

■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 | 2009年11月6日から2024年10月8日までです。 | |
| 運用方針 | 米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行う、「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (IH3シェアクラス、豪ドル)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。 | |
| 主要運用対象 | アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド (豪ドルコース) | ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (IH3シェアクラス、豪ドル) CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用) |
| | ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (IH3シェアクラス、豪ドル) | 米ドル建のハイイールド債 |
| | CAマネーブルファンド (適格機関投資家専用) | 本邦通貨表示の短期公社債 |
| 組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。原則として外貨建資産への直接投資は行いません。 | |
| 分配方針 | 毎決算時 (年12回、原則毎月8日。休業日の場合は翌営業日) に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 | |

アムンディ・リそな米国
ハイ・イールド債券ファンド
(豪ドルコース)運用報告書 (全体版)
第27作成期

| | | |
|-------|------|-------------|
| 第155期 | (決算日 | 2022年11月8日) |
| 第156期 | (決算日 | 2022年12月8日) |
| 第157期 | (決算日 | 2023年1月10日) |
| 第158期 | (決算日 | 2023年2月8日) |
| 第159期 | (決算日 | 2023年3月8日) |
| 第160期 | (決算日 | 2023年4月10日) |

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、作成期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン: 050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス: <https://www.amundi.co.jp/>

<2860259・2871338>

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

■最近5作成期の運用実績

| | 決 算 期 | 基 準 価 額 (分配落) | 騰 落 中 率 | | | 投 資 信 託 組 益 証 券 入 比 率 | 投 資 証 券 組 入 比 率 | 純資産総額 |
|--------|--------------------|------------------|-----------|-------|-----|-----------------------------|--------------------|-------|
| | | | 税 込 分 配 金 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| 第23作成期 | | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 | |
| | 131期 (2020年11月9日) | 3,790 | 30 | 0.6 | 0.4 | 98.5 | 6,485 | |
| | 132期 (2020年12月8日) | 3,984 | 30 | 5.9 | 0.3 | 98.4 | 6,698 | |
| | 133期 (2021年1月8日) | 4,166 | 30 | 5.3 | 0.3 | 98.4 | 6,888 | |
| | 134期 (2021年2月8日) | 4,196 | 30 | 1.4 | 0.3 | 98.4 | 6,744 | |
| | 135期 (2021年3月8日) | 4,288 | 30 | 2.9 | 0.3 | 98.4 | 6,708 | |
| 第24作成期 | 136期 (2021年4月8日) | 4,303 | 30 | 1.0 | 0.3 | 98.4 | 6,593 | |
| | 137期 (2021年5月10日) | 4,396 | 30 | 2.9 | 0.3 | 98.1 | 6,661 | |
| | 138期 (2021年6月8日) | 4,341 | 30 | △ 0.6 | 0.4 | 98.5 | 6,420 | |
| | 139期 (2021年7月8日) | 4,247 | 30 | △ 1.5 | 0.4 | 98.3 | 6,184 | |
| | 140期 (2021年8月10日) | 4,101 | 30 | △ 2.7 | 0.4 | 98.1 | 5,932 | |
| | 141期 (2021年9月8日) | 4,141 | 30 | 1.7 | 0.4 | 98.5 | 5,893 | |
| 第25作成期 | 142期 (2021年10月8日) | 4,109 | 30 | △ 0.0 | 0.4 | 98.6 | 5,723 | |
| | 143期 (2021年11月8日) | 4,210 | 30 | 3.2 | 0.4 | 98.3 | 5,654 | |
| | 144期 (2021年12月8日) | 4,000 | 30 | △ 4.3 | 0.4 | 98.3 | 5,282 | |
| | 145期 (2022年1月11日) | 4,048 | 30 | 2.0 | 0.4 | 98.3 | 5,293 | |
| | 146期 (2022年2月8日) | 3,899 | 30 | △ 2.9 | 0.5 | 98.2 | 5,045 | |
| | 147期 (2022年3月8日) | 3,934 | 30 | 1.7 | 0.5 | 98.3 | 5,051 | |
| 第26作成期 | 148期 (2022年4月8日) | 4,209 | 30 | 7.8 | 0.4 | 98.2 | 5,305 | |
| | 149期 (2022年5月9日) | 3,980 | 30 | △ 4.7 | 0.5 | 97.5 | 4,849 | |
| | 150期 (2022年6月8日) | 4,128 | 30 | 4.5 | 0.5 | 98.2 | 4,964 | |
| | 151期 (2022年7月8日) | 3,793 | 30 | △ 7.4 | 0.5 | 98.1 | 4,484 | |
| | 152期 (2022年8月8日) | 3,941 | 30 | 4.7 | 0.5 | 98.2 | 4,640 | |
| | 153期 (2022年9月8日) | 3,953 | 30 | 1.1 | 0.5 | 98.0 | 4,613 | |
| 第27作成期 | 154期 (2022年10月11日) | 3,589 | 30 | △ 8.4 | 0.6 | 97.6 | 4,118 | |
| | 155期 (2022年11月8日) | 3,693 | 30 | 3.7 | 0.5 | 97.8 | 4,213 | |
| | 156期 (2022年12月8日) | 3,645 | 30 | △ 0.5 | 0.6 | 98.0 | 4,060 | |
| | 157期 (2023年1月10日) | 3,642 | 30 | 0.7 | 0.6 | 97.8 | 4,045 | |
| | 158期 (2023年2月8日) | 3,657 | 30 | 1.2 | 0.6 | 97.8 | 4,047 | |
| | 159期 (2023年3月8日) | 3,551 | 30 | △ 2.1 | 0.6 | 97.8 | 3,915 | |
| | 160期 (2023年4月10日) | 3,465 | 30 | △ 1.6 | 0.6 | 97.8 | 3,802 | |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けていません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

