | | TALOS PRODUCTION INC | 9.0 | 200 | 208 | 32,829 | 2029/2/1 |
| | | TALOS PRODUCTION INC | 9.375 | 200 | 208 | 32,823 | 2031/2/1 |
| | | TEINE ENERGY LTD | 6.875 | 625 | 612 | 96,627 | 2029/4/15 |
| | | TELECOM ITALIA CAPITAL | 6.0 | 19 | 18 | 2,890 | 2034/9/30 |
| | | TELESAT CANADA/TELESAT L | 5.625 | 425 | 242 | 38,200 | 2026/12/6 |
| | | TELESAT CANADA/TELESAT L | 6.5 | 675 | 272 | 42,973 | 2027/10/15 |
| | | TENET HEALTHCARE CORP | 4.625 | 290 | 278 | 43,901 | 2028/6/15 |
| | | TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 1,050 | 1,049 | 165,546 | 2028/10/1 |
| | | TENET HEALTHCARE CORP | 4.375 | 625 | 582 | 91,851 | 2030/1/15 |
| | | TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 475 | 472 | 74,512 | 2030/6/15 |
| | | TENET HEALTHCARE CORP | 6.75 | 275 | 279 | 44,119 | 2031/5/15 |
| | | TENNECO INC | 8.0 | 325 | 303 | 47,850 | 2028/11/17 |
| | | TERRAFORM POWER OPERATIN | 4.75 | 1,100 | 1,023 | 161,493 | 2030/1/15 |
| | | TOPS HOLDING II ESCROW | — | 1,191 | — | — | 2022/6/15 |
| | | TRANSALTA CORP | 7.75 | 550 | 575 | 90,749 | 2029/11/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 5.5 | 800 | 788 | 124,395 | 2027/11/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.75 | 475 | 481 | 75,960 | 2028/8/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 4.625 | 900 | 846 | 133,539 | 2029/1/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.375 | 350 | 352 | 55,541 | 2029/3/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 4.875 | 550 | 521 | 82,313 | 2029/5/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 7.125 | 200 | 206 | 32,503 | 2031/12/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.625 | 200 | 202 | 31,992 | 2032/3/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.0 | 275 | 270 | 42,656 | 2033/1/15 |
| | | TRANSOCEAN AQUILA LTD | 8.0 | 136 | 139 | 21,984 | 2028/9/30 |
| | | TRANSOCEAN INC | 8.0 | 343 | 343 | 54,205 | 2027/2/1 |
| | | TRANSOCEAN INC | 8.75 | 148 | 154 | 24,387 | 2030/2/15 |
| | | TRANSOCEAN INC | 6.8 | 575 | 476 | 75,104 | 2038/3/15 |
| | | TRANSOCEAN INC | 9.35 | 425 | 382 | 60,354 | 2041/12/15 |
| | | TRANSOCEAN SEDCO FOREX | 7.5 | 375 | 347 | 54,749 | 2031/4/15 |
| | | TRANSOCEAN TITAN FIN LTD | 8.375 | 100 | 102 | 16,137 | 2028/2/1 |
| | | TRIDENT TPI HOLDINGS INC | 12.75 | 500 | 552 | 87,191 | 2028/12/31 |
| | | TRINITY INDUSTRIES INC | 7.75 | 450 | 467 | 73,689 | 2028/7/15 |
| | | TRINSEO OP / TRINSEO FIN | 5.125 | 175 | 111 | 17,542 | 2029/4/1 |
| | | TRIUMPH GROUP INC | 9.0 | 259 | 270 | 42,640 | 2028/3/15 |
| | | TRONOX INC | 4.625 | 675 | 607 | 95,800 | 2029/3/15 |
| | | UNICREDIT SPA | 5.459 | 400 | 386 | 60,926 | 2035/6/30 |
| | | UNITED AIRLINES INC | 4.625 | 350 | 333 | 52,561 | 2029/4/15 |
| | | UNITED RENTALS NORTH AM | 4.0 | 175 | 160 | 25,286 | 2030/7/15 |
| | | UNITED RENTALS NORTH AM | 3.875 | 100 | 89 | 14,137 | 2031/2/15 |
| | | UNITED RENTALS NORTH AM | 3.75 | 300 | 263 | 41,585 | 2032/1/15 |
| | | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.75 | 300 | 296 | 46,827 | 2027/6/15 |
| | | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.5 | 450 | 433 | 68,325 | 2029/4/15 |
| | | UNITI GROUP/CSL CAPITAL | 10.5 | 525 | 561 | 88,554 | 2028/2/15 |
| | | UNITI GRP/UNITI HLD/CSL | 6.0 | 325 | 287 | 45,318 | 2030/1/15 |
| | | UNIVISION COMMUNICATIONS | 8.0 | 225 | 229 | 36,218 | 2028/8/15 |
| | | UNIVISION COMMUNICATIONS | 4.5 | 350 | 314 | 49,612 | 2029/5/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------------|----------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人横断) | | | | | |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 7.375 | 350 | 336 | 53,097 | 2030/6/30 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 8.5 | 575 | 565 | 89,135 | 2031/7/31 |
| | UPC BROADBAND FINCO BV | 4.875 | 800 | 724 | 114,311 | 2031/7/15 |
| | UPC HOLDING BV | 5.5 | 400 | 393 | 62,044 | 2028/1/15 |
| | US ACUTE CARE SOLUTIONS | 9.75 | 450 | 461 | 72,725 | 2029/5/15 |
| | US FOODS INC | 4.75 | 275 | 265 | 41,844 | 2029/2/15 |
| | US FOODS INC | 7.25 | 150 | 155 | 24,539 | 2032/1/15 |
| | US FOODS INC | 5.75 | 100 | 97 | 15,370 | 2033/4/15 |
| | USA COM PART/USA COM FIN | 7.125 | 275 | 280 | 44,308 | 2029/3/15 |
| | USI INC/NY | 7.5 | 100 | 103 | 16,387 | 2032/1/15 |
| | UWM HOLDINGS LLC | 6.625 | 100 | 99 | 15,712 | 2030/2/1 |
| | VALARIS LTD | 8.375 | 600 | 611 | 96,396 | 2030/4/30 |
| | VALLOUREC SACA | 7.5 | 200 | 208 | 32,841 | 2032/4/15 |
| | VELOCITY VEHICLE GROUP | 8.0 | 100 | 104 | 16,416 | 2029/6/1 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 4.125 | 425 | 382 | 60,405 | 2031/8/15 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 8.125 | 675 | 703 | 110,923 | 2028/6/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 9.5 | 325 | 359 | 56,761 | 2029/2/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 7.0 | 50 | 50 | 8,035 | 2030/1/15 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 8.375 | 675 | 707 | 111,659 | 2031/6/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 9.875 | 525 | 578 | 91,177 | 2032/2/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 9.0 | 300 | 316 | 49,975 | 2099/9/30 |
| | VERMILION ENERGY INC | 6.875 | 350 | 349 | 55,142 | 2030/5/1 |
| | VFH PARENT / VALOR CO | 7.5 | 100 | 103 | 16,320 | 2031/6/15 |
| | VICTORS MERGER CORP | 6.375 | 300 | 190 | 29,983 | 2029/5/15 |
| | VICTRA HLDG/VICTRA FIN | 8.75 | 50 | 52 | 8,269 | 2029/9/15 |
| | VIKING BAKED GOODS ACQUI | 8.625 | 225 | 221 | 34,995 | 2031/11/1 |
| | VIKING CRUISES LTD | 9.125 | 525 | 567 | 89,451 | 2031/7/15 |
| | VIKING OCEAN CRUISES SHI | 5.625 | 225 | 222 | 35,030 | 2029/2/15 |
| | VIPER ENERGY PARTNERS LP | 5.375 | 700 | 693 | 109,442 | 2027/11/1 |
| | VIRGIN AUSTRALIA HOLDING | — | 209 | 0.60329 | 95 | 2034/11/15 |
| | VISTAJET MALTA/VM HOLDS | 9.5 | 250 | 251 | 39,618 | 2028/6/1 |
| | VISTAJET MALTA/XO MGMT | 7.875 | 325 | 317 | 50,069 | 2027/5/1 |
| | VISTAJET MALTA/XO MGMT | 6.375 | 575 | 508 | 80,170 | 2030/2/1 |
| | VISTRA CORP | 7.0 | 850 | 856 | 135,075 | 2099/12/10 |
| | VISTRA OPERATIONS CO LLC | 7.75 | 1,000 | 1,053 | 166,229 | 2031/10/15 |
| | VISTRA OPERATIONS CO LLC | 6.875 | 475 | 489 | 77,167 | 2032/4/15 |
| | VITAL ENERGY INC | 7.875 | 225 | 219 | 34,677 | 2032/4/15 |
| | VMED O2 UK FINAN | 4.75 | 200 | 173 | 27,383 | 2031/7/15 |
| | VMED O2 UK FINANCING I | 4.25 | 600 | 515 | 81,331 | 2031/1/31 |
| | VORTEX OPCO LLC | 8.0 | 141 | 52 | 8,233 | 2030/4/30 |
| | VORTEX OPCO LLC | 10.56044 | 32 | 33 | 5,263 | 2030/4/30 |
| | WASH MULTIFAM ACQ INC | 5.75 | 475 | 473 | 74,670 | 2026/4/15 |
| | WATCO COS LLC/FINANCE CO | 7.125 | 300 | 310 | 48,974 | 2032/8/1 |
| | WAYFAIR LLC | 7.25 | 50 | 50 | 7,963 | 2029/10/31 |
| | WEATHERFORD INTERNATIONAL | 8.625 | 1,475 | 1,528 | 241,164 | 2030/4/30 |
| | WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN | 4.875 | 600 | 575 | 90,709 | 2028/9/15 |
| | WERNER FINCO LP/INC | 11.5 | 225 | 250 | 39,461 | 2028/6/15 |

| 銘 | 柄 | 第241期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | WERNER FINCO LP/INC | 8.75 | 1,103 | 1,113 | 175,584 | 2028/10/15 |
| | WHITE CAP BUYER LLC | 6.875 | 550 | 547 | 86,301 | 2028/10/15 |
| | WILDFIRE INTERMEDIATE HO | 7.5 | 100 | 97 | 15,390 | 2029/10/15 |
| | WILLIAMS SCOTSMAN INC | 6.625 | 100 | 101 | 16,047 | 2029/6/15 |
| | WILSONART LLC | 11.0 | 200 | 197 | 31,162 | 2032/8/15 |
| | WINDSOR HOLDINGS III LLC | 8.5 | 200 | 211 | 33,424 | 2030/6/15 |
| | WINDSTREAM ESCROW LLC | 8.25 | 225 | 233 | 36,777 | 2031/10/1 |
| | WORLD ACCEPTANCE CORP | 7.0 | 625 | 621 | 98,049 | 2026/11/1 |
| | WR GRACE HOLDING LLC | 5.625 | 1,075 | 994 | 156,892 | 2029/8/15 |
| | WR GRACE HOLDING LLC | 7.375 | 150 | 154 | 24,351 | 2031/3/1 |
| | WYNN MACAU LTD | 5.625 | 350 | 337 | 53,263 | 2028/8/26 |
| | WYNN MACAU LTD | 5.125 | 875 | 813 | 128,308 | 2029/12/15 |
| | WYNN RESORTS FINANCE LLC | 5.125 | 150 | 144 | 22,722 | 2029/10/1 |
| | WYNN RESORTS FINANCE LLC | 7.125 | 225 | 234 | 36,974 | 2031/2/15 |
| | WYNN RESORTS FINANCE LLC | 6.25 | 325 | 320 | 50,529 | 2033/3/15 |
| | XHR LP | 6.625 | 100 | 100 | 15,864 | 2030/5/15 |
| | XPO INC | 7.125 | 125 | 128 | 20,281 | 2031/6/1 |
| | XPO INC | 7.125 | 175 | 180 | 28,430 | 2032/2/1 |
| | YUM! BRANDS INC | 5.375 | 425 | 413 | 65,245 | 2032/4/1 |
| | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | 6.5 | 150 | 152 | 24,058 | 2032/6/1 |
| | ZEGONA FINANCE PLC | 8.625 | 200 | 212 | 33,559 | 2029/7/15 |
| | ZF NA CAPITAL | 7.125 | 150 | 147 | 23,229 | 2030/4/14 |
| | ZF NA CAPITAL | 6.75 | 300 | 288 | 45,472 | 2030/4/23 |
| | ZF NA CAPITAL | 6.875 | 300 | 284 | 44,808 | 2032/4/23 |
| | ZIGGO BOND CO BV | 5.125 | 200 | 179 | 28,360 | 2030/2/28 |
| | ZIGGO BV | 4.875 | 200 | 183 | 29,018 | 2030/1/15 |
| 合 | 計 | | | | 42,086,014 | |

*邦貨換算金額は、第241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。

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

高利回り社債オープン マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日2024年7月5日）

作成対象期間（2023年7月6日～2024年7月5日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 主として米国ドル建ての高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）に投資し、中長期的に、高水準のインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得を目指します。 ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、投資対象の徹底したクレジット分析を行なうことにより、信用リスクのコントロールを行ないます。 外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行ないません。 |
| 主な投資対象 | 米国ドル建ての高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）を主要投資対象とします。 なお、米国ドル建て以外のハイ・イールド・ボンドに投資する場合があります。 |
| 主な投資制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は優先証券のうち株券等の性質を有するものまたは転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。 |