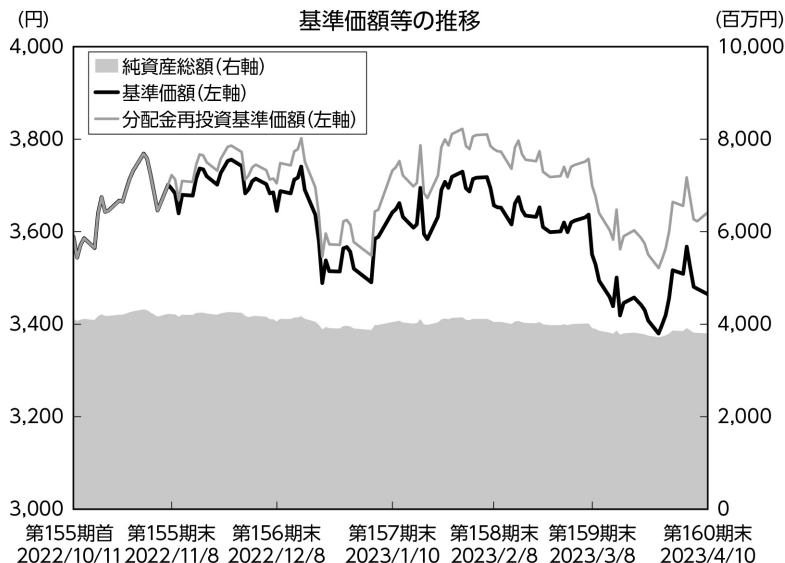
■ 当作成期中の基準価額等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基準価額 | 騰 落 率 | | 投 資 信 託 証券 組 入 証 券 率 | 投 資 証 券 組 入 証 券 率 |
|-------|------------------|-------|-------|---|-------------------------|----------------------|
| | | | | | | |
| 第155期 | | 円 | | % | % | % |
| | (期 首)2022年10月11日 | 3,589 | — | — | 0.6 | 97.6 |
| | 10月末 | 3,769 | 5.0 | — | 0.5 | 97.9 |
| 第156期 | (期 末)2022年11月8日 | 3,723 | 3.7 | — | 0.5 | 97.8 |
| | (期 首)2022年11月8日 | 3,693 | — | — | 0.5 | 97.8 |
| | 11月末 | 3,692 | △0.0 | — | 0.6 | 97.9 |
| 第157期 | (期 末)2022年12月8日 | 3,675 | △0.5 | — | 0.6 | 98.0 |
| | (期 首)2022年12月8日 | 3,645 | — | — | 0.6 | 98.0 |
| | 12月末 | 3,520 | △3.4 | — | 0.6 | 98.1 |
| 第158期 | (期 末)2023年1月10日 | 3,672 | 0.7 | — | 0.6 | 97.8 |
| | (期 首)2023年1月10日 | 3,642 | — | — | 0.6 | 97.8 |
| | 1月末 | 3,694 | 1.4 | — | 0.6 | 98.1 |
| 第159期 | (期 末)2023年2月8日 | 3,687 | 1.2 | — | 0.6 | 97.8 |
| | (期 首)2023年2月8日 | 3,657 | — | — | 0.6 | 97.8 |
| | 2月末 | 3,620 | △1.0 | — | 0.6 | 98.0 |
| 第160期 | (期 末)2023年3月8日 | 3,581 | △2.1 | — | 0.6 | 97.8 |
| | (期 首)2023年3月8日 | 3,551 | — | — | 0.6 | 97.8 |
| | 3月末 | 3,517 | △1.0 | — | 0.6 | 98.2 |
| | (期 末)2023年4月10日 | 3,495 | △1.6 | — | 0.6 | 97.8 |

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

【基準価額等の推移】

| | |
|----------------|---------------------|
| 第155期首 | 3,589円 |
| 第160期末 | 3,465円 |
| 既払分配金 (税込み) | 180円 |
| 騰落率 | 1.5% (分配金再投資ベース) |



(注1) 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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 実際のファンドにおいては、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。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2022年10月11日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ①10月から11月、2023年1月に、米国ハイイールド債市場が上昇したこと
- ②10月、2023年1月に、豪ドル高・円安傾向となったこと

下落要因

- ①2023年2月から3月前半にかけて、米国ハイイールド債市場が下落したこと
- ②11月から12月、2023年3月に、豪ドル安・円高傾向となったこと

【投資環境】

<米国ハイイールド債券市場>

当作成期の米国ハイイールド債券市場は、利上げペースが緩やかになるとの見方が台頭し、市場ではタカ派的な姿勢のFRB（米連邦準備理事会）に対する懸念が後退したことを受けて、上昇して始まりました。米国経済は引き続き緩やかな景気減速の兆候を示し、12月にFRBは市場予想通り政策金利を0.50%引き上げました。このことを受けて市場は下落しましたが、2023年1月にはインフレ率の低下の兆候が広範に影響し、市場は上昇しました。2月は非農業部門雇用者数や小売売上高など多数の経済データが堅調となったことを受けて、インフレ再燃の兆候が金利に影響し、米国国債利回りは上昇（債券価額は下落）し、ハイイールド債市場は下

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

落しました。3月は相次ぐ銀行破綻を受けて米国国債の金利は急低下（債券価格は上昇）し、市場センチメントは大きく変動しましたが、FRBおよび他の中央銀行などが迅速な対応を行ったことで銀行危機に対する懸念は緩和傾向をみせ、市場はやや上昇しました。ICE BofA US High Yield Constrained Index（以下、「米国ハイイールド債券指数」）が示す当作成期のリターンはプラスとなりました。格付別では、B格債、BB格債、CCC格債の順となりました。過去12カ月の発行額面ベースのデフォルト（債務不履行）率は前作成期末比で上昇しました。

<為替市場>

当作成期、豪ドル/円相場は91円台で始まり、オーストラリアCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことなどから95円台へ上昇しました。その後、オーストラリアの小売売上高が市場予想を下回ったことや、オーストラリアの長期金利が低下（債券価格は上昇）したことなどを受け下落しました。その後、オーストラリアのインフレの鈍化が確認されたことや、年末には日本銀行が金融政策の修正を発表し、日本国内でも金融引き締め懸念が広がったことなどから円が買われ、豪ドルは下落しました。年が明け、堅調なオーストラリア経済指標や日本の金融政策の追加修正が行われなかったこと、オーストラリア準備銀行（中央銀行）の利上げ継続姿勢や鉄鉱石価格の上昇なども受け、もみ合いながら上昇基調となりました。3月に入り、グローバルに金融システムへの不安が高まるなか円が買われ、豪ドルは再び下落した後、88円台で当作成期末を迎えました。

<日本の短期国債市場>

当作成期の短期国債市場では、日本銀行によるマイナス金利政策のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りは、引き続きマイナス圏で推移しました。3月中旬には欧米の銀行に対する信用不安が高まるなど金融市場への不透明感からTDBへの需要も高まり、利回りはマイナス幅を広げ、一時-0.25%を下回る局面もみられました。また、内外金利差等を背景とした海外投資家からの需要も継続しており、TDBの需給をサポートしました。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする外国籍投資信託「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」に投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」に90%以上投資することを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期初より当該投資信託を高位に組み込まれました。なお、国内籍投資信託「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

<ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）>

ポートフォリオにおいては、金融引き締めの影響を受けやすいBB格債を米国ハイイールド債券指数対比でアンダーウェイトし、経済回復の恩恵を受けやすいと考えられるB格債をオーバーウェイト、CCC格債をおおむね同ウェイトとしました。セクター別では、割安であると判断したレジャー、金融サービスなどをオーバーウェイトした一方、割高であると判断した資本財、通信、公益などをアンダーウェイトしました。当作成期、景気減速とタイトなクレジット状況に耐えうる財務力を有する発行体に焦点を当てた銘柄選定に注力しました。レジャーにおいては、業績回復のシナリオを引き続き注視しました。

（ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク）

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

米ドル建資産に対し、米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行い、当作成期を通じて豪ドルのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

当作成期、主として12ヵ月以内に償還を迎える地方債への投資により、安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

【分配金】

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、分配を行いました（各期の分配金額および分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