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 参考指数 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|----------------|--------|-------|-----------|-------|-------|--------|---------------|
| | 円 | 騰落率 | 2023年7月5日 | 騰落率 | | | |
| 16期(2020年7月6日) | 29,200 | △ 2.0 | 276.80 | △ 0.8 | 96.6 | — | 百万円 47,631 |
| 17期(2021年7月5日) | 35,944 | 23.1 | 327.84 | 18.4 | 96.0 | — | 48,045 |
| 18期(2022年7月5日) | 38,280 | 6.5 | 351.26 | 7.1 | 95.7 | — | 40,557 |
| 19期(2023年7月5日) | 45,000 | 17.6 | 405.49 | 15.4 | 95.5 | — | 43,047 |
| 20期(2024年7月5日) | 55,432 | 23.2 | 498.47 | 22.9 | 96.0 | — | 45,153 |

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*参考指数(=ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (円換算ベース))は、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (US\$ベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。

*参考指数は設定時を100として指数化しています。

(出所) ブルームバーグ、(出所および許可) ICE Data Indices, LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 参考指数 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|-------------------|--------|-------|-----------|-------|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | 2023年7月5日 | 騰落率 | | |
| (期首) 2023年7月5日 | 45,000 | — | 405.49 | — | 95.5 | — |
| 7月末 | 44,413 | △ 1.3 | 399.82 | △ 1.4 | 95.7 | — |
| 8月末 | 46,296 | 2.9 | 416.34 | 2.7 | 95.7 | — |
| 9月末 | 46,640 | 3.6 | 420.26 | 3.6 | 96.4 | — |
| 10月末 | 45,781 | 1.7 | 414.79 | 2.3 | 95.9 | — |
| 11月末 | 47,290 | 5.1 | 428.15 | 5.6 | 96.3 | — |
| 12月末 | 47,375 | 5.3 | 427.94 | 5.5 | 95.2 | — |
| 2024年1月末 | 49,341 | 9.6 | 445.49 | 9.9 | 96.4 | — |
| 2月末 | 50,525 | 12.3 | 455.34 | 12.3 | 96.7 | — |
| 3月末 | 51,437 | 14.3 | 463.31 | 14.3 | 96.5 | — |
| 4月末 | 52,849 | 17.4 | 476.27 | 17.5 | 95.2 | — |
| 5月末 | 53,311 | 18.5 | 479.24 | 18.2 | 96.7 | — |
| 6月末 | 55,341 | 23.0 | 497.82 | 22.8 | 96.4 | — |
| (期末) 2024年7月5日 | 55,432 | 23.2 | 498.47 | 22.9 | 96.0 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) 参考指数は、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (円換算ベース)です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の45,000円から当作成期末には55,432円となりました。

- ・ハイ・イールド債券からの利息収入
- ・発行体企業の企業業績、インフレ動向、金融政策などによるハイ・イールド債券の価格変動
- ・米ドル/円の為替変動

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間で上昇となりました(トータルリターン・現地通貨ベース)。米国のインフレ指標の鈍化を背景にFRB(米連邦準備制度理事会)による早期利下げ期待が高まり、米国ハイ・イールド債券市場は上昇となりました。

為替市場は、日銀が国債買い入れの減額方針を決定したものの、具体策公表は先送りしたことなどから、日米の金利差が意識され、当作成期間で、ドル高・円安となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・資産別組入比率

ハイ・イールド債券の組み入れについては、当作成期間を通じて高位を維持しました。

・信用格付け別組入比率

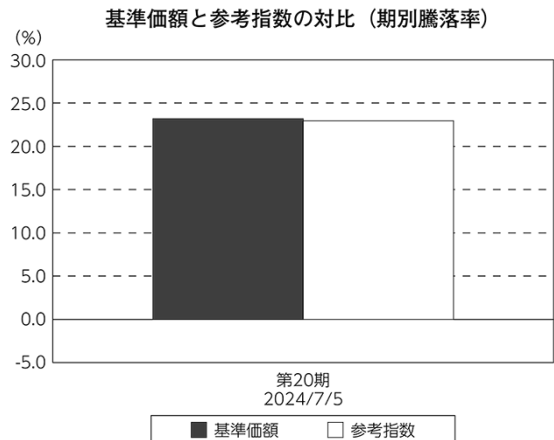
信用格付け別組入比率については、BBB格以上、BB格、B格、CCC格、CC格、C格以下及び無格付けの組入比率は、当作成期末には1.1%、31.7%、44.3%、17.0%、0.9%、2.1%としました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

当作成期間に、参考指数の騰落率が+22.9%となったのに対し、基準価額の騰落率は+23.2%となりました。主な差異の要因は、保有していた一部の銘柄のパフォーマンスが堅調であったことが、プラスに作用したことなどです。



(注) 参考指数は、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, Constrained Index (円換算ベース) です。

◎今後の運用方針

- ・当ファンドは、個別発行体の信用力を調査・分析するボトムアップ・アプローチに基づいて運用を行なっております。また、銘柄選択では多くの発行体に投資を行なう分散投資を基本とし、ハイ・イールド債券が持つ価格下落リスクをできる限り回避しながら、高水準のインカムゲイン（利息収入）やキャピタルゲイン（値上がり益）の獲得を目指す方針です。
- ・米国ハイ・イールド債券市場は、足もとは米国のインフレ鈍化を示す経済指標や軟調な経済指標の発表を受けて、FRB（米連邦準備制度理事会）が早期に利下げを行なうとの期待感から堅調に推移しております。高インフレの中で低所得者層を中心に消費が縮小し始めていることなどを背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）による緩和的な金融政策などが今後予想され、市場の下支えになると考えています。引き続き、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融政策や米大統領選などを注視しながら、銘柄を選定して運用を行ないます。
- ・個別銘柄の選択に際しては、より一層慎重な対応を行なっておりますが、今後も引き続きキャッシュフロー（現金収支）が安定的な企業や良好な収益見通しが期待できる企業を中心に投資を行なう方針です。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年7月6日～2024年7月5日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---------------------|-----------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 円 0 (0) | % 0.000 (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 0 (0) | 0.000 (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 ※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 (保 管 費 用) (そ の 他) | 27 (25) (2) | 0.055 (0.051) (0.004) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 27 | 0.055 | |
| 期中の平均基準価額は、49,216円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2023年7月6日～2024年7月5日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------|------------------|--------------------|------------------|----------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 — (249) | 千米ドル — (678) | 百株 45 (11) | 千米ドル 249 (18) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は株式分割、予約権行使、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。

新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|------|--------------------|-------------------|---------------------|--------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 証券 — (1,286) | 千米ドル — (3) | 証券 — (16,678) | 千米ドル — (196) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分です。

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 | 千米ドル — (545) | 千米ドル — (41) | 千米ドル — (787) | 千米ドル — (0.08) |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* () 内は予約権行使・償還等による増減分です。

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|------|----------------|--------------------------|----------------------------|
| 外 国 | アメリカ | 社債券（投資法人債券を含む） | 千米ドル 92,159 (123) | 千米ドル 95,837 (20,872) |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○株式売買比率

(2023年7月6日～2024年7月5日)

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 | 36,467千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 354,847千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.10 |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年7月6日～2024年7月5日)

該当事項はございません。

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

(2024年7月5日現在)

外国株式

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|---------------------------------------|---------------|-------|-------|---------|--------------------|-------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| CLOUD PEAK ENERGY INC | 12 | 12 | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| DIEBOLD NIXDORF INC | — | 101 | 410 | 66,088 | コンピュータ・周辺機器 | |
| DIRECTBUY HOLDINGS INC | 48 | 48 | — | — | 専門小売り | |
| ENDO INC | — | 91 | 259 | 41,856 | 医薬品 | |
| EXXON MOBIL CORP | — | 5 | 60 | 9,802 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| GULFPORT ENERGY CORP | 24 | 24 | 389 | 62,747 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TALEN ENERGY CORP | 9 | 63 | 759 | 122,378 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| UC HOLDINGS INC | 430 | 430 | 172 | 27,737 | 自動車用部品 | |
| WARREN RESOURCES INC | 245 | 245 | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| BRUIN BLOCKER LLC COM | 731 | 731 | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG COMMON | 57 | 57 | 220 | 35,461 | 通信 | |
| INTELSAT JACKSON HOLDING LU2445091858 | 5 | — | — | — | 通信 | |
| INTELSAT JACKSON HOLDING LU2445092583 | 5 | — | — | — | 通信 | |
| CARNELIAN POINT HOLDINGS COM | 5 | 5 | 600 | 96,742 | 各種金融サービス | |
| TPC HOLDINGS INC COM | 23 | 23 | 83 | 13,493 | 公益 | |
| TALEN ENERGY CORP 144A COM | 53 | — | — | — | 公益 | |
| ENDO INC US29290D1090 | — | 1 | 4 | 646 | 医薬品 | |
| MALLINCKRODT PLC | — | 3 | 16 | 2,613 | 医薬品 | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,655 | 1,846 | 2,975 | 479,568 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 13 | 15 | — | <1.1% > | |

* 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。

* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国新株予約権証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | |
|--------------------------------|---------|--------|-------|-------|--------|
| | | 証 券 数 | 証 券 数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 証券 | 証券 | 千米ドル | 千円 | |
| CWT TRAVEL HOLDINGS-A-CW26 | 3,158 | — | — | — | |
| CWT TRAVEL HOLDINGS-B-CW28 | 3,324 | — | — | — | |
| DENBURY-CW25 09/18/25 | 3,513 | — | — | — | |
| VISTRA CORP - CW24 | 6,683 | — | — | — | |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG WARRANT | 8 | 8 | 0.014 | 2 | |
| CHPPR HOLDINGS 1145 DOT WARR | — | 140 | 5 | 879 | |
| CHPPR HOLDINGS TRANCHE 2 WARR | — | 368 | — | — | |
| CHPPR HOLDINGS TRANCHE 1 WARR | — | 778 | — | — | |
| 合 計 | 証券数・金額 | 16,686 | 1,294 | 5 | 882 |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 4 | — | <0.0%> |

*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。

*<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|------|---------|---------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB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 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 306,819 | 269,121 | 43,374,268 | 96.1 | 94.6 | 44.8 | 45.6 | 5.7 |
| 合 計 | 306,819 | 269,121 | 43,374,268 | 96.1 | 94.6 | 44.8 | 45.6 | 5.7 |

*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。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社よりデータを入手しています。

*S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。なお、無格付けが1.4%あります。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|----------------------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | | | | | | |
| 新株予約権付社債 (転換社債) 券 | CARNELIAN PT HLDGS LP | — | 602 | 301 | 48,580 | 2028/6/30 |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1011778 BC / NEW RED FIN | 4.375 | 800 | 752 | 121,226 | 2028/1/15 |
| | 1011778 BC / NEW RED FIN | 6.125 | 175 | 175 | 28,361 | 2029/6/15 |
| | 1011778 BC / NEW RED FIN | 4.0 | 725 | 636 | 102,604 | 2030/10/15 |
| | 1839688 ALBERTA ULC | — | 145 | — | — | 2023/2/13 |
| | AAR ESCROW ISSUER LLC | 6.75 | 150 | 152 | 24,628 | 2029/3/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 8.25 | 325 | 327 | 52,738 | 2029/2/1 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 4.25 | 500 | 454 | 73,312 | 2029/2/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 8.5 | 275 | 278 | 44,940 | 2029/6/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 7.5 | 375 | 375 | 60,551 | 2030/11/6 |
| | ACUSHNET CO | 7.375 | 100 | 103 | 16,706 | 2028/10/15 |
| | ADAMS HOMES INC | 9.25 | 1,050 | 1,077 | 173,707 | 2028/10/15 |
| | ADIANT GLOBAL HOLDINGS | 8.25 | 225 | 234 | 37,860 | 2031/4/15 |
| | ADT SEC CORP | 4.125 | 425 | 391 | 63,025 | 2029/8/1 |
| | ADVANCED DRAINAGE SYSTEM | 6.375 | 125 | 125 | 20,212 | 2030/6/15 |
| | AES CORP/THE | 7.6 | 175 | 178 | 28,720 | 2055/1/15 |
| | AETHON UN/AETHIN UN FIN | 8.25 | 550 | 557 | 89,835 | 2026/2/15 |
| | AFFINITY GAMING | 6.875 | 525 | 458 | 73,923 | 2027/12/15 |
| | AG TTMT ESCROW ISSUER | 8.625 | 75 | 77 | 12,493 | 2027/9/30 |
| | AIR CANADA | 3.875 | 300 | 285 | 46,003 | 2026/8/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 6.5 | 400 | 402 | 64,838 | 2028/2/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 3.5 | 250 | 225 | 36,265 | 2029/3/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 4.875 | 425 | 401 | 64,672 | 2030/2/15 |
| | ALCOA NEDERLAND HOLDING | 6.125 | 250 | 249 | 40,153 | 2028/5/15 |
| | ALCOA NEDERLAND HOLDING | 7.125 | 200 | 205 | 33,144 | 2031/3/15 |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 4.875 | 500 | 470 | 75,796 | 2029/10/1 |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 5.125 | 327 | 304 | 49,002 | 2031/10/1 |
| | ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR | 10.5 | 275 | 118 | 19,151 | 2028/2/15 |
| | ALLIED UNIVERSAL | 6.0 | 1,000 | 870 | 140,311 | 2029/6/1 |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 9.75 | 650 | 646 | 104,214 | 2027/7/15 |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 7.875 | 325 | 325 | 52,502 | 2031/2/15 |
| | ALLY FINANCIAL INC | 6.7 | 150 | 150 | 24,213 | 2033/2/14 |
| | ALTA EQUIPMENT GROUP | 9.0 | 150 | 139 | 22,413 | 2029/6/1 |
| | ALTICE FINANCING SA | 9.625 | 400 | 368 | 59,380 | 2027/7/15 |
| | ALTICE FINANCING SA | 5.0 | 800 | 608 | 98,102 | 2028/1/15 |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 10.5 | 1,100 | 432 | 69,675 | 2027/5/15 |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 6.0 | 600 | 192 | 31,085 | 2028/2/15 |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.125 | 525 | 344 | 55,535 | 2029/7/15 |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.5 | 800 | 529 | 85,352 | 2029/10/15 |
| | AMC ENTERTAINMENT HOLDIN | 10.0 | 336 | 294 | 47,541 | 2026/6/15 |
| | AMC NETWORKS INC | 10.25 | 50 | 49 | 7,936 | 2029/1/15 |
| | AMC NETWORKS INC | 4.25 | 575 | 390 | 62,874 | 2029/2/15 |
| | AMER SPORTS COMPANY | 6.75 | 100 | 99 | 16,091 | 2031/2/16 |
| | AMERICAN AIRLINES INC | 7.25 | 225 | 225 | 36,360 | 2028/2/15 |
| | AMERICAN AIRLINES INC | 8.5 | 450 | 466 | 75,213 | 2029/5/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|--------------------------|-------|-------|--------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債類) | AMERICAN ELECTRIC POWER | 7.05 | 175 | 174 | 28,153 | 2054/12/15 |
| | | AMERICAN ELECTRIC POWER | 6.95 | 125 | 124 | 20,103 | 2054/12/15 |
| | | AMERITEX HOLDCO INTERMED | 10.25 | 350 | 369 | 59,546 | 2028/10/15 |
| | | AMN HEALTHCARE INC | 4.625 | 200 | 190 | 30,754 | 2027/10/1 |
| | | AMN HEALTHCARE INC | 4.0 | 375 | 337 | 54,367 | 2029/4/15 |
| | | AMS-OSRAM AG | 12.25 | 150 | 155 | 25,103 | 2029/3/30 |
| | | AMWINS GROUP INC | 6.375 | 100 | 100 | 16,130 | 2029/2/15 |
| | | ANTERO MIDSTREAM PART/FI | 6.625 | 225 | 227 | 36,671 | 2032/2/1 |
| | | ANYWHERE REAL EST | 7.0 | 558 | 459 | 73,986 | 2030/4/15 |
| | | APACHE CORP | 4.75 | 275 | 217 | 35,044 | 2043/4/15 |
| | | APX GROUP INC | 5.75 | 375 | 360 | 58,021 | 2029/7/15 |
| | | ARCHES BUYER INC | 4.25 | 375 | 334 | 53,932 | 2028/6/1 |
| | | ARD FINANCE SA | 6.5 | 1,622 | 428 | 68,988 | 2027/6/30 |
| | | ARDAGH PKG FIN/HLDS USA | 5.25 | 400 | 243 | 39,213 | 2027/8/15 |
| | | ARDAGH PKG FIN/HLDS USA | 5.25 | 400 | 242 | 39,134 | 2027/8/15 |
| | | ARETEC ESCROW ISSUER 2 | 10.0 | 50 | 54 | 8,805 | 2030/8/15 |
| | | ARKO CORP | 5.125 | 150 | 130 | 20,988 | 2029/11/15 |
| | | ARSENAL AIC PARENT LLC | 8.0 | 225 | 235 | 37,931 | 2030/10/1 |
| | | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 9.0 | 352 | 435 | 70,132 | 2027/11/1 |
| | | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 8.25 | 350 | 358 | 57,768 | 2028/12/31 |
| | | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 6.625 | 300 | 297 | 47,950 | 2028/1/15 |
| | | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 250 | 224 | 36,229 | 2029/8/1 |
| | | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 300 | 269 | 43,381 | 2030/4/1 |
| | | ASSUREDPARTNERS INC | 5.625 | 225 | 210 | 33,956 | 2029/1/15 |
| | | ASSUREDPARTNERS INC | 7.5 | 125 | 125 | 20,213 | 2032/2/15 |
| | | ASTON MARTIN CAPITAL HOL | 10.0 | 200 | 197 | 31,788 | 2029/3/31 |
| | | ATHENAHEALTH GROUP INC | 6.5 | 1,125 | 1,030 | 166,161 | 2030/2/15 |
| | | ATI INC | 7.25 | 175 | 181 | 29,221 | 2030/8/15 |
| | | ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI | 4.625 | 400 | 363 | 58,532 | 2028/6/1 |
| | | AUSTIN BIDCO INC | 7.125 | 625 | 580 | 93,540 | 2028/12/15 |
| | | AVANTOR FUNDING INC | 4.625 | 200 | 189 | 30,587 | 2028/7/15 |
| | | AVANTOR FUNDING INC | 3.875 | 900 | 815 | 131,378 | 2029/11/1 |
| | | AVIENT CORP | 7.125 | 275 | 280 | 45,136 | 2030/8/1 |
| | | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 4.75 | 625 | 574 | 92,543 | 2028/4/1 |
| | | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 8.0 | 275 | 272 | 43,879 | 2031/2/15 |
| | | B&G FOODS INC | 8.0 | 100 | 101 | 16,298 | 2028/9/15 |
| | | BAFFINLAND IRON CORP/LP | 8.75 | 750 | 673 | 108,529 | 2026/7/15 |
| | | BALDWIN INSUR GRP/FIN | 7.125 | 200 | 202 | 32,688 | 2031/5/15 |
| | | BALL CORP | 6.875 | 325 | 333 | 53,729 | 2028/3/15 |
| | | BALL CORP | 3.125 | 400 | 335 | 54,096 | 2031/9/15 |
| | | BARCLAYS PLC | 8.0 | 200 | 203 | 32,828 | 2099/8/8 |
| | | BARCLAYS PLC | 9.625 | 200 | 217 | 35,016 | 2099/11/22 |
| | | BASIC ENERGY ESCROW | — | 200 | 2 | 322 | 2023/10/15 |
| | | BAUSCH & LOMB ESCROW COR | 8.375 | 450 | 461 | 74,430 | 2028/10/1 |
| | | BAUSCH HEALTH AMERICAS | 8.5 | 250 | 176 | 28,380 | 2027/1/31 |
| | | BAUSCH HEALTH COS INC | 6.125 | 300 | 249 | 40,150 | 2027/2/1 |
| | | BAUSCH HEALTH COS INC | 6.25 | 75 | 38 | 6,249 | 2029/2/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|--------------------------|--------|-------|--------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人横断) | BAUSCH HEALTH COS INC | 5.0 | 725 | 352 | 56,738 | 2029/2/15 |
| | | BAYTEX ENERGY CORP | 8.5 | 775 | 812 | 130,882 | 2030/4/30 |
| | | BCPE ULYSSES INTERMEDIAT | 7.75 | 275 | 266 | 42,887 | 2027/4/1 |
| | | BEACON ROOFING SUPPLY IN | 6.5 | 775 | 779 | 125,651 | 2030/8/1 |
| | | BEAZER HOMES USA | 7.25 | 425 | 423 | 68,321 | 2029/10/15 |
| | | BEAZER HOMES USA | 7.5 | 100 | 99 | 16,064 | 2031/3/15 |
| | | BENTELER INTERNATIONAL A | 10.5 | 500 | 536 | 86,503 | 2028/5/15 |
| | | BIG RIVER STEEL/BRS FIN | 6.625 | 230 | 231 | 37,320 | 2029/1/31 |
| | | BLOCK INC | 6.5 | 475 | 481 | 77,567 | 2032/5/15 |
| | | BLUE RACER MID LLC/FINAN | 6.625 | 275 | 275 | 44,345 | 2026/7/15 |
| | | BLUE RACER MID LLC/FINAN | 7.0 | 100 | 101 | 16,389 | 2029/7/15 |
| | | BLUE RACER MID LLC/FINAN | 7.25 | 50 | 51 | 8,275 | 2032/7/15 |
| | | BOEING CO | 6.528 | 75 | 77 | 12,463 | 2034/5/1 |
| | | BOEING CO | 6.858 | 75 | 78 | 12,586 | 2054/5/1 |
| | | BOEING CO | 7.008 | 150 | 156 | 25,150 | 2064/5/1 |
| | | BOMBARDIER INC | 7.125 | 91 | 92 | 14,887 | 2026/6/15 |
| | | BOMBARDIER INC | 6.0 | 850 | 840 | 135,392 | 2028/2/15 |
| | | BOMBARDIER INC | 7.5 | 200 | 207 | 33,406 | 2029/2/1 |
| | | BOMBARDIER INC | 8.75 | 175 | 189 | 30,496 | 2030/11/15 |
| | | BOMBARDIER INC | 7.25 | 150 | 154 | 24,839 | 2031/7/1 |
| | | BOMBARDIER INC | 7.0 | 200 | 203 | 32,786 | 2032/6/1 |
| | | BORR IHC LTD / BORR FIN | 10.0 | 192 | 201 | 32,528 | 2028/11/15 |
| | | BORR IHC LTD / BORR FIN | 10.375 | 195 | 204 | 32,936 | 2030/11/15 |
| | | BOYD GAMING CORP | 4.75 | 700 | 635 | 102,353 | 2031/6/15 |
| | | BRAND INDUSTRIAL SERVICE | 10.375 | 225 | 243 | 39,204 | 2030/8/1 |
| | | BRANDYWINE OPER PARTNERS | 8.875 | 50 | 52 | 8,401 | 2029/4/12 |
| | | BREAD FINANCIAL HLDGS | 9.75 | 225 | 236 | 38,110 | 2029/3/15 |
| | | BRINK' S CO/THE | 6.5 | 225 | 227 | 36,710 | 2029/6/15 |
| | | BRINK' S CO/THE | 6.75 | 300 | 302 | 48,777 | 2032/6/15 |
| | | BRISTOW GROUP INC | 6.875 | 850 | 840 | 135,412 | 2028/3/1 |
| | | BUCKEYE PARTNERS LP | 6.875 | 300 | 301 | 48,534 | 2029/7/1 |
| | | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 5.0 | 400 | 379 | 61,113 | 2030/3/1 |
| | | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 4.25 | 575 | 506 | 81,624 | 2032/2/1 |
| | | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 6.375 | 550 | 550 | 88,676 | 2032/6/15 |
| | | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 6.375 | 275 | 271 | 43,767 | 2034/3/1 |
| | | CAESARS ENTERTAIN INC | 4.625 | 200 | 183 | 29,523 | 2029/10/15 |
| | | CAESARS ENTERTAIN INC | 6.5 | 325 | 326 | 52,643 | 2032/2/15 |
| | | CALIFORNIA RESOURCES CRP | 8.25 | 350 | 357 | 57,680 | 2029/6/15 |
| | | CALPINE CORP | 4.5 | 275 | 261 | 42,101 | 2028/2/15 |
| | | CALPINE CORP | 4.625 | 300 | 279 | 45,045 | 2029/2/1 |
| | | CALPINE CORP | 5.0 | 325 | 303 | 48,942 | 2031/2/1 |
| | | CARLYLE AVIATION ELEVATE | 7.0 | 700 | 696 | 112,248 | 2024/10/15 |
| | | CARNIVAL CORP | 5.75 | 3,450 | 3,403 | 548,534 | 2027/3/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 6.0 | 375 | 370 | 59,686 | 2029/5/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 10.5 | 200 | 216 | 34,959 | 2030/6/1 |
| | | CARPENTER TECHNOLOGY | 6.375 | 300 | 300 | 48,507 | 2028/7/15 |
| | | CASTLE US HOLDING CORP | 9.5 | 379 | 181 | 29,254 | 2028/2/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人横断) | | | | | |
| | CASTLELAKE AVIATION FIN | 5.0 | 425 | 411 | 66,243 | 2027/4/15 |
| | CATALENT PHARMA SOLUTION | 3.5 | 550 | 527 | 84,959 | 2030/4/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 525 | 442 | 71,361 | 2030/8/15 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 125 | 101 | 16,437 | 2031/2/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 7.375 | 100 | 98 | 15,850 | 2031/3/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.75 | 400 | 327 | 52,843 | 2032/2/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 2,661 | 2,141 | 345,110 | 2032/5/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 275 | 216 | 34,846 | 2033/6/1 |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 1,275 | 967 | 155,913 | 2034/1/15 |
| | CDI ESCROW ISSUER INC | 5.75 | 375 | 362 | 58,485 | 2030/4/1 |
| | CEMEX SAB DE CV | 5.125 | 200 | 192 | 31,023 | 2099/6/8 |
| | CENTURY COMMUNITIES | 6.75 | 400 | 402 | 64,940 | 2027/6/1 |
| | CHAMPIONS FINANCING INC | 8.75 | 150 | 153 | 24,789 | 2029/2/15 |
| | CHART INDUSTRIES INC | 7.5 | 575 | 593 | 95,602 | 2030/1/1 |
| | CHART INDUSTRIES INC | 9.5 | 400 | 432 | 69,732 | 2031/1/1 |
| | CHARTER COMM OPT LLC/CAP | 6.484 | 500 | 462 | 74,464 | 2045/10/23 |
| | CHEMOURS CO | 5.375 | 50 | 47 | 7,625 | 2027/5/15 |
| | CHEMOURS CO | 5.75 | 1,025 | 944 | 152,200 | 2028/11/15 |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 5.5 | 300 | 297 | 47,898 | 2026/2/1 |
| | CHESAPEAKE ESCROW ISSUER | 5.875 | 150 | 147 | 23,848 | 2029/2/1 |
| | CHOBANI LLC/FINANCE CORP | 7.625 | 100 | 103 | 16,603 | 2029/7/1 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.625 | 525 | 491 | 79,172 | 2027/3/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.0 | 325 | 288 | 46,550 | 2029/1/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.875 | 525 | 402 | 64,847 | 2029/4/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.125 | 625 | 435 | 70,137 | 2030/4/1 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.25 | 575 | 476 | 76,775 | 2030/5/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 4.75 | 825 | 653 | 105,253 | 2031/2/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 10.875 | 575 | 601 | 96,977 | 2032/1/15 |
| | CIENA CORP | 4.0 | 950 | 857 | 138,270 | 2030/1/31 |
| | CINEMARK USA INC | 5.875 | 725 | 718 | 115,780 | 2026/3/15 |
| | CITGO PETROLEUM CORP | 7.0 | 700 | 700 | 112,879 | 2025/6/15 |
| | CITGO PETROLEUM CORP | 6.375 | 575 | 575 | 92,714 | 2026/6/15 |
| | CITGO PETROLEUM CORP | 8.375 | 325 | 335 | 54,055 | 2029/1/15 |
| | CITIGROUP INC | 4.7 | 625 | 613 | 98,858 | 2099/1/23 |
| | CITIGROUP INC | 4.0 | 325 | 311 | 50,172 | 2099/12/10 |
| | CIVITAS RESOURCES INC | 8.625 | 925 | 992 | 160,002 | 2030/11/1 |
| | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO | 7.5 | 1,150 | 964 | 155,390 | 2029/6/1 |
| | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO | 7.875 | 250 | 251 | 40,576 | 2030/4/1 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 4.75 | 346 | 329 | 53,169 | 2028/3/15 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 255 | 222 | 35,858 | 2031/2/15 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 150 | 127 | 20,493 | 2032/1/15 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 5.875 | 200 | 198 | 32,015 | 2027/6/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.625 | 275 | 261 | 42,150 | 2029/3/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.875 | 200 | 177 | 28,628 | 2031/3/1 |