<当ファンド>

当ファンドが投資する「ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

<ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド（IH3シェアクラス、豪ドル）>

今後、金融引き締めレベルとそのスピードが最終的に経済活動を鈍化させると予想されますが、経済成長は引き続き堅調であるとみています。消費者の累積貯蓄額に加え、エネルギーや旅行など特定のセクターが堅調であることがプラス要因になるとみていますが、最悪の場合には緩やかな景気後退が予想されます。銀行不安が緩和傾向にあることから、投資家はハイイールド債の魅力的水準のキャリーや、ハイイールド債発行体が相対的に堅調なキャッシュフローを創出していること、新規発行が少額であることなどといった点に再度着目し始めてるとみています。銀行不安の再燃を警戒するとともに、信用状況の悪化が経済成長に与える影響について引き続き注視していきますが、現状のハイイールド債市場の利回り水準は、投資家にとって魅力的なエントリーポイントになると考えています。

（ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク）

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き米ドル建資産に対し、米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を継続いたします。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

■ 1万口当たりの費用明細

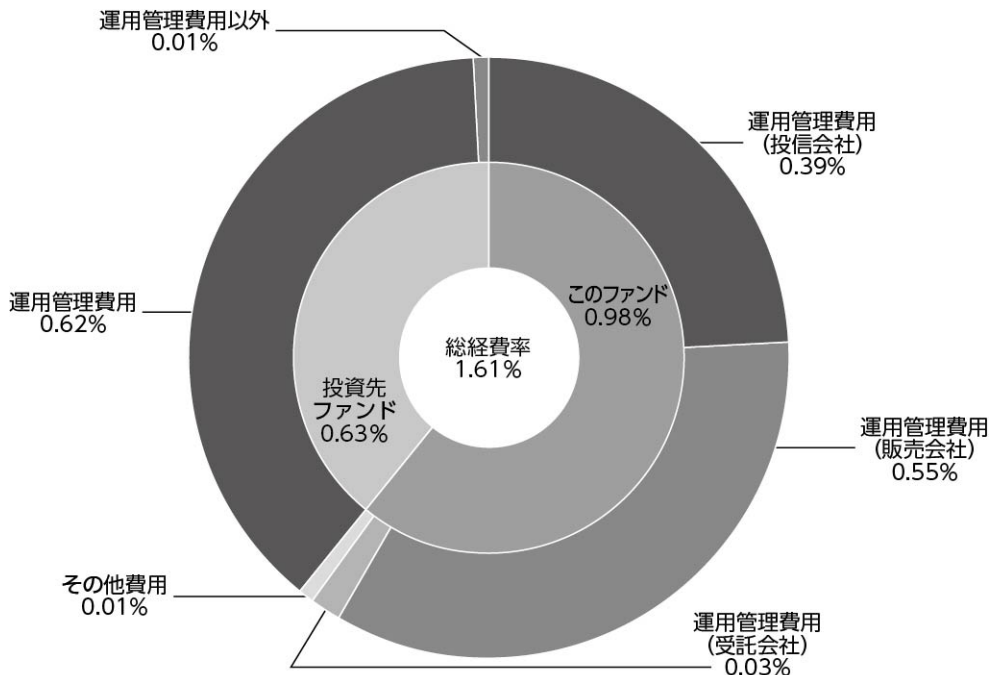
| 項 目 | 第155期～第160期 (2022年10月12日 ～2023年4月10日) | | 項 目 の 概 要 |
|--|---|------------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 17円 (7) (10) | 0.480% (0.191) (0.273) | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (そ の 他) | 0 (0) (0) | 0.005 (0.005) (0.000) | その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 17 | 0.485 | |
| 期中の平均基準価額は3,635円です。 | | | |

- (注1) 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。
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。
(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。
(注5) 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。

（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、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.61%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.61% |
| ①このファンドの費用の比率 | 0.98% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.62% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.01% |

(注1) ①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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注6) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

■売買及び取引の状況（2022年10月12日から2023年4月10日まで）

投資信託受益証券、投資証券

| 決 算 期 | | 第 155 期 ～ 第 160 期 | | | |
|-------|---|-------------------|-----------------|-------------|-------------------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 外国 | (ルクセンブルク) ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (IH3シェアクラス、豪ドル) | 口 — | 千オーストラリアドル — | 口 14,000 | 千オーストラリアドル 880 |

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

■利害関係人との取引状況等（2022年10月12日から2023年4月10日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細（2023年4月10日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

| 銘 柄 | | 第26作成期末 (第154期末) | 第27作成期末（第160期末） | |
|-------------------------|---------------|---------------------|-----------------|--------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| CAマネープールファンド（適格機関投資家専用） | | 口 22,815,532 | 口 22,815,532 | 千円 22,877 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 22,815,532 | 22,815,532 | 22,877 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | <0.6%> |

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 外国（外貨建）投資証券

| 銘 柄 | | 第26作成期末 (第154期末) | 第27作成期末（第160期末） | | |
|--|---------------|---------------------|-----------------|----------------------|-----------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |
| (ルクセンブルク) ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ ボンド (IH3シェアクラス、豪ドル) | | 口 708,200 | 口 694,200 | 千オーストラリアドル 42,103 | 千円 3,720,246 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 708,200 | 694,200 | 42,103 | 3,720,246 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <97.8%> |

(注) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価を日本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。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド (豪ドルコース)

■投資信託財産の構成 (2023年4月10日現在)

| 項 目 | 第 27 作 成 期 末 (第 160 期 末) | |
|-------------------------|--------------------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 22,877 | 0.6 |
| 投 資 証 券 | 3,720,246 | 96.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 95,409 | 2.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 3,838,532 | 100.0 |