| | CLOUD PEAK ENRGY | — | 1,400 | — | — | 2024/3/15 |
| | CLOUD SOFTWARE GRP INC | 9.0 | 900 | 874 | 140,910 | 2029/9/30 |
| | CLOUD SOFTWARE GRP INC | 8.25 | 600 | 612 | 98,794 | 2032/6/30 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | CLYDESDALE ACQUISITION | 6.625 | 50 | 49 | 7,932 | 2029/4/15 |
| | CLYDESDALE ACQUISITION | 8.75 | 225 | 218 | 35,288 | 2030/4/15 |
| | CNT PRNT/CDK GLO II/FIN | 8.0 | 100 | 102 | 16,486 | 2029/6/15 |
| | CNX RESOURCES CORP | 6.0 | 425 | 416 | 67,056 | 2029/1/15 |
| | COEUR MINING INC | 5.125 | 400 | 376 | 60,647 | 2029/2/15 |
| | COGENT COMMS GRP / FIN | 7.0 | 125 | 123 | 19,983 | 2027/6/15 |
| | COINBASE GLOBAL INC | 3.375 | 740 | 637 | 102,714 | 2028/10/1 |
| | COINBASE GLOBAL INC | 3.625 | 525 | 422 | 68,090 | 2031/10/1 |
| | COLT MERGER SUB INC | 8.125 | 600 | 612 | 98,780 | 2027/7/1 |
| | COMMERCIAL METALS CO | 4.125 | 350 | 320 | 51,587 | 2030/1/15 |
| | COMMERCIAL METALS CO | 4.375 | 150 | 134 | 21,709 | 2032/3/15 |
| | COMMSCOPE INC | 4.75 | 350 | 240 | 38,781 | 2029/9/1 |
| | COMMSCOPE TECH FINANCE L | 6.0 | 400 | 325 | 52,418 | 2025/6/15 |
| | COMPASS MINERALS INTERNA | 6.75 | 450 | 422 | 68,084 | 2027/12/1 |
| | COMSTOCK RESOURCES INC | 5.875 | 500 | 465 | 75,075 | 2030/1/15 |
| | CONCENTRA ESCROW ISSUER | 6.875 | 100 | 101 | 16,337 | 2032/7/15 |
| | CONSENSUS CLOUD SOLUTION | 6.0 | 325 | 315 | 50,863 | 2026/10/15 |
| | CONSENSUS CLOUD SOLUTION | 6.5 | 350 | 328 | 52,873 | 2028/10/15 |
| | COTY/HFC PRESTIGE/INT US | 6.625 | 400 | 405 | 65,327 | 2030/7/15 |
| | CP ATLAS BUYER INC | 7.0 | 1,338 | 1,140 | 183,839 | 2028/12/1 |
| | CPI CG INC | 10.0 | 125 | 130 | 20,970 | 2029/7/15 |
| | QOP HOLDCO LP/BIP-V CHIN | 5.5 | 750 | 711 | 114,641 | 2031/6/15 |
| | CRESCENT ENERGY FINANCE | 7.625 | 75 | 76 | 12,352 | 2032/4/1 |
| | CROCS INC | 4.25 | 475 | 434 | 69,979 | 2029/3/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 5.375 | 200 | 150 | 24,283 | 2028/2/1 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 11.25 | 200 | 171 | 27,678 | 2028/5/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 11.75 | 400 | 339 | 54,760 | 2029/1/31 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 5.75 | 750 | 281 | 45,442 | 2030/1/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 4.5 | 600 | 389 | 62,785 | 2031/11/15 |
| | CURO GROUP HOLDINGS CORP | — | 325 | 16 | 2,684 | 2028/8/1 |
| | CUSHMAN & WAKEFIELD US | 8.875 | 100 | 105 | 16,972 | 2031/9/1 |
| | DARLING INGREDIENTS INC | 6.0 | 350 | 344 | 55,443 | 2030/6/15 |
| | DAVITA INC | 4.625 | 560 | 505 | 81,542 | 2030/6/1 |
| | DELEK LOG PART/FINANCE | 8.625 | 700 | 721 | 116,262 | 2029/3/15 |
| | DIAMOND FRGN/DIAMOND FIN | 8.5 | 75 | 78 | 12,707 | 2030/10/1 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 23 | 11 | 1,863 | 2030/12/31 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 274 | 13 | 2,213 | 2030/12/31 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 6 | 3 | 533 | 2030/12/31 |
| | DIGICEL GROUP HOLDINGS | — | 752 | 7 | 1,212 | 2030/12/31 |
| | DIRECTV FINANCING LLC | 8.875 | 175 | 171 | 27,604 | 2030/2/1 |
| | DIRECTV HOLDINGS/FING | 5.875 | 950 | 900 | 145,079 | 2027/8/15 |
| | DISH DBS CORP | 5.25 | 925 | 735 | 118,546 | 2026/12/1 |
| | DISH DBS CORP | 7.375 | 400 | 169 | 27,384 | 2028/7/1 |
| | DISH DBS CORP | 5.125 | 975 | 395 | 63,723 | 2029/6/1 |
| | DISH NETWORK CORP | 11.75 | 350 | 345 | 55,645 | 2027/11/15 |
| | DORNOCH DEBT MERGER SUB | 6.625 | 1,225 | 1,056 | 170,263 | 2029/10/15 |
| | DREAM FINDERS HOMES INC | 8.25 | 175 | 179 | 28,977 | 2028/8/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人横断) | | | | | |
| | DYE & DURHAM LIMITED | 8.625 | 75 | 76 | 12,322 | 2029/4/15 |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 5.5 | 625 | 609 | 98,255 | 2028/6/1 |
| | ELECTRICITE DE FRANCE SA | 9.125 | 200 | 219 | 35,329 | 2099/6/15 |
| | EMERALD DEBT MERGER | 6.625 | 875 | 882 | 142,257 | 2030/12/15 |
| | EMPIRE COMMUNITIES CORP | 9.75 | 225 | 230 | 37,180 | 2029/5/1 |
| | EMRLD BOR / EMRLD CO-ISS | 6.75 | 100 | 101 | 16,345 | 2031/7/15 |
| | ENBRIDGE INC | 7.2 | 25 | 25 | 4,058 | 2054/6/27 |
| | ENBRIDGE INC | 7.375 | 25 | 25 | 4,049 | 2055/3/15 |
| | ENCINO ACQUISITION PARTN | 8.75 | 25 | 26 | 4,193 | 2031/5/1 |
| | ENCORE CAPITAL GROUP INC | 9.25 | 200 | 208 | 33,620 | 2029/4/1 |
| | ENCORE CAPITAL GROUP INC | 8.5 | 200 | 203 | 32,832 | 2030/5/15 |
| | ENDO FINANCE HOLDINGS | 8.5 | 200 | 206 | 33,357 | 2031/4/15 |
| | ENDURANCE ACQ MERGER | 6.0 | 485 | 364 | 58,704 | 2029/2/15 |
| | ENERFLEX LTD | 9.0 | 300 | 305 | 49,270 | 2027/10/15 |
| | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.375 | 200 | 177 | 28,532 | 2028/3/30 |
| | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.875 | 200 | 168 | 27,150 | 2031/3/30 |
| | ENERGY TRANSFER LP | 8.0 | 50 | 52 | 8,452 | 2054/5/15 |
| | ENERGY TRANSFER LP | 7.125 | 225 | 221 | 35,779 | 2054/10/1 |
| | ENERSYS | 6.625 | 75 | 76 | 12,283 | 2032/1/15 |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.6 | 850 | 749 | 120,825 | 2044/4/1 |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.05 | 200 | 164 | 26,496 | 2045/4/1 |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.45 | 100 | 86 | 13,921 | 2047/6/1 |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 4.5 | 350 | 331 | 53,375 | 2029/1/15 |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.375 | 175 | 176 | 28,484 | 2029/4/1 |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 7.5 | 200 | 213 | 34,425 | 2030/6/1 |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.5 | 350 | 350 | 56,481 | 2048/7/15 |
| | EQUIPMENTSHARE.COM INC | 8.625 | 625 | 649 | 104,729 | 2032/5/15 |
| | ESAB CORP | 6.25 | 125 | 125 | 20,262 | 2029/4/15 |
| | ESC GCB ENDO LUX | — | 430 | 14 | 2,368 | 2027/7/31 |
| | ESC GCB ENDO LUX | — | 658 | 22 | 3,622 | 2028/6/30 |
| | ESC GCB ENDO LUX | — | 400 | — | — | 2029/4/1 |
| | ESC PAR PHARMAC | — | 361 | — | — | 2027/4/1 |
| | EVERI HOLDINGS INC | 5.0 | 175 | 172 | 27,806 | 2029/7/15 |
| | EXELA INTERMED/EXELA FIN | 5.75 | 283 | 45 | 7,316 | 2026/4/15 |
| | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.375 | 500 | 491 | 79,152 | 2026/4/1 |
| | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.875 | 350 | 319 | 51,544 | 2029/4/1 |
| | FERTITTA ENTERTAINMENT | 4.625 | 300 | 273 | 44,090 | 2029/1/15 |
| | FIESTA PURCHASER INC | 7.875 | 25 | 25 | 4,170 | 2031/3/1 |
| | FIRST QUANTUM MINERALS L | 9.375 | 200 | 209 | 33,727 | 2029/3/1 |
| | FIRSTCASH INC | 6.875 | 325 | 322 | 52,052 | 2032/3/1 |
| | FLUTTER TREASURY DAC | 6.375 | 200 | 201 | 32,509 | 2029/4/29 |
| | FMG RESOURCES AUG 2006 | 4.375 | 675 | 603 | 97,232 | 2031/4/1 |
| | FMG RESOURCES AUG 2006 | 6.125 | 150 | 148 | 23,854 | 2032/4/15 |
| | FORD MOTOR COMPANY | 6.1 | 250 | 251 | 40,462 | 2032/8/19 |
| | FORD MOTOR COMPANY | 4.75 | 750 | 614 | 99,115 | 2043/1/15 |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 5.113 | 875 | 848 | 136,765 | 2029/5/3 |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 7.35 | 200 | 212 | 34,252 | 2030/3/6 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | FORESTAR GROUP INC | 3.85 | 415 | 398 | 64,298 | 2026/5/15 |
| | FORESTAR GROUP INC | 5.0 | 650 | 626 | 101,016 | 2028/3/1 |
| | FORTREA HOLDINGS INC | 7.5 | 575 | 572 | 92,262 | 2030/7/1 |
| | FORTRESS INTERMEDIATE | 7.5 | 75 | 76 | 12,281 | 2031/6/1 |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 5.5 | 450 | 436 | 70,334 | 2028/5/1 |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 7.875 | 50 | 52 | 8,466 | 2030/12/1 |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 7.0 | 200 | 203 | 32,862 | 2031/5/1 |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 7.0 | 325 | 330 | 53,214 | 2032/6/15 |
| | FOUNDATION BUILDING M | 6.0 | 1,075 | 949 | 153,107 | 2029/3/1 |
| | FOXTROT ESCROW ISSUER | 12.25 | 325 | 322 | 52,034 | 2026/11/15 |
| | FREEDOM MORTGAGE | 6.625 | 525 | 506 | 81,603 | 2027/1/15 |
| | FREEDOM MORTGAGE CORP | 12.0 | 375 | 400 | 64,511 | 2028/10/1 |
| | FREEDOM MORTGAGE CORP | 12.25 | 375 | 402 | 64,824 | 2030/10/1 |
| | FREEDOM MORTGAGE HOLD | 9.25 | 525 | 521 | 84,080 | 2029/2/1 |
| | FREEDOM MORTGAGE HOLD | 9.125 | 200 | 193 | 31,226 | 2031/5/15 |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.0 | 775 | 730 | 117,666 | 2028/5/1 |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 6.75 | 450 | 414 | 66,765 | 2029/5/1 |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.875 | 274 | 240 | 38,697 | 2029/11/1 |
| | GARDA WORLD SECURITY | 7.75 | 175 | 178 | 28,736 | 2028/2/15 |
| | GARRETT MOTION HLD/SARL | 7.75 | 150 | 152 | 24,538 | 2032/5/31 |
| | GATES CORPORATION | 6.875 | 75 | 76 | 12,352 | 2029/7/1 |
| | GENESE & WYOMING INC | 6.25 | 400 | 398 | 64,149 | 2032/4/15 |
| | GENESIS ENERGY LP/FIN | 7.75 | 350 | 353 | 57,025 | 2028/2/1 |
| | GENESIS ENERGY LP/FIN | 8.875 | 350 | 368 | 59,413 | 2030/4/15 |
| | GENESIS ENERGY LP/FIN | 7.875 | 250 | 252 | 40,758 | 2032/5/15 |
| | GENON ESCROW CORP | — | 1,798 | — | — | 2022/10/15 |
| | GEO GROUP INC/THE | 8.625 | 175 | 179 | 28,969 | 2029/4/15 |
| | GEO GROUP INC/THE | 10.25 | 350 | 367 | 59,283 | 2031/4/15 |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC | 6.75 | 425 | 433 | 69,819 | 2031/1/15 |
| | GGAM FINANCE LTD | 8.0 | 150 | 154 | 24,951 | 2027/2/15 |
| | GGAM FINANCE LTD | 6.875 | 100 | 101 | 16,378 | 2029/4/15 |
| | GLATFELTER | 4.75 | 325 | 265 | 42,807 | 2029/11/15 |
| | GLOBAL AIR LEASE CO LTD | 6.5 | 1,121 | 1,086 | 175,035 | 2024/9/15 |
| | GLOBAL AUTO HO/AAG FH UK | 8.375 | 200 | 194 | 31,340 | 2029/1/15 |
| | GLOBAL AUTO HO/AAG FH UK | 8.75 | 200 | 191 | 30,919 | 2032/1/15 |
| | GO DADDY OPCO/FINCO | 5.25 | 250 | 243 | 39,251 | 2027/12/1 |
| | GOEASY LTD | 9.25 | 125 | 132 | 21,391 | 2028/12/1 |
| | GOEASY LTD | 7.625 | 325 | 331 | 53,444 | 2029/7/1 |
| | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 5.25 | 325 | 297 | 47,890 | 2031/7/15 |
| | GOTO GROUP INC | 5.5 | 339 | 269 | 43,413 | 2028/5/1 |
| | GOTO GROUP INC | 5.5 | 468 | 189 | 30,608 | 2028/5/1 |
| | GPS HOSPITALITY HOLDING | 7.0 | 575 | 418 | 67,441 | 2028/8/15 |
| | GRAFTECH GLOBAL ENTERPRI | 9.875 | 825 | 641 | 103,327 | 2028/12/15 |
| | GRAPHIC PACKAGING INTERN | 6.375 | 100 | 99 | 16,108 | 2032/7/15 |
| | GRAY ESCROW II INC | 5.375 | 75 | 42 | 6,790 | 2031/11/15 |
| | GREYSTAR REAL ESTATE PAR | 7.75 | 675 | 714 | 115,110 | 2030/9/1 |
| | GRIFOLS SA | 4.75 | 275 | 238 | 38,393 | 2028/10/15 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | | 償還年月日 |
|---------------------|--------------------------|---------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | GTCR W-2 MERGER SUB LLC | 7.5 | 800 | 831 | 134,038 | 2031/1/15 |
| | GULFPORT ENERGY CORP | 8.0 | 227 | 229 | 37,049 | 2026/5/17 |
| | GULFPORT ENERGY OP CORP | 8.0 | 10 | 10 | 1,762 | 2026/5/17 |
| | HANESBRANDS INC | 9.0 | 400 | 420 | 67,732 | 2031/2/15 |
| | HARVEST MIDSTREAM I LP | 7.5 | 700 | 710 | 114,533 | 2028/9/1 |
| | HARVEST MIDSTREAM I LP | 7.5 | 200 | 203 | 32,756 | 2032/5/15 |
| | HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 6.0 | 175 | 175 | 28,204 | 2025/4/15 |
| | HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 3.75 | 839 | 728 | 117,422 | 2030/9/15 |
| | HAWAIIAN BRAND INTELLECT | 5.75 | 475 | 447 | 72,193 | 2026/1/20 |
| | HAWKER BEECHCRAFT ESCROW | — | 200 | — | — | 2017/4/1 |
| | HCA INC | 6.0 | 125 | 124 | 20,036 | 2054/4/1 |
| | HELIX ENERGY SOLUTIONS | 9.75 | 400 | 427 | 68,843 | 2029/3/1 |
| | HELLAS II | — | 1,700 | — | — | 2015/1/15 |
| | HERC HOLDINGS INC | 6.625 | 175 | 177 | 28,567 | 2029/6/15 |
| | HERTZ CORP/THE | 5.0 | 225 | 139 | 22,438 | 2029/12/1 |
| | HESS MIDSTREAM OPERATION | 6.5 | 125 | 126 | 20,378 | 2029/6/1 |
| | HESS MIDSTREAM OPERATION | 5.5 | 150 | 144 | 23,365 | 2030/10/15 |
| | HF SINCLAIR | 6.375 | 225 | 225 | 36,408 | 2027/4/15 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.25 | 498 | 492 | 79,446 | 2028/11/1 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.25 | 250 | 240 | 38,794 | 2032/4/15 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 8.375 | 550 | 587 | 94,642 | 2033/11/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 3.75 | 200 | 183 | 29,498 | 2029/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 4.0 | 725 | 649 | 104,615 | 2031/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 3.625 | 300 | 259 | 41,759 | 2032/2/15 |
| | HILTON GRAND VAC BOR ESC | 5.0 | 465 | 432 | 69,766 | 2029/6/1 |
| | HLF FIN SARL LLC/HERBALI | 4.875 | 675 | 466 | 75,198 | 2029/6/1 |
| | HOSPITALITY PROP TRUST | 4.95 | 300 | 273 | 44,056 | 2027/2/15 |
| | HOWARD MIDSTREAM ENERGY | 8.875 | 375 | 396 | 63,914 | 2028/7/15 |
| | HOWARD MIDSTREAM ENERGY | 7.375 | 350 | 355 | 57,272 | 2032/7/15 |
| | HOWDEN UK REFINANCE / US | 7.25 | 200 | 197 | 31,876 | 2031/2/15 |
| | HUB INTERNATIONAL LTD | 7.25 | 550 | 565 | 91,193 | 2030/6/15 |
| | HUB INTERNATIONAL LTD | 7.375 | 225 | 228 | 36,900 | 2032/1/31 |
| | HUDSON AUTOMOTIVE GROUP | 8.0 | 25 | 25 | 4,169 | 2032/5/15 |
| | HUSKY INJECTION / TITAN | 9.0 | 150 | 155 | 25,037 | 2029/2/15 |
| | IAMGOLD CORP | 5.75 | 575 | 542 | 87,451 | 2028/10/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 6.25 | 565 | 561 | 90,495 | 2026/5/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 5.25 | 350 | 328 | 52,939 | 2027/5/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 9.75 | 175 | 180 | 29,159 | 2029/1/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 4.375 | 350 | 300 | 48,370 | 2029/2/1 |
| | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 6.375 | 225 | 177 | 28,660 | 2026/5/1 |
| | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 4.75 | 550 | 289 | 46,595 | 2028/1/15 |
| | IHO VERWALTUNGS GMBH | 6.375 | 550 | 546 | 88,123 | 2029/5/15 |
| | ILFC E-CAPITAL TRUST I | 7.15902 | 850 | 693 | 111,790 | 2065/12/21 |
| | ILIAD HOLDING SAS | 7.0 | 400 | 395 | 63,793 | 2028/10/15 |
| | ILIAD HOLDING SAS | 8.5 | 200 | 202 | 32,691 | 2031/4/15 |
| | IMOLA MERGER CORP | 4.75 | 600 | 559 | 90,132 | 2029/5/15 |
| | INEOS FINANCE PLC | 7.5 | 200 | 202 | 32,556 | 2029/4/15 |