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産 (3,720,246千円) の投資信託財産総額 (3,838,532千円) に対する比率は96.9%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年4月10日現在における邦貨換算レートは、1 オーストラリアドル=88.36円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第 155 期 末 (2022年11月8日) | 第 156 期 末 (2022年12月8日) | 第 157 期 末 (2023年1月10日) | 第 158 期 末 (2023年2月8日) | 第 159 期 末 (2023年3月8日) | 第 160 期 末 (2023年4月10日) |
|-------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------------|
| (A) 資 産 | 4,256,054,183円 | 4,101,178,342円 | 4,082,433,883円 | 4,086,216,500円 | 3,960,513,602円 | 3,838,532,611円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 110,110,678 | 98,619,799 | 101,898,033 | 103,663,053 | 109,722,544 | 95,409,393 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 22,886,260 | 22,881,697 | 22,870,289 | 22,877,133 | 22,879,415 | 22,877,133 |
| 投 資 証 券(評価額) | 4,123,057,245 | 3,979,676,846 | 3,957,665,561 | 3,959,676,314 | 3,827,911,643 | 3,720,246,085 |
| (B) 負 債 | 42,360,388 | 40,366,052 | 36,932,568 | 38,731,960 | 45,418,900 | 36,459,211 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 34,231,194 | 33,419,528 | 33,321,301 | 33,207,799 | 33,079,412 | 32,916,364 |
| 未 払 解 約 金 | 4,980,736 | 3,528,753 | — | 2,248,121 | 9,181,181 | — |
| 未 払 信 託 報 酬 | 3,114,474 | 3,347,881 | 3,503,197 | 3,134,365 | 2,984,033 | 3,332,857 |
| 未 払 利 息 | 301 | — | 293 | — | 327 | — |
| そ の 他 未 払 費 用 | 33,683 | 69,890 | 107,777 | 141,675 | 173,947 | 209,990 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 4,213,693,795 | 4,060,812,290 | 4,045,501,315 | 4,047,484,540 | 3,915,094,702 | 3,802,073,400 |
| 元 本 | 11,410,398,007 | 11,139,842,825 | 11,107,100,659 | 11,069,266,421 | 11,026,470,782 | 10,972,121,401 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △7,196,704,212 | △7,079,030,535 | △7,061,599,344 | △7,021,781,881 | △7,111,376,080 | △7,170,048,001 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 11,410,398,007口 | 11,139,842,825口 | 11,107,100,659口 | 11,069,266,421口 | 11,026,470,782口 | 10,972,121,401口 |
| 1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D) | 3,693円 | 3,645円 | 3,642円 | 3,657円 | 3,551円 | 3,465円 |

(注記事項)

作成期首元本額 11,472,533,887円

作成期中追加設定元本額 149,261,517円

作成期中一部解約元本額 649,674,003円

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

■損益の状況

| 項 目 | 第 155 期 自2022年10月12日 至2022年11月8日 | 第 156 期 自2022年11月9日 至2022年12月8日 | 第 157 期 自2022年12月9日 至2023年1月10日 | 第 158 期 自2023年1月11日 至2023年2月8日 | 第 159 期 自2023年2月9日 至2023年3月8日 | 第 160 期 自2023年3月9日 至2023年4月10日 |
|-------------------------|--|---------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|
| (A) 配 当 等 收 益 | 53,634,870円 | 50,734,878円 | 50,588,255円 | 50,563,452円 | 50,111,833円 | 49,063,823円 |
| 受 取 配 当 金 | 53,754,572 | 50,753,738 | 50,593,360 | 50,612,932 | 50,122,573 | 49,075,839 |
| 支 払 利 息 | △ 119,702 | △ 18,860 | △ 5,105 | △ 49,480 | △ 10,740 | △ 12,016 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 101,642,691 | △ 66,966,351 | △ 17,112,973 | 1,565,837 | △ 130,774,857 | △ 106,501,349 |
| 売 買 益 | 136,057,963 | 76,575,428 | 8,862,422 | 3,670,662 | 578,554 | 216,403 |
| 売 買 損 | △ 34,415,272 | △ 143,541,779 | △ 25,975,395 | △ 2,104,825 | △ 131,353,411 | △ 106,717,752 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 3,148,638 | △ 3,385,784 | △ 3,541,728 | △ 3,171,349 | △ 3,017,897 | △ 3,370,178 |
| (D) 当 期 繰 上 益 金 (A+B+C) | 152,128,923 | △ 19,617,257 | 29,933,554 | 48,957,940 | △ 83,680,921 | △ 60,807,704 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 3,741,498,233 | △ 3,530,159,342 | △ 3,564,953,544 | △ 3,548,628,226 | △ 3,511,822,305 | △ 3,602,183,053 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 3,573,103,708 | △ 3,495,834,408 | △ 3,493,258,053 | △ 3,488,903,796 | △ 3,482,793,442 | △ 3,474,140,880 |
| (配当等相当額) | (922,398,945) | (901,483,370) | (899,836,097) | (897,781,263) | (895,333,085) | (892,091,811) |
| (売買損益相当額) | (△ 4,495,502,653) | (△ 4,397,317,778) | (△ 4,393,094,150) | (△ 4,386,685,059) | (△ 4,378,126,527) | (△ 4,366,232,691) |
| (G) 計 (D+E+F) | △ 7,162,473,018 | △ 7,045,611,007 | △ 7,028,278,043 | △ 6,988,574,082 | △ 7,078,296,668 | △ 7,137,131,637 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 34,231,194 | △ 33,419,528 | △ 33,321,301 | △ 33,207,799 | △ 33,079,412 | △ 32,916,364 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △ 7,196,704,212 | △ 7,079,030,535 | △ 7,061,599,344 | △ 7,021,781,881 | △ 7,111,376,080 | △ 7,170,048,001 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 3,573,103,708 | △ 3,495,834,408 | △ 3,493,258,053 | △ 3,488,903,796 | △ 3,482,793,442 | △ 3,474,140,880 |
| (配当等相当額) | (922,398,945) | (901,483,370) | (899,836,097) | (897,781,263) | (895,333,085) | (892,091,811) |
| (売買損益相当額) | (△ 4,495,502,653) | (△ 4,397,317,778) | (△ 4,393,094,150) | (△ 4,386,685,059) | (△ 4,378,126,527) | (△ 4,366,232,691) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 464,433,159 | 466,465,959 | 477,835,179 | 489,492,842 | 500,610,465 | 509,772,851 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 4,088,033,663 | △ 4,049,662,086 | △ 4,046,176,470 | △ 4,022,370,927 | △ 4,129,193,103 | △ 4,205,679,972 |

(注1) (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。

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

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

分配金の計算過程

第155期計算期間末における費用控除後の配当等収益（52,547,330円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（922,398,945円）および分配準備積立金（446,117,023円）より分配対象収益は1,421,063,298円（10,000口当たり1,245円）であり、うち34,231,194円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第156期計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,349,094円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（901,483,370円）および分配準備積立金（452,536,393円）より分配対象収益は1,401,368,857円（10,000口当たり1,257円）であり、うち33,419,528円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第157期計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,046,527円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（899,836,097円）および分配準備積立金（464,109,953円）より分配対象収益は1,410,992,577円（10,000口当たり1,270円）であり、うち33,321,301円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第158期計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,487,243円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（897,781,263円）および分配準備積立金（475,213,398円）より分配対象収益は1,420,481,904円（10,000口当たり1,283円）であり、うち33,207,799円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第159期計算期間末における費用控除後の配当等収益（47,093,936円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（895,333,085円）および分配準備積立金（486,595,941円）より分配対象収益は1,429,022,962円（10,000口当たり1,295円）であり、うち33,079,412円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第160期計算期間末における費用控除後の配当等収益（45,693,645円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（892,091,811円）および分配準備積立金（496,995,570円）より分配対象収益は1,434,781,026円（10,000口当たり1,307円）であり、うち32,916,364円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（豪ドルコース）

■分配金のお知らせ

| 決 算 期 | 第155期 | 第156期 | 第157期 | 第158期 | 第159期 | 第160期 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たりの分配金（税込み） | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しております。