| 銘柄 | | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|---------------------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | INSIGHT ENTERPRS | 6.625 | 100 | 101 | 16,357 | 2032/5/15 |
| | INTEL PKG HOLDCO ISSUER | 9.0 | 225 | 215 | 34,721 | 2026/1/15 |
| | ION TRADING TECHNOLOGIES | 9.5 | 200 | 203 | 32,825 | 2029/5/30 |
| | IRIS HOLDINGS INC | 8.75 | 325 | 265 | 42,828 | 2026/2/15 |
| | IRIS MERGER SUB 2019 INC | 9.375 | 1,275 | 1,083 | 174,614 | 2028/2/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 5.25 | 100 | 96 | 15,621 | 2028/3/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 7.0 | 300 | 305 | 49,224 | 2029/2/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 4.875 | 390 | 366 | 59,123 | 2029/9/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 5.625 | 550 | 522 | 84,198 | 2032/7/15 |
| | IRON MOUNTAIN INFO MGMT | 5.0 | 575 | 527 | 85,047 | 2032/7/15 |
| | ITHACA ENERGY NORTH | 9.0 | 600 | 609 | 98,248 | 2026/7/15 |
| | JACOBS ENTERTAINMENT INC | 6.75 | 250 | 232 | 37,426 | 2029/2/15 |
| | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 5.5 | 600 | 575 | 92,789 | 2029/7/15 |
| | JB POINDEXTER & CO INC | 8.75 | 200 | 207 | 33,402 | 2031/12/15 |
| | JEFFERIES FIN LLC / JFIN | 5.0 | 325 | 299 | 48,268 | 2028/8/15 |
| | JEFFERSON CAPITAL HOLDIN | 9.5 | 325 | 335 | 54,138 | 2029/2/15 |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 4.6 | 375 | 370 | 59,692 | 2099/1/23 |
| | KAISER ALUMINUM CORP | 4.5 | 750 | 666 | 107,362 | 2031/6/1 |
| | KB HOME | 4.8 | 350 | 330 | 53,194 | 2029/11/15 |
| | KB HOME | 7.25 | 150 | 154 | 24,874 | 2030/7/15 |
| | KB HOME | 4.0 | 350 | 309 | 49,850 | 2031/6/15 |
| | KEHE DIST/FIN / NEXTWAVE | 9.0 | 625 | 639 | 103,054 | 2029/2/15 |
| | KINETIK HOLDINGS LP | 5.875 | 325 | 319 | 51,543 | 2030/6/15 |
| | KNIFE RIVER HOLD CO | 7.75 | 375 | 390 | 62,939 | 2031/5/1 |
| | L BRANDS INC | 6.625 | 150 | 150 | 24,285 | 2030/10/1 |
| | L BRANDS INC | 6.75 | 950 | 942 | 151,973 | 2036/7/1 |
| | LABL INC | 5.875 | 300 | 275 | 44,381 | 2028/11/1 |
| | LABL INC | 9.5 | 50 | 50 | 8,138 | 2028/11/1 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 4.75 | 175 | 162 | 26,218 | 2029/6/15 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 7.0 | 150 | 151 | 24,453 | 2031/7/15 |
| | LAREDO PETROLEUM INC | 7.75 | 325 | 328 | 52,909 | 2029/7/31 |
| | LBM ACQUISITION LLC | 6.25 | 425 | 374 | 60,380 | 2029/1/15 |
| | LCM INVESTMENTS HOLDINGS | 8.25 | 200 | 209 | 33,715 | 2031/8/1 |
| | LD HOLDINGS GROUP LLC | 6.125 | 850 | 636 | 102,628 | 2028/4/1 |
| | LEEWARD RENEWABL | 4.25 | 625 | 556 | 89,764 | 2029/7/1 |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 4.25 | 900 | 329 | 53,075 | 2028/7/1 |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 3.75 | 1,050 | 325 | 52,460 | 2029/7/15 |
| | LGI HOMES INC | 8.75 | 275 | 286 | 46,156 | 2028/12/15 |
| | LGI HOMES INC | 4.0 | 595 | 518 | 83,613 | 2029/7/15 |
| | LIFE TIME INC | 8.0 | 575 | 581 | 93,687 | 2026/4/15 |
| | LIFEPOINT HEALTH INC | 9.875 | 175 | 186 | 30,069 | 2030/8/15 |
| | LIFEPOINT HEALTH INC | 11.0 | 275 | 304 | 49,015 | 2030/10/15 |
| | LIFEPOINT HEALTH INC | 10.0 | 275 | 282 | 45,506 | 2032/6/1 |
| | LIGHT & WONDER INTER | 7.5 | 125 | 129 | 20,823 | 2031/9/1 |
| | LINDBLAD EXPEDITIONS LLC | 6.75 | 150 | 148 | 24,003 | 2027/2/15 |
| | LITHIA MOTORS INC | 3.875 | 712 | 637 | 102,826 | 2029/6/1 |
| | LSF11 A5 HOLDCO LLC | 6.625 | 875 | 833 | 134,277 | 2029/10/15 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|------------------------|--------------------------|-------|-------|---------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 | MACQUARIE AIRFINANCE HLD | 8.375 | 150 | 158 | 25,503 | 2028/5/1 |
| | (含む投資法人横券) | MACQUARIE AIRFINANCE HLD | 6.4 | 75 | 76 | 12,279 | 2029/3/26 |
| | | MACQUARIE AIRFINANCE HLD | 6.5 | 125 | 128 | 20,741 | 2031/3/26 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.875 | 150 | 144 | 23,366 | 2029/4/1 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.875 | 75 | 71 | 11,548 | 2030/3/15 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 6.125 | 125 | 119 | 19,294 | 2032/3/15 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.125 | 700 | 572 | 92,207 | 2042/1/15 |
| | | MAJORDRIVE HOLDINGS IV L | 6.375 | 525 | 490 | 79,115 | 2029/6/1 |
| | | MASTERBRAND INC | 7.0 | 100 | 101 | 16,338 | 2032/7/15 |
| | | MATADOR RESOURCES CO | 6.875 | 375 | 380 | 61,326 | 2028/4/15 |
| | | MATADOR RESOURCES CO | 6.5 | 75 | 74 | 12,082 | 2032/4/15 |
| | | MATCH GROUP HLD II LLC | 3.625 | 420 | 356 | 57,391 | 2031/10/1 |
| | | MATTAMY GROUP CORP | 4.625 | 525 | 484 | 78,121 | 2030/3/1 |
| | | MATTEL INC | 5.45 | 225 | 199 | 32,204 | 2041/11/1 |
| | | MAV ACQUISITION CORP | 8.0 | 525 | 510 | 82,217 | 2029/8/1 |
| | | MEDLINE BORROWER/MEDL CO | 6.25 | 175 | 176 | 28,489 | 2029/4/1 |
| | | MELCO RESORTS FINANCE | 7.625 | 200 | 199 | 32,110 | 2032/4/17 |
| | | MERISANT ESCROW | 12.25 | 600 | — | — | 2014/5/15 |
| | | MERITAGE HOMES CORP | 3.875 | 400 | 368 | 59,344 | 2029/4/15 |
| | | MERLIN ENTERTAINMENTS GR | 7.375 | 200 | 204 | 32,975 | 2031/2/15 |
| | | METIS MERGER SUB LLC | 6.5 | 867 | 809 | 130,501 | 2029/5/15 |
| | | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 4.75 | 200 | 190 | 30,749 | 2027/2/1 |
| | | MGM RESORTS INTL | 5.5 | 702 | 688 | 110,913 | 2027/4/15 |
| | | MGM RESORTS INTL | 6.5 | 275 | 273 | 44,068 | 2032/4/15 |
| | | MIDWEST VANADIUM PTY LTD | — | 139 | 0.01397 | 2 | 2033/2/15 |
| | | MINERAL RESOURCES LTD | 9.25 | 225 | 235 | 37,987 | 2028/10/1 |
| | | MITER BRAND / MIWD BORR | 6.75 | 225 | 225 | 36,316 | 2032/4/1 |
| | | MOLINA HEALTHCARE INC | 3.875 | 1,200 | 1,037 | 167,264 | 2032/5/15 |
| | | MOTION BONDCO DAC | 6.625 | 600 | 583 | 94,073 | 2027/11/15 |
| | | MOZART DEBT MERGER SUB | 3.875 | 850 | 782 | 126,168 | 2029/4/1 |
| | | MOZART DEBT MERGER SUB | 5.25 | 675 | 642 | 103,625 | 2029/10/1 |
| | | MPH ACQUISITION HOLDINGS | 5.5 | 75 | 56 | 9,086 | 2028/9/1 |
| | | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 4.625 | 700 | 497 | 80,133 | 2029/8/1 |
| | | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 3.5 | 575 | 366 | 59,086 | 2031/3/15 |
| | | MRT MID PART/MRT MID FIN | 11.5 | 325 | 352 | 56,734 | 2028/2/15 |
| | | MURPHY OIL USA INC | 4.75 | 550 | 519 | 83,770 | 2029/9/15 |
| | | MURPHY OIL USA INC | 3.75 | 250 | 218 | 35,172 | 2031/2/15 |
| | | NABORS INDUSTRIES INC | 9.125 | 83 | 86 | 13,896 | 2030/1/31 |
| | | NABORS INDUSTRIES LTD | 7.25 | 350 | 355 | 57,223 | 2026/1/15 |
| | | NATIONSTAR MTG HLD INC | 6.0 | 225 | 222 | 35,871 | 2027/1/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.5 | 425 | 407 | 65,736 | 2028/8/15 | |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.125 | 200 | 183 | 29,556 | 2030/12/15 | |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.75 | 150 | 140 | 22,692 | 2031/11/15 | |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 7.125 | 250 | 250 | 40,381 | 2032/2/1 | |
| | NAVIENT CORP | 6.75 | 1,325 | 1,334 | 215,074 | 2026/6/15 | |
| | NAVIENT CORP | 5.5 | 525 | 478 | 77,053 | 2029/3/15 | |
| | NAVIENT CORP | 9.375 | 375 | 394 | 63,511 | 2030/7/25 | |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | | |
|------|--------------------------|-------|-------|---------|---------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | NAVIENT CORP | 11.5 | 250 | 275 | 44,400 | 2031/3/15 |
| | NCL CORPORATION LTD | 5.875 | 1,100 | 1,089 | 175,636 | 2026/3/15 |
| | NCL CORPORATION LTD | 8.375 | 275 | 287 | 46,358 | 2028/2/1 |
| | NCL CORPORATION LTD | 8.125 | 175 | 183 | 29,627 | 2029/1/15 |
| | NCL FINANCE LTD | 6.125 | 350 | 345 | 55,641 | 2028/3/15 |
| | NCR ATLEOS ESCROW CORP | 9.5 | 575 | 623 | 100,507 | 2029/4/1 |
| | NCR CORP | 5.0 | 375 | 353 | 57,035 | 2028/10/1 |
| | NCR CORP | 5.25 | 325 | 298 | 48,053 | 2030/10/1 |
| | NEPTUNE BIDCO US INC | 9.29 | 825 | 786 | 126,824 | 2029/4/15 |
| | NEW ENTERPRISE STONE & L | 9.75 | 675 | 690 | 111,299 | 2028/7/15 |
| | NEW ENTERPRISE STONE & L | 5.25 | 425 | 404 | 65,138 | 2028/7/15 |
| | NEW FORTRESS ENERGY INC | 8.75 | 75 | 67 | 10,860 | 2029/3/15 |
| | NEWELL BRANDS INC | 6.625 | 175 | 171 | 27,663 | 2029/9/15 |
| | NEWMARK GROUP INC | 7.5 | 75 | 77 | 12,449 | 2029/1/12 |
| | NEWS CORP | 3.875 | 300 | 276 | 44,637 | 2029/5/15 |
| | NEWS CORP | 5.125 | 350 | 330 | 53,328 | 2032/2/15 |
| | NEXTERA ENERGY OPERATING | 4.25 | 250 | 249 | 40,268 | 2024/7/15 |
| | NGL ENERGY PARTNERS LP | 8.125 | 225 | 228 | 36,842 | 2029/2/15 |
| | NGL ENERGY PARTNERS LP | 8.375 | 275 | 278 | 44,850 | 2032/2/15 |
| | NOBLE FINANCE II LLC | 8.0 | 200 | 207 | 33,465 | 2030/4/15 |
| | NORTHERN OIL AND GAS INC | 8.75 | 200 | 210 | 33,932 | 2031/6/15 |
| | NORTHRIVER MIDSTREAM FIN | 6.75 | 275 | 275 | 44,402 | 2032/7/15 |
| | NORTHWEST ACQ/DOMINION | — | 475 | 0.57475 | 92 | 2022/11/1 |
| | NORTONLIFELOCK INC | 6.75 | 525 | 531 | 85,716 | 2027/9/30 |
| | NORTONLIFELOCK INC | 7.125 | 425 | 435 | 70,151 | 2030/9/30 |
| | NOVA CHEMICALS CORP | 8.5 | 275 | 291 | 47,050 | 2028/11/15 |
| | NOVA CHEMICALS CORP | 9.0 | 400 | 422 | 68,083 | 2030/2/15 |
| | NOVELIS CORP | 4.75 | 800 | 742 | 119,691 | 2030/1/30 |
| | NRG ENERGY INC | 6.625 | 53 | 53 | 8,542 | 2027/1/15 |
| | NRG ENERGY INC | 5.25 | 450 | 431 | 69,550 | 2029/6/15 |
| | NRG ENERGY INC | 7.0 | 250 | 263 | 42,492 | 2033/3/15 |
| | NRG ENERGY INC | 10.25 | 250 | 272 | 43,985 | 2099/3/9 |
| | NUSTAR LOGISTICS LP | 6.375 | 625 | 635 | 102,390 | 2030/10/1 |
| | OCEANEERING INTL INC | 6.0 | 150 | 148 | 23,865 | 2028/2/1 |
| | OLIN CORP | 5.0 | 500 | 470 | 75,900 | 2030/2/1 |
| | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 4.25 | 325 | 294 | 47,465 | 2028/10/1 |
| | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 9.75 | 900 | 952 | 153,562 | 2028/11/15 |
| | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 6.25 | 250 | 229 | 36,911 | 2029/10/1 |
| | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 7.25 | 200 | 198 | 32,045 | 2031/6/15 |
| | ONEMAIN FINANCE CORP | 9.0 | 400 | 421 | 67,926 | 2029/1/15 |
| | ONEMAIN FINANCE CORP | 7.875 | 575 | 592 | 95,439 | 2030/3/15 |
| | ONEMAIN FINANCE CORP | 4.0 | 254 | 218 | 35,204 | 2030/9/15 |
| | ONEMAIN FINANCE CORP | 7.5 | 300 | 303 | 48,862 | 2031/5/15 |
| | ONTARIO GAMING GTA LP | 8.0 | 150 | 153 | 24,811 | 2030/8/1 |
| | OPEN TEXT CORP | 6.9 | 125 | 128 | 20,759 | 2027/12/1 |
| | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 3.875 | 700 | 628 | 101,230 | 2029/12/1 |
| | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 4.125 | 450 | 393 | 63,424 | 2031/12/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | ORGANON & CO/ORGANON FOR | 6.75 | 200 | 198 | 32,066 | 2034/5/15 |
| | ORGANON FINANCE 1 LLC | 5.125 | 400 | 358 | 57,757 | 2031/4/30 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 5.0 | 122 | 118 | 19,049 | 2027/8/15 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 4.25 | 450 | 412 | 66,500 | 2029/1/15 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 7.375 | 250 | 260 | 41,921 | 2031/2/15 |
| | OWENS & MINOR INC | 6.625 | 500 | 456 | 73,587 | 2030/4/1 |
| | OWENS-BROCKWAY | 6.625 | 550 | 549 | 88,531 | 2027/5/13 |
| | OWENS-BROCKWAY | 7.25 | 200 | 199 | 32,112 | 2031/5/15 |
| | OWENS-BROCKWAY | 7.375 | 50 | 50 | 8,067 | 2032/6/1 |
| | PANTHER ESCROW ISSUER | 7.125 | 350 | 354 | 57,076 | 2031/6/1 |
| | PARK INTERMED HOLDINGS | 7.0 | 150 | 151 | 24,442 | 2030/2/1 |
| | PARK RIVER HOLDINGS INC | 5.625 | 725 | 580 | 93,607 | 2029/2/1 |
| | PARK-OHIO INDUSTRIES INC | 6.625 | 371 | 357 | 57,545 | 2027/4/15 |
| | PARKLAND CORP/CANADA | 4.5 | 925 | 848 | 136,794 | 2029/10/1 |
| | PARKLAND CORP/CANADA | 4.625 | 475 | 434 | 69,966 | 2030/5/1 |
| | PATTERN ENERGY OP LP/PAT | 4.5 | 525 | 485 | 78,199 | 2028/8/15 |
| | PBF HOLDING CO LLC | 6.0 | 475 | 462 | 74,561 | 2028/2/15 |
| | PBF HOLDING CO LLC | 7.875 | 275 | 282 | 45,513 | 2030/9/15 |
| | PECF USS INTERMEDIATE HO | 8.0 | 225 | 95 | 15,379 | 2029/11/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 4.25 | 625 | 567 | 91,388 | 2029/2/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 7.875 | 150 | 154 | 24,879 | 2029/12/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 7.125 | 250 | 247 | 39,922 | 2030/11/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 5.75 | 150 | 139 | 22,443 | 2031/9/15 |
| | PERMIAN RESOURC OPTG LLC | 7.0 | 700 | 716 | 115,556 | 2032/1/15 |
| | PG&E CORP | 5.0 | 150 | 144 | 23,211 | 2028/7/1 |
| | PG&E CORP | 5.25 | 462 | 440 | 71,014 | 2030/7/1 |
| | PHINIA INC | 6.75 | 50 | 50 | 8,168 | 2029/4/15 |
| | PICARD MIDCO INC | 6.5 | 600 | 581 | 93,671 | 2029/3/31 |
| | PIKE CORP | 8.625 | 125 | 133 | 21,446 | 2031/1/31 |
| | PLAYTIKA HOLDING CORP | 4.25 | 750 | 660 | 106,408 | 2029/3/15 |
| | PM GENERAL PURCHASER LLC | 9.5 | 250 | 255 | 41,187 | 2028/10/1 |
| | POLAR US BORROWER LLC | 6.75 | 1,025 | 292 | 47,218 | 2026/5/15 |
| | POST HOLDINGS INC | 4.5 | 525 | 470 | 75,870 | 2031/9/15 |
| | POST HOLDINGS INC | 6.25 | 150 | 150 | 24,305 | 2032/2/15 |
| | PRA GROUP INC | 8.375 | 175 | 174 | 28,181 | 2028/2/1 |
| | PRA GROUP INC | 8.875 | 100 | 99 | 16,059 | 2030/1/31 |
| | PRAIRIE ACQUIROR LP | 9.0 | 200 | 206 | 33,262 | 2029/8/1 |
| | PRECISION DRILLING CORP | 7.125 | 253 | 253 | 40,892 | 2026/1/15 |
| | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.625 | 475 | 344 | 55,468 | 2029/9/1 |
| | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.875 | 475 | 324 | 52,244 | 2031/9/1 |
| | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 3.375 | 675 | 625 | 100,849 | 2027/8/31 |
| | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 6.25 | 300 | 296 | 47,785 | 2028/1/15 |
| | PRIMO WATER HOLDINGS INC | 4.375 | 400 | 369 | 59,532 | 2029/4/30 |
| | QUICKEN LOANS LLC/QUICKN | 3.625 | 800 | 725 | 117,000 | 2029/3/1 |
| | RAIN CARBON INC | 12.25 | 725 | 784 | 126,401 | 2029/9/1 |
| | RAISING CANE'S RESTAURAN | 9.375 | 175 | 189 | 30,515 | 2029/5/1 |
| | RAKUTEN GROUP INC | 11.25 | 200 | 214 | 34,545 | 2027/2/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | RAKUTEN GROUP INC | 9.75 | 200 | 207 | 33,503 | 2029/4/15 |
| | RAND PARENT LLC | 8.5 | 325 | 328 | 53,022 | 2030/2/15 |
| | RANGE RESOURCES CORP | 8.25 | 500 | 519 | 83,739 | 2029/1/15 |
| | REALOGY GROUP/CO-ISSUER | 5.25 | 14 | 8 | 1,336 | 2030/4/15 |
| | RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN | 7.25 | 100 | 103 | 16,644 | 2028/7/15 |
| | RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN | 6.5 | 300 | 300 | 48,381 | 2032/4/1 |
| | RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 6.75 | 75 | 76 | 12,319 | 2028/3/15 |
| | RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 7.75 | 700 | 731 | 117,893 | 2031/3/15 |
| | RITHM CAPITAL CORP | 8.0 | 225 | 218 | 35,221 | 2029/4/1 |
| | ROCKET SOFTWARE INC | 9.0 | 450 | 458 | 73,846 | 2028/11/28 |
| | ROCKETMTGE CO-ISSUER INC | 4.0 | 775 | 649 | 104,760 | 2033/10/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.375 | 375 | 370 | 59,653 | 2027/7/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 3.7 | 675 | 630 | 101,618 | 2028/3/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.5 | 1,275 | 1,258 | 202,812 | 2028/4/1 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 7.25 | 150 | 155 | 25,071 | 2030/1/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 6.25 | 175 | 176 | 28,454 | 2032/3/15 |
| | SALLY HOLDINGS/SALLY CAP | 6.75 | 175 | 172 | 27,821 | 2032/3/1 |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 2,182 | 81 | 13,187 | 2021/6/15 |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 1,425 | 53 | 8,612 | 2023/1/15 |
| | SATURN OIL & GAS INC | 9.625 | 125 | 126 | 20,375 | 2029/6/15 |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.0 | 225 | 226 | 36,536 | 2028/5/15 |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.25 | 350 | 356 | 57,510 | 2029/11/15 |
| | SCIH SALT HOLDINGS INC | 6.625 | 1,210 | 1,138 | 183,474 | 2029/5/1 |
| | SCIL IV LLC / SCIL USA H | 5.375 | 700 | 678 | 109,385 | 2026/11/1 |
| | SEADRILL FINANCE LTD | 8.375 | 400 | 417 | 67,332 | 2030/8/1 |
| | SEALED AIR CORP | 6.125 | 75 | 74 | 12,083 | 2028/2/1 |
| | SEALED AIR CORP | 5.0 | 75 | 71 | 11,548 | 2029/4/15 |
| | SEALED AIR CORP | 6.5 | 125 | 124 | 20,131 | 2032/7/15 |
| | SEALED AIR/SEALED AIR US | 7.25 | 125 | 128 | 20,766 | 2031/2/15 |
| | SEASpan CORP | 5.5 | 700 | 622 | 100,290 | 2029/8/1 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.25 | 181 | 175 | 28,270 | 2026/2/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.75 | 250 | 234 | 37,756 | 2026/10/1 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.5 | 200 | 186 | 30,031 | 2027/12/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.95 | 125 | 94 | 15,237 | 2029/10/1 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.375 | 600 | 423 | 68,318 | 2030/2/15 |
| | SHEA HOMES LP/FNDG CP | 4.75 | 200 | 189 | 30,548 | 2028/2/15 |
| | SHELF DRILL HOLD LTD | 9.625 | 275 | 264 | 42,605 | 2029/4/15 |
| | SIGMA HOLDCO BV | 7.875 | 173 | 171 | 27,598 | 2026/5/15 |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 5.5 | 275 | 166 | 26,876 | 2030/3/1 |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 4.125 | 575 | 391 | 63,017 | 2030/12/1 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 4.0 | 1,200 | 1,087 | 175,244 | 2028/7/15 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 5.5 | 475 | 449 | 72,396 | 2029/7/1 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 3.875 | 300 | 247 | 39,857 | 2031/9/1 |
| | SMYRNA READY MIX CONCRET | 8.875 | 500 | 530 | 85,434 | 2031/11/15 |
| | SOTERA HEALTH HLDGS LLC | 7.375 | 275 | 275 | 44,383 | 2031/6/1 |
| | SOUTHWESTERN ENERGY | 5.375 | 644 | 625 | 100,756 | 2029/2/1 |
| | SPECTRUM BRANDS INC | 3.875 | 60 | 50 | 8,078 | 2031/3/15 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | |
|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | 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 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 4.6 | 225 | 212 | 34,220 | 2028/6/15 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 9.375 | 275 | 296 | 47,804 | 2029/11/30 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 9.75 | 225 | 249 | 40,153 | 2030/11/15 |
| | SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP | 8.0 | 600 | 432 | 69,630 | 2025/9/20 |
| | SPRINGLEAF FINANCE CORP | 7.125 | 450 | 458 | 73,882 | 2026/3/15 |
| | SPRINGLEAF FINANCE CORP | 6.625 | 415 | 417 | 67,238 | 2028/1/15 |
| | SPRINT CAPITAL CORP | 8.75 | 325 | 389 | 62,817 | 2032/3/15 |
| | SRM ESCROW ISSUER LLC | 6.0 | 850 | 826 | 133,280 | 2028/11/1 |
| | SS&C TECHNOLOGIES INC | 5.5 | 875 | 862 | 139,027 | 2027/9/30 |
| | SS&C TECHNOLOGIES INC | 6.5 | 400 | 403 | 65,089 | 2032/6/1 |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 5.0 | 100 | 97 | 15,687 | 2027/2/15 |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 4.375 | 775 | 699 | 112,750 | 2030/7/15 |
| | STAPLES INC | 10.75 | 375 | 356 | 57,475 | 2029/9/1 |
| | STAPLES INC | 12.75 | 615 | 470 | 75,785 | 2030/1/15 |
| | STAR PARENT INC | 9.0 | 625 | 656 | 105,882 | 2030/10/1 |
| | STARWOOD PROPERTY TRUST | 7.25 | 275 | 276 | 44,588 | 2029/4/1 |
| | STENA INTERNATIONAL SA | 7.25 | 200 | 205 | 33,085 | 2031/1/15 |
| | STENA INTERNATIONAL SA | 7.625 | 200 | 204 | 32,997 | 2031/2/15 |
| | STL HOLDING CO LLC | 8.75 | 200 | 207 | 33,470 | 2029/2/15 |
| | STONEX GROUP INC | 7.875 | 100 | 103 | 16,632 | 2031/3/1 |
| | STUDIO CITY CO LTD | 7.0 | 200 | 200 | 32,305 | 2027/2/15 |
| | STUDIO CITY FINANCE LTD | 5.0 | 300 | 264 | 42,602 | 2029/1/15 |
| | SUMMIT MATERIALS LLC/FIN | 7.25 | 175 | 181 | 29,212 | 2031/1/15 |
| | SUNNOVA ENERGY CORP | 5.875 | 325 | 254 | 41,072 | 2026/9/1 |