◇分配金を再投資する場合

お手取り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

| 項 目 | 第155期 | 第156期 | 第157期 | 第158期 | 第159期 | 第160期 |
|-----------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | (2022年10月12日 ～2022年11月8日) | (2022年11月9日 ～2022年12月8日) | (2022年12月9日 ～2023年1月10日) | (2023年1月11日 ～2023年2月8日) | (2023年2月9日 ～2023年3月8日) | (2023年3月9日 ～2023年4月10日) |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| （対基準価額比率） | (0.806%) | (0.816%) | (0.817%) | (0.814%) | (0.838%) | (0.858%) |
| 当期の収益 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,215 | 1,227 | 1,240 | 1,253 | 1,265 | 1,277 |

（注1）「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る点にご留意ください。

（注2）「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。

< 1. 補足情報 >

組入ファンド「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」の決算日（毎年12月末日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2023年4月6日現在の情報を掲載しています。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2023年4月6日現在）
債券

| 銘柄 | | | 通貨 | 額面金額 | 評価額（米ドル） |
|-------|-----------------------|---------------------------|-----|---------|------------|
| アメリカ | SPRINT CORP | 7.875 14-23 15/09S | USD | 685,000 | 693,645.97 |
| パナマ | CARNIVAL CORP | 5.75 21-27 01/03S | USD | 825,000 | 673,844.88 |
| アメリカ | FORD MOTOR CREDIT CO | 5.1130 19-29 03/05S | USD | 700,000 | 672,513.81 |
| | TENET HEALTHCARE | 6.125 20-28 01/10S | USD | 450,000 | 425,580.72 |
| リベリア | ROYAL CARIBBEAN | 3.7 17-28 15/03S | USD | 400,000 | 323,403.59 |
| アメリカ | ALLY FINANCIAL INC | 3.875 19-24 21/05S | USD | 300,000 | 295,334.57 |
| | CCO HOLD | 4.75 22-32 01/02S | USD | 350,000 | 293,710.69 |
| | CCO HLDG LLC/CAPITAL | 4.5 21-32 01/05S | USD | 295,000 | 244,659.76 |
| | CQP HOLDCO | 5.5 21-31 15/06S | USD | 250,000 | 232,740.75 |
| | IMOLA MERGER CO | 4.7500 21-29 15/05S | USD | 250,000 | 227,177.89 |
| | CAESARS ENTERTAINMENT | 4.625 21-29 15/10S | USD | 250,000 | 224,125.19 |
| パナマ | CARNIVAL CORPORATION | 6 21-29 01/05S | USD | 275,000 | 223,059.54 |
| アメリカ | LIFE TIME INC | 8.00 21-26 15/04S | USD | 225,000 | 222,625.10 |
| | FORD MOTOR CREDIT CO | 5.125 20-25 19/06S | USD | 200,000 | 198,398.10 |
| | FORD MOTOR CO | 4.75 13-43 15/01S3 15/01S | USD | 250,000 | 195,086.60 |
| フランス | ALTICE FRANCE SA | 8.1250 18-27 01/02S | USD | 200,000 | 184,017.48 |
| アメリカ | DIRECTV FINANCING LLC | 5.875 21-27 15/08S | USD | 200,000 | 181,835.25 |
| | CCO HLDG LLC/CAPITAL | 4.50 21-33 01/06S | USD | 225,000 | 181,792.11 |
| | ORGANON COMPANY | 5.125 21-31 30/04S30/04S | USD | 200,000 | 181,504.17 |
| パナマ | CARNIVAL CORP | 7.625 20-26 01/03S | USD | 200,000 | 181,498.42 |
| オランダ | UPC BROADBAND FINCO B | 4.875 21-31 15/07S | USD | 200,000 | 177,100.79 |
| カナダ | 1011778 BC UNLIMITED | 4.0000 20-30 15/10S | USD | 200,000 | 175,224.56 |
| アメリカ | ICAHN ENTERPRISES LP | 4.75 19-24 15/09S | USD | 175,000 | 173,895.87 |
| イギリス | VMED 02 UK FINA | 4.7500 21-31 15/07S | USD | 200,000 | 173,158.31 |
| フランス | ALTICE FRANCE SA | 5.125 21-29 15/07S | USD | 225,000 | 173,028.25 |
| バミューダ | NCL CORP LTD | 5.875 20-26 15/03S | USD | 200,000 | 169,670.17 |
| アメリカ | CSC HOLDINGS LLC | 6.5 19-29 01/02S | USD | 200,000 | 168,887.23 |
| | ICAHN ENTERPRISES LP | 5.25 19-27 15/05S | USD | 175,000 | 168,302.11 |
| | ALLIED UNIVERSAL | 9.75 19-27 15/07S | USD | 175,000 | 163,548.94 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS | 4.6 18-28 15/06S | USD | 190,000 | 162,214.79 |

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
USD (米ドル)

■外国為替先物契約（IH3シェアクラス、豪ドル）（2023年4月6日現在）

| 買 建 | 契約額 | 売 建 | 契約額 | 満 期 日 | 評 価 損 益 |
|-----------|---------------|-----|---------------|----------|-----------|
| | | | | | 米ドル |
| オーストラリアドル | 42,300,000.00 | 米ドル | 28,164,938.94 | 2023/6/2 | 96,618.64 |
| | | | | 合計 | 96,618.64 |

< 2. 補足情報 >

組入ファンド「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2023年2月15日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2023年4月10日現在の情報を掲載しています。

■組入資産の明細（2023年4月10日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 2023 年 4 月 10 日 現 在 | | | | | | |
|-----------|---------------------|---------|---------|-----------------|-------------------|---------|---------|
| | 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 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地 方 債 証 券 | 350,000 | 351,305 | 72.1 | - | - | - | 72.1 |
| 合 計 | 350,000 | 351,305 | 72.1 | | | | 72.1 |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) -印は組入れなしです。

(注4) 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。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

| 種 類 | 銘 柄 | 2023 年 4 月 10 日 現 在 | | | |
|-----------|-------------------|---------------------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 地 方 債 証 券 | 第128回共同発行市場公募地方債 | 0.66 | 250,000 | 250,992 | 2023/11/24 |
| | 第375回大阪府公募公債（10年） | 0.835 | 100,000 | 100,313 | 2023/8/29 |
| | 合 計 | | 350,000 | 351,305 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド
 決算日 2022年12月31日
 (計算期間：2022年1月1日～2022年12月31日)

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しております。なお、開示情報につきましては各クラス別の情報がないため、全てのシェアクラスを含むファンド全体の情報を開示しております。

■費用の明細 (2022年1月1日～2022年12月31日)

| 項目 | 当期 |
|-----------|------------|
| | 米ドル |
| (a)運用報酬 | 281,660.28 |
| (b)管理費用等 | 104,091.76 |
| (c)その他の費用 | 65,649.46 |
| 合計 | 451,401.50 |