| | SUNOCO LP | 7.0 | 125 | 128 | 20,661 | 2029/5/1 |
| | SUNOCO LP | 7.25 | 125 | 129 | 20,790 | 2032/5/1 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 6.0 | 425 | 424 | 68,427 | 2027/4/15 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 7.0 | 200 | 204 | 33,002 | 2028/9/15 |
| | SURGERY CENTER HOLDINGS | 7.25 | 225 | 227 | 36,689 | 2032/4/15 |
| | SYNCHRONY FINANCIAL | 7.25 | 425 | 426 | 68,702 | 2033/2/2 |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | 8.625 | 250 | 265 | 42,854 | 2030/6/1 |
| | TALLGRASS NRG PRTRN/FIN | 7.375 | 225 | 226 | 36,499 | 2029/2/15 |
| | TALLGRASS NRG PRTRN/FIN | 6.0 | 450 | 419 | 67,630 | 2031/9/1 |
| | TALOS PRODUCTION INC | 9.0 | 200 | 209 | 33,773 | 2029/2/1 |
| | TALOS PRODUCTION INC | 9.375 | 200 | 210 | 33,991 | 2031/2/1 |
| | TASEKO MINES LTD | 8.25 | 125 | 128 | 20,652 | 2030/5/1 |
| | TEINE ENERGY LTD | 6.875 | 625 | 617 | 99,468 | 2029/4/15 |
| | TELECOM ITALIA CAP | 6.0 | 292 | 279 | 45,082 | 2034/9/30 |
| | TELECOM ITALIA CAPITAL | 6.0 | 19 | 17 | 2,749 | 2034/9/30 |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 5.625 | 425 | 198 | 32,069 | 2026/12/6 |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 6.5 | 675 | 207 | 33,521 | 2027/10/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 4.625 | 300 | 285 | 46,071 | 2028/6/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 1,650 | 1,642 | 264,696 | 2028/10/1 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 4.375 | 625 | 577 | 93,015 | 2030/1/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 475 | 472 | 76,170 | 2030/6/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 6.75 | 275 | 280 | 45,133 | 2031/5/15 |
| | TENNECO INC | 8.0 | 325 | 296 | 47,715 | 2028/11/17 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|--------------------------|-------|-------|--------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| | 普通社債券 (含む投資法人横断) | TERRAFORM POWER OPERATIN | 4.75 | 1,100 | 1,003 | 161,797 | 2030/1/15 |
| | | THOR INDUSTRIES | 4.0 | 225 | 199 | 32,129 | 2029/10/15 |
| | | TMS INTERNATIONAL CORP | 6.25 | 703 | 643 | 103,786 | 2029/4/15 |
| | | TOPS HOLDING II ESCROW | — | 1,191 | — | — | 2022/6/15 |
| | | TRANSALTA CORP | 7.75 | 550 | 573 | 92,373 | 2029/11/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 5.5 | 1,775 | 1,740 | 280,558 | 2027/11/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.75 | 475 | 481 | 77,610 | 2028/8/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 4.625 | 900 | 840 | 135,487 | 2029/1/15 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.375 | 350 | 352 | 56,818 | 2029/3/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 4.875 | 550 | 517 | 83,353 | 2029/5/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 7.125 | 200 | 206 | 33,223 | 2031/12/1 |
| | | TRANSDIGM INC | 6.625 | 200 | 202 | 32,558 | 2032/3/1 |
| | | TRANSOCEAN AQUILA LTD | 8.0 | 150 | 152 | 24,577 | 2028/9/30 |
| | | TRANSOCEAN INC | 8.0 | 343 | 342 | 55,241 | 2027/2/1 |
| | | TRANSOCEAN INC | 8.75 | 157 | 164 | 26,540 | 2030/2/15 |
| | | TRANSOCEAN INC | 6.8 | 575 | 475 | 76,648 | 2038/3/15 |
| | | TRANSOCEAN INC | 9.35 | 425 | 391 | 63,135 | 2041/12/15 |
| | | TRANSOCEAN SEDCO FOREX | 7.5 | 375 | 349 | 56,353 | 2031/4/15 |
| | | TRANSOCEAN TITAN FIN LTD | 8.375 | 100 | 103 | 16,617 | 2028/2/1 |
| | | TRIDENT TPI HOLDINGS INC | 12.75 | 500 | 547 | 88,169 | 2028/12/31 |
| | | TRINITY INDUSTRIES INC | 7.75 | 450 | 465 | 75,073 | 2028/7/15 |
| | | TRINSEO OP / TRINSEO FIN | 5.125 | 175 | 68 | 10,965 | 2029/4/1 |
| | | TRIUMPH GROUP INC | 9.0 | 259 | 272 | 43,880 | 2028/3/15 |
| | | TRONOX INC | 4.625 | 675 | 609 | 98,216 | 2029/3/15 |
| | | UBER TECHNOLOGIES INC | 7.5 | 700 | 714 | 115,136 | 2027/9/15 |
| | | UBER TECHNOLOGIES INC | 6.25 | 350 | 351 | 56,683 | 2028/1/15 |
| | | UNICREDIT SPA | 5.459 | 400 | 376 | 60,668 | 2035/6/30 |
| | | UNITED AIRLINES HOLDINGS | 4.875 | 150 | 149 | 24,036 | 2025/1/15 |
| | | UNITED AIRLINES INC | 4.375 | 350 | 338 | 54,505 | 2026/4/15 |
| | | UNITED AIRLINES INC | 4.625 | 350 | 326 | 52,542 | 2029/4/15 |
| | | UNITED RENTALS NORTH AM | 4.0 | 175 | 158 | 25,612 | 2030/7/15 |
| | | UNITED RENTALS NORTH AM | 3.875 | 100 | 89 | 14,363 | 2031/2/15 |
| | | UNITED RENTALS NORTH AM | 3.75 | 300 | 261 | 42,115 | 2032/1/15 |
| | | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.75 | 300 | 294 | 47,417 | 2027/6/15 |
| | | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.5 | 450 | 427 | 68,958 | 2029/4/15 |
| | | UNITI GROUP/CSL CAPITAL | 10.5 | 525 | 513 | 82,731 | 2028/2/15 |
| | | UNIVISION COMMUNICATIONS | 8.0 | 225 | 218 | 35,248 | 2028/8/15 |
| | | UNIVISION COMMUNICATIONS | 4.5 | 350 | 294 | 47,475 | 2029/5/1 |
| | | UNIVISION COMMUNICATIONS | 7.375 | 350 | 325 | 52,492 | 2030/6/30 |
| | | UPC BROADBAND FINCO BV | 4.875 | 1,000 | 899 | 144,978 | 2031/7/15 |
| | | UPC HOLDING BV | 5.5 | 400 | 386 | 62,304 | 2028/1/15 |
| | | US ACUTE CARE SOLUTIONS | 9.75 | 300 | 295 | 47,684 | 2029/5/15 |
| | | US FOODS INC | 6.875 | 175 | 178 | 28,819 | 2028/9/15 |
| | | US FOODS INC | 4.75 | 275 | 261 | 42,114 | 2029/2/15 |
| | | US FOODS INC | 7.25 | 150 | 155 | 25,112 | 2032/1/15 |
| | | USA COM PART/USA COM FIN | 7.125 | 275 | 277 | 44,788 | 2029/3/15 |
| | | USI INC/NY | 7.5 | 100 | 101 | 16,320 | 2032/1/15 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------------|-------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人横断) | | | | | |
| | VALARIS LTD | 8.375 | 600 | 621 | 100,121 | 2030/4/30 |
| | VALEANT PHARMACEUTICALS | 9.0 | 550 | 507 | 81,760 | 2025/12/15 |
| | VALLLOUREC SACA | 7.5 | 200 | 206 | 33,354 | 2032/4/15 |
| | VANTAGE DRILL | 9.5 | 250 | 254 | 40,978 | 2028/2/15 |
| | VELOCITY VEHICLE GROUP | 8.0 | 100 | 102 | 16,581 | 2029/6/1 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 6.25 | 325 | 328 | 52,993 | 2030/1/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 4.125 | 425 | 379 | 61,158 | 2031/8/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 3.875 | 425 | 362 | 58,369 | 2033/11/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 8.125 | 675 | 697 | 112,394 | 2028/6/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 9.5 | 325 | 357 | 57,543 | 2029/2/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 8.375 | 675 | 698 | 112,559 | 2031/6/1 |
| | VENTURE GLOBAL LNG INC | 9.875 | 525 | 572 | 92,348 | 2032/2/1 |
| | VERMILION ENERGY INC | 6.875 | 350 | 345 | 55,707 | 2030/5/1 |
| | VFH PARENT / VALOR CO | 7.5 | 100 | 100 | 16,270 | 2031/6/15 |
| | VIASAT INC | 7.5 | 75 | 50 | 8,149 | 2031/5/30 |
| | VICTORS MERGER CORP | 6.375 | 300 | 195 | 31,506 | 2029/5/15 |
| | VIKING CRUISES LTD | 9.125 | 525 | 569 | 91,755 | 2031/7/15 |
| | VIKING OCEAN CRUISES SHI | 5.625 | 225 | 220 | 35,501 | 2029/2/15 |
| | VIPER ENERGY PARTNERS LP | 5.375 | 700 | 686 | 110,631 | 2027/11/1 |
| | VIRGIN AUSTRALIA HOLDING | — | 209 | 0.60329 | 97 | 2024/11/15 |
| | VISTAJET MALTA/VM HOLDS | 9.5 | 250 | 215 | 34,685 | 2028/6/1 |
| | VISTAJET MALTA/XO MGMT | 7.875 | 325 | 285 | 46,047 | 2027/5/1 |
| | VISTAJET MALTA/XO MGMT | 6.375 | 575 | 452 | 72,944 | 2030/2/1 |
| | VISTRA CORP | 7.0 | 850 | 840 | 135,405 | 2099/12/10 |
| | VISTRA OPERATIONS CO LLC | 7.75 | 1,000 | 1,043 | 168,215 | 2031/10/15 |
| | VISTRA OPERATIONS CO LLC | 6.875 | 475 | 482 | 77,820 | 2032/4/15 |
| | VITAL ENERGY INC | 7.875 | 225 | 229 | 37,048 | 2032/4/15 |
| | VMED O2 UK FINAN | 4.75 | 200 | 168 | 27,097 | 2031/7/15 |
| | VMED O2 UK FINANCING I | 4.25 | 600 | 497 | 80,143 | 2031/1/31 |
| | WASH MULTIFAM ACQ INC | 5.75 | 475 | 465 | 75,000 | 2026/4/15 |
| | WEATHERFORD INTERNATIONAL | 8.625 | 1,475 | 1,529 | 246,497 | 2030/4/30 |
| | WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN | 4.875 | 600 | 558 | 89,983 | 2028/9/15 |
| | WERNER FINCO LP/INC | 11.5 | 225 | 244 | 39,485 | 2028/6/15 |
| | WERNER FINCO LP/INC | 8.75 | 1,072 | 1,068 | 172,232 | 2028/10/15 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 5.3 | 600 | 512 | 82,532 | 2048/3/1 |
| | WHITE CAP BUYER LLC | 6.875 | 550 | 535 | 86,324 | 2028/10/15 |
| | WHITE CAP PARENT LLC | 8.25 | 625 | 624 | 100,716 | 2026/3/15 |
| | WILLIAMS SCOTSMAN INC | 6.625 | 100 | 100 | 16,252 | 2029/6/15 |
| | WINDSOR HOLDINGS III LLC | 8.5 | 200 | 208 | 33,585 | 2030/6/15 |
| | WORLD ACCEPTANCE CORP | 7.0 | 625 | 597 | 96,305 | 2026/11/1 |
| | WR GRACE HOLDING LLC | 5.625 | 1,075 | 981 | 158,247 | 2029/8/15 |
| | WR GRACE HOLDING LLC | 7.375 | 150 | 152 | 24,564 | 2031/3/1 |
| | WYNDHAM DESTINATIONS INC | 6.625 | 600 | 603 | 97,322 | 2026/7/31 |
| | WYNN MACAU LTD | 5.625 | 350 | 328 | 52,911 | 2028/8/26 |
| | WYNN MACAU LTD | 5.125 | 875 | 792 | 127,709 | 2029/12/15 |
| | WYNN RESORTS FINANCE LLC | 5.125 | 150 | 142 | 22,900 | 2029/10/1 |
| | WYNN RESORTS FINANCE LLC | 7.125 | 225 | 232 | 37,482 | 2031/2/15 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | |
|------|-------------------------|-------|------|-------|------------|------------|
| | | 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 | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債類) | | | | | |
| | XEROX HOLDINGS CORP | 8.875 | 100 | 93 | 15,097 | 2029/11/30 |
| | XPO INC | 7.125 | 125 | 127 | 20,589 | 2031/6/1 |
| | XPO INC | 7.125 | 175 | 179 | 28,911 | 2032/2/1 |
| | YUM! BRANDS INC | 5.375 | 425 | 407 | 65,652 | 2032/4/1 |
| | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | 6.5 | 150 | 151 | 24,450 | 2032/6/1 |
| | ZF NA CAPITAL | 6.875 | 150 | 152 | 24,620 | 2028/4/14 |
| | ZF NA CAPITAL | 7.125 | 150 | 155 | 25,013 | 2030/4/14 |
| | ZF NA CAPITAL | 6.75 | 300 | 304 | 49,116 | 2030/4/23 |
| | ZF NA CAPITAL | 6.875 | 300 | 309 | 49,816 | 2032/4/23 |
| | ZIGGO BOND CO BV | 5.125 | 200 | 170 | 27,538 | 2030/2/28 |
| | ZIGGO BV | 4.875 | 200 | 179 | 28,916 | 2030/1/15 |
| 合 | 計 | | | | 43,374,269 | |

*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。

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

○投資信託財産の構成

(2024年7月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 479,568 | 1.1 |
| 新株予約権証券 | 882 | 0.0 |
| 新株予約権付社債(転換社債) | 48,580 | 0.1 |
| 公社債 | 43,325,688 | 95.4 |
| コール・ローン等、その他 | 1,580,559 | 3.4 |
| 投資信託財産総額 | 45,435,277 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建純資産(44,890,446千円)の投資信託財産総額(45,435,277千円)に対する比率は98.8%です。

*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。1米ドル=161.17円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年7月5日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 45,580,264,844 |
| コール・ローン等 | 788,232,501 |
| 株式(評価額) | 479,568,831 |
| 新株予約権証券(評価額) | 882,244 |
| 公社債(評価額) | 43,374,269,161 |
| 未収入金 | 149,362,324 |
| 未収利息 | 769,155,292 |
| 前払費用 | 18,794,491 |
| (B) 負債 | 426,447,245 |
| 未払金 | 241,770,245 |
| 未払解約金 | 184,677,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 45,153,817,599 |
| 元本 | 8,145,824,943 |
| 次期繰越損益金 | 37,007,992,656 |
| (D) 受益権総口数 | 8,145,824,943口 |
| 1口当たり基準価額(C/D) | 55,432円 |

(注) 期首元本額は9,566,148,037円、期中追加設定元本額は671,900,913円、期中一部解約元本額は2,092,224,007円、1口当たり純資産額は5.5432円です。

○損益の状況 (2023年7月6日～2024年7月5日)

| 項目 | 当期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 3,125,379,811 |
| 受取配当金 | 388,093 |
| 受取利息 | 3,104,073,095 |
| その他収益金 | 21,012,579 |
| 支払利息 | △ 93,956 |
| (B) 有価証券売買損益 | 6,044,660,343 |
| 売買益 | 7,085,338,163 |
| 売買損 | △ 1,040,677,820 |
| (C) 保管費用等 | △ 24,458,655 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 9,145,581,499 |
| (E) 前期繰越損益金 | 33,481,055,663 |
| (F) 追加信託差損益金 | 2,539,762,487 |
| (G) 解約差損益金 | △ 8,158,406,993 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 37,007,992,656 |
| 次期繰越損益金(H) | 37,007,992,656 |

* 損益の状況の中で(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。

* 損益の状況の中で(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。

* 損益の状況の中で(G)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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|----------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 高利回り社債オープン | 3,954,104,677 |
| 野村米国ハイ・イールド・ファンド(毎月決算型) | 2,519,919,580 |
| 高利回り社債オープン・為替ヘッジ | 1,029,736,770 |
| 野村米国ハイ・イールド・ファンド(毎月決算型) 為替ヘッジあり | 229,394,276 |
| 野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型) | 180,036,393 |
| 高利回り社債オープン(年1回決算型) | 75,311,386 |
| ラップ専用・米国ハイ・イールド債券アクティブ | 69,922,162 |
| 高利回り社債オープン・為替ヘッジ(年1回決算型) | 54,361,646 |
| 野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型) 為替ヘッジあり | 23,281,216 |
| 高利回り社債オープンVA(適格機関投資家専用) | 9,756,837 |

○お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する所要の約款変更を行ないました。

＜変更適用日：2024年7月4日＞