■純資産計算書 (2022年12月31日現在)

| 項目 | 当期末 |
|------------|---------------|
| | 米ドル |
| 資産合計 | 49,912,080.55 |
| 有価証券 | 41,194,809.95 |
| 預金 | 6,900,530.05 |
| 未収利息 | 760,641.91 |
| 有価証券売却未収入金 | 61,825.04 |
| 為替予約取引評価勘定 | 994,273.60 |
| 負債合計 | 1,674,653.63 |
| 借入金 | 940,000.00 |
| 未払配当金 | 656,946.10 |
| 未払運用報酬 | 55,747.18 |
| 未払管理費用 | 20,602.21 |
| 未払税 | 1,222.38 |
| 為替未払金 | 123.15 |
| その他の負債 | 12.61 |
| 純資産 | 48,237,426.92 |

■有価証券明細 (2022年12月31日現在)

| 数量 | 評価額 米ドル | 数量 | 評価額 米ドル |
|---|---------------------|--|----------------------|
| 債券 | 3,698,564,11 | | |
| オーストラリア | 122,007,86 | | |
| 25,000 FMG RESO AUG 2006 PTY 6.125 22-32 15/04S | 23,348,61 | 25,000 LINDBLAD EXPEDITIO LLC 6.75 22-27 15/02S | 22,700,87 |
| 50,000 FMG RESOURCES A 5.8750 22-30 15/04S | 47,183,75 | 25,000 MACY'S RETAIL H 5.8750 22-30 15/03S | 21,760,11 |
| 25,000 MINERAL RESOURCES 8.0 22-27 01/11S | 25,571,99 | 25,000 MATCH GROUP HLD 4.1250 20-30 01/08S | 20,576,17 |
| 25,000 MINERAL RESOURCES 8.5 22-30 01/05S | 25,741,00 | 25,000 MATTEL INC 3.375 21-26 19/03S | 23,151,05 |
| 25,000 VIRGIN AUSTRALIA 19-24 15/11S - DEFAULT | 162,51 | 100,000 MINERVA MERGER 6.5000 22-30 15/02S | 74,204,43 |
| バミューダ | 42,571,05 | 25,000 MIWD HOLDCO II 5.5 22-30 01/02S | 20,162,98 |
| 25,000 NABORS INDUSTRI 7.2500 20-26 15/01S | 23,707,92 | 25,000 NATL FI 7.5 22-30 01/10S | 23,556,84 |
| 25,000 NCL 7.75 22-29 15/02S | 18,863,13 | 75,000 NEWS 5.125 22-32 15/02S | 68,294,58 |
| カナダ | 82,399,74 | 50,000 NORTONLIFELOCK INC 6.75 27-30/09S | 49,148,86 |
| 75,000 BAUSCH HEALTH 5.2500 19-30 30/01S | 36,462,69 | 50,000 NORTONLIFELOCK INC 7.125 -30 30/09 | 49,314,21 |
| 50,000 VERMILION ENERGY 6.875 22-30 01/05S | 45,937,05 | 50,000 NOVELIS CORP 3.25 21-26 11/08S | 44,900,30 |
| アメリカ | 2,955,810,54 | 50,000 OSCAR ACQUISITI 9.5000 22-30 15/04S | 44,858,02 |
| 25,000 ADVANCED DRAIN 6.3750 22-30 15/06S | 24,297,93 | 25,000 OWENS & MINOR I 6.6250 22-30 01/04S | 21,518,18 |
| 50,000 ALBERTSONS COMPANIES 4.875 20-30 15/02S | 44,668,65 | 25,000 POST HOLDINGS INC 4.625 20-30 15/04S | 21,589,57 |
| 25,000 ALLEGIANT TRAVEL 7.25 22-27 15/08S | 23,827,50 | 25,000 ROCKET MORTGAGE CO 3.6250 20-29 01/03S | 19,941,82 |
| 25,000 AMERICAN CAMPUS 4.00 19-28 15/01S | 22,317,20 | 100,000 ROCKETMTGE CO-I 4.0000 21-33 15/10S | 74,907,04 |
| 50,000 AVIENT CORP 7.125 22-30 01/08S | 49,237,81 | 25,000 RYAN SPECIALTY 4.3750 22-30 01/02S | 21,878,33 |
| 50,000 BELLRING BRANDS 7.0000 22-30 15/03S | 48,578,08 | 25,000 SCI GAMES 6.625 22-30 01/03S | 21,143,81 |
| 50,000 BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375 22-32 15/06S | 47,112,03 | 50,000 SEALED AIR 5.0 22-29 15/04S | 47,021,97 |
| 125,000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.75 19-30 01/03S | 108,087,50 | 25,000 SENSATA TECHNOL 4.3750 19-30 15/02S | 22,032,46 |
| 25,000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 5.375 19-29 01/06S | 22,617,31 | 50,000 SIRIUS XM RADIO 5.00 17-27 01/08S | 46,404,78 |
| 350,000 CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S | 284,879,40 | 25,000 TENET HEALTHCARE 6.125 22-30 15/06S | 23,824,45 |
| 50,000 CCO HOLDINGS 5 17-28 01/02S 17-28 01/02S | 45,514,13 | 75,000 UNIVISION COMMUNICAT 7.375 22-30 30/06S | 71,845,68 |
| 100,000 CCO HOLDLCCO HOLD C 6.375 22-29 01/09S | 94,012,25 | 75,000 VICI PROPERTIES 4.6250 19-29 01/12S | 68,354,62 |
| 50,000 CDI ESCROW ISSU 5.7500 22-30 01/04S | 90,324,99 | 75,000 VISTRA OPERATIONS CO 5.625 19-27 15/02S | 71,780,54 |
| 25,000 CHS/COMMUNITY H 5.2500 22-30 15/05S | 18,932,61 | ケイマン諸島 | 83,439,29 |
| 50,000 CIENA CORP 4.0 22-30 31/01S | 44,201,41 | 76,000 SEAGATE HDD CAYMAN 9.625 22-32 01/12S | 83,439,29 |
| 75,000 COGENT COMMUNIC 7.0000 22-27 15/06S | 73,048,34 | リベリア | 101,874,53 |
| 50,000 COINBASE GLOBAL 3.6250 21-31 01/10S | 24,358,99 | 125,000 ROYAL CARIB CRUISES 5.375 22-27 15/07S | 101,874,53 |
| 25,000 CONSENSUS CLOUD 6.5000 21-28 15/10S | 23,003,82 | マルタ | 85,476,72 |
| 250,000 COP HOLDCO 5.5 21-31 15/06S | 219,281,38 | 50,000 VISTAJET MAL FIN 7.875 22-27 01/05S | 45,304,06 |
| 100,000 DIAMOND SPORTS 5.375 22-26 15/08S | 12,385,24 | 50,000 VISTAJET MALT 6.375 22-30 01/02S | 40,172,66 |
| 51,000 DIEBOLD NIXDORF INC 9.375 22-25 15/07S | 36,472,65 | パナマ | 61,449,74 |
| 25,000 DUN & BRADSTREE 5.0000 21-29 15/12S | 21,601,94 | 75,000 CARNIVAL CORPORATION 10.5 22-30 01/06S | 61,449,74 |
| 25,000 ENERGIZER 6.5 22-27 31/12S | 23,919,05 | イギリス | 163,534,64 |
| 50,000 ENLINK MIDSTREAM 6.5 22-30 01/09S | 49,577,70 | 200,000 VMED O2 UK FINA 4.7500 21-31 15/07S | 163,534,64 |
| 50,000 EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-27 01/06S06S | 49,047,39 | 債券 | 37,283,950,52 |
| 50,000 EQM MIDSTREAM PARTNER 7.5 22-30 01/06S | 48,245,01 | オーストラリア | 157,181,97 |
| 50,000 FERTITTA ENTERT 6.7500 22-30 15/01S | 40,424,62 | 125,000 FMG RES AUG 2006 PTY 4.375 21-31 01/04SS | 106,072,61 |
| 50,000 FERTITTA ENTERTMT FIN 4.625 22-29 15/01S | 42,401,06 | 50,000 MINERAL RESOURCES LTD 8.125 19-27 01/05S | 51,109,36 |
| 25,000 GAP INC 3.875 21-31 01/10S | 17,668,16 | バミューダ | 408,031,71 |
| 25,000 HESS MIDSTREAM 5.5000 22-30 15/10S | 23,031,48 | 50,000 NABORS INDUSTRIES INC 7.50 20-28 15/01S | 45,964,93 |
| 25,000 HILCORP ENERGY 6.0000 22-30 15/04S | 22,401,98 | 200,000 NCL CORP LTD 5.875 20-26 15/03S | 157,763,15 |
| 50,000 HLF FIN SARL LLCHERB 4.875 21-29 01/06S | 34,295,06 | 25,000 NCL CORPORATION 3.6250 19-24 15/12S | 21,519,93 |
| 50,000 HOLLY ENERGY PARTNER 6.375 22-27 15/04SS | 49,399,49 | 25,000 NCL FINANCE LTD6.125 21-28 15/03S | 18,625,66 |
| 75,000 JACOBS ENTERTAI 6.7500 22-29 15/02S | 68,429,60 | 50,000 VIKING OCEAN CR 5.6250 21-29 15/02S | 40,348,57 |
| 25,000 KAISER ALUMINUM 4.6250 19-28 01/03S | 22,036,46 | 50,000 VOC ESCROW LTD 5.00 18-28 15/02S | 43,028,95 |
| 25,000 KAISER ALUMINUM CORP 4.500 21-31 01/06S | 20,107,91 | 8.000 WEATHERFORD 11.00 19-24 01/12S | 8,229,63 |
| 25,000 KB HOME 7.25 22-30 15/07S | 24,298,28 | | |
| 50,000 KINETIK HOLDING 5.8750 22-30 15/06S | 46,894,46 | | |

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

| 数量 | | 評価額 米ドル | 数量 | | 評価額 米ドル |
|---------|--|----------------------|---------|---|------------|
| 75.000 | WEATHERFORD INT 8.6250 21-30 30/04S | 72,550.89 | 25.000 | ALLEGHENY TECHNO 5.875 19-27 01/12S | 24,010.17 |
| | カナダ | 1,704,417.67 | 25.000 | ALLEN MEDIA LLC 10.5 20-28 15/02S | 9,530.40 |
| 50.000 | BAFFINLAND IRON MINES 8.75 18-26 15/07A | 47,501.71 | 150.000 | ALLIED UNIVERSAL 6.625 19-26 15/07S | 137,914.49 |
| 50.000 | BAUSCH HEALTH CO 7.25 19-29 30/05S | 24,185.47 | 175.000 | ALLIED UNIVERSAL 9.75 19-27 15/07S | 153,957.78 |
| 50.000 | BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.25 20-31 15/02S | 24,311.83 | 25.000 | ALTA EQUIPMENT GROUP 5.625 21-26 15/04S | 22,715.46 |
| 25.000 | BAUSCH HEALTH 6.2500 20-29 15/02S | 12,153.83 | 50.000 | AMC NETWORKS INC 4.25 21-29 15/02S | 31,244.00 |
| 75.000 | BAUSCH HEALTH 7.0000 19-28 15/01S | 36,650.34 | 75.000 | AMERICAN AIRLINES 11.7500 20-25 15/07 | 80,757.61 |
| 171.000 | BAUSCH HEALTH 9.00 17-25 15/12S | 135,297.19 | 64.000 | AMERIGAS PARTFIN 5.50 16-25 20/05S | 61,578.81 |
| 65.000 | BOMBARDIER 7.50 15-25 15/03S | 64,626.41 | 25.000 | AMKOR TECHNOLOGY INC 6.625 19-27 15/09S | 24,890.72 |
| 150.000 | BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S | 146,197.73 | 125.000 | AMN HEALTHCARE 4.0000 20-29 15/04S | 108,340.13 |
| 50.000 | BOMBARDIER INC 6.0 21-28 15/02S | 46,486.85 | 25.000 | AMN HEALTHCARE 4.625 19-27 01/10S | 23,070.82 |
| 25.000 | BOMBARDIER INC 7.1250 21-26 15/06S | 24,580.25 | 25.000 | ANTERO MIDSTREAM 5.375 21-29 15/06S | 22,884.78 |
| 50.000 | BROOKFIELD RESIDEN 5.00 21-29 15/06S | 39,973.07 | 50.000 | ANTERO MIDSTREAM 5.750 19-27 01/03S | 47,304.05 |
| 50.000 | EMPIRE COMMUNIT 7.0000 20-25 15/12S | 45,547.32 | 75.000 | ANTERO MIDSTREAM 7.875 20-26 15/05S | 76,217.61 |
| 25.000 | ENSIGN DRILLING INC 9.25 19-24 15/04S | 23,844.30 | 50.000 | APACHE CORP 4.25 19-30 15/01S | 44,320.68 |
| 25.000 | GARDA WORLD SECURITY 4.625 20-27 15/02S | 22,149.70 | 50.000 | APACHE CORP 5.10 10-40 01/09S | 41,565.70 |
| 100.000 | GARDA WORLD SECURITY 6.0 21-29 01/06S | 81,874.23 | 75.000 | APACHE CORP 5.35 19-49 01/07S | 61,048.03 |
| 50.000 | HUSKY III HOLDING 13.0 20-25 15/02S | 44,445.85 | 25.000 | API ESCROW CORP 4.75 21-29 15/10S | 22,032.37 |
| 50.000 | INTELLIGENT PACKAGING 6.00 20-28 15/09S | 40,554.71 | 75.000 | API GROUP DE INC 4.125 21-29 15/07S | 63,538.51 |
| 50.000 | MATTAMY GROUP 4.625 20-30 01/03S | 41,020.50 | 25.000 | APX GROUP INC 5.7500 21-29 15/07S | 20,815.85 |
| 25.000 | METHANEX CORP 5.125 20-27 15/10S7 15/10S | 23,279.27 | 100.000 | ARAMARK SERVICES INC 5.00 18-28 01/02S | 93,529.78 |
| 25.000 | NOVA CHEMICALS 4.2500 21-29 15/05S | 20,505.53 | 25.000 | ARCHES BUYER 4.250 20-28 01/06S | 19,667.60 |
| 32.000 | NOVA CHEMICALS CORP 5.25 17-27 01/06S6S | 28,812.59 | 75.000 | ARCHROCK PARTNE 6.2500 19-28 01/04S | 69,094.33 |
| 75.000 | OPEN TEXT CORP 3.875 21-29 01/12S | 60,451.38 | 25.000 | ARCHROCK PARTNE 6.8750 19-27 01/04S | 24,003.51 |
| 50.000 | OPEN TEXT CORP 3.8750 20-28 15/02S | 42,974.53 | 25.000 | ARCONIC CORPORATION 6.125 20-28 15/02S | 23,565.35 |
| 50.000 | PARKLAND CORP/C 4.6250 21-30 01/05S | 41,743.82 | 25.000 | ARKO CORP 5.125 21-29 15/11S | 19,637.09 |
| 125.000 | PARKLAND CORPORATION 4.5 -21-29 01/10S | 105,011.54 | 25.000 | ASBURY AUTOMOTI 4.6250 21-29 15/11S | 21,127.82 |
| 25.000 | PARKLAND FUEL CORP 5.875 19-27 15/07S | 23,720.16 | 25.000 | ASBURY AUTOMOTI 5.0000 21-32 15/02S | 20,667.87 |
| 50.000 | PRECISION DRILL 6.8750 21-29 15/01S | 46,976.97 | 25.000 | ASBURY AUTOMOTIVE 4.75 20-30 01/03S | 21,029.89 |
| 50.000 | PRECISION DRILLING 7.125 17-26 15/01S | 48,830.25 | 50.000 | ASCENT RESOURCE 8.25 20-28 31/12S | 49,212.99 |
| 50.000 | SUPERIOR PLUS LP SUP 4.5 21-29 15/03S | 43,003.68 | 89.000 | ASCENT RESOURCES UTI 9.0 20-27 01/11S | 109,198.09 |
| 25.000 | TASEKO MINES LT 7.0000 21-26 15/02S | 22,082.89 | 75.000 | ASGN INCORPORAT 4.6250 19-28 15/05S | 68,122.88 |
| 50.000 | TEINE ENERGY LT 6.8750 21-29 15/04S | 45,239.71 | 50.000 | ASHTON WOODS US 4.6250 21-30 01/04S | 40,546.97 |
| 25.000 | TELESAT CANADA 4.875 19-27 15/10S | 11,427.07 | 75.000 | ASHTON WOODS USA LLC 6.625 20-28 15/01S | 66,014.82 |
| 50.000 | TELESAT CANADA 5.625 21-26 08/12S | 23,507.30 | 75.000 | ASP AMC MARGER SUB 8.00 17-25 15/05S | 4,428.96 |
| 25.000 | TELESAT CANADA 6.50 19-27 15/10S | 7,475.41 | 50.000 | ASSUREDPARTNERS 5.6250 20-29 15/01S | 41,544.53 |
| 50.000 | TITAN ACQUISITION LTD 7.75 18/26 15/04S | 45,202.00 | 50.000 | AUDACY CAPITAL 6.75 21-29 31/03S | 9,188.17 |
| 200.000 | 1011778 BC UNLIMITED 4.0000 20-30 15/10S | 162,772.28 | 25.000 | AUSTIN BIDCO INC 7.125 20-28 15/12S | 19,410.36 |
| | アメリカ | 32,130,260.14 | 100.000 | AVANTOR FUNDING 3.8750 21-29 01/11S | 84,143.16 |
| 25.000 | ABERCROMBIE 8.75 20-25 15/07S | 24,768.61 | 75.000 | AVANTOR FUNDING INC 4.6250 20-28 15/07S | 68,168.74 |
| 50.000 | ACADIA HEALTHCARE CO 5.00 20-29 15/04S | 46,330.01 | 75.000 | AVIS BUDGET CAR RENT 4.75 21-28 23/03S | 63,708.25 |
| 25.000 | ACADIA HEALTHCARE CO 5.50 20-28 01/07S | 23,757.33 | 25.000 | AVIS BUDGET CAR 5.375 21-29 01/03S | 21,509.70 |
| 25.000 | ACRISURE LLC 0.125 19-26 01/08S | 24,518.64 | 25.000 | AVIS BUDGET CAR 5.750 19-27 15/07S | 22,737.11 |
| 50.000 | ACRISURE LLC 4.25 21-29 15/02S | 41,618.81 | 100.000 | BALL CORP 6.875 22-28 15/03S | 102,878.00 |
| 100.000 | ACRISURE LLC 7.0 17-25 15/11S | 92,258.21 | 50.000 | BASIC ENERGY SERVICES 0.00 18-23 15/10S | 1,281.25 |
| 50.000 | ADAMS HOMES 7.50 20-25 15/02S | 42,688.52 | 25.000 | BATH & BODY WORKS 7.5 19-29 15/06S15/06 | 24,685.45 |
| 50.000 | ADT SEC CORP 4.1250 21-29 01/08S | 42,906.36 | 125.000 | BATH&BODY WORKS INC 6.75 16-36 01/07S | 109,868.59 |
| 53.000 | ADTALEM ESCROW CORP 5.50 21-28 01/03S | 48,690.71 | 75.000 | BCPE EMPIRE HOLDINGS 7.625 21-27 01/05S | 67,493.56 |
| 25.000 | ADVANCED DRAINAGE 5 19-27 30/09S | 23,526.08 | 50.000 | BEACON ROOFING 4.125 21-29 15/05S | 41,810.08 |
| 25.000 | AETHON UN/AETHON UN F 8.25 21-26 15/02S | 24,860.17 | 25.000 | BEACON ROOFING 4.5000 19-26 15/11S | 23,450.52 |
| 50.000 | AFFINITY GAMING 6.8750 20-27 15/12S | 42,574.97 | 50.000 | BEAZER HOMES USA INC 6.7500 17-25 15/03 | 48,673.63 |
| 100.000 | AG ISSUER LLC 6.25 20-28 01/03S | 92,268.01 | 75.000 | BEAZER HOMES USA INC 7.25 19-29 15/10S | 67,229.25 |
| 25.000 | AHP HEALTH PARTNERS 5.75 21-29 15/07S | 19,598.04 | 51.000 | BIG RIVER STEEL 6.6250 20-29 31/01S | 49,047.79 |
| 75.000 | ALBERTSONS COMPANIES 4.625 19-27 15/01S | 69,894.45 | 75.000 | BLACKSTONE MORTGAGE 3.750 21-27 15/01S | 64,154.73 |
| 50.000 | ALLEGHENY TECHN 4.8750 21-29 01/10S | 44,246.04 | 50.000 | BLUE RACER MIDSTREAM 7.625 20-25 15/12S | 49,808.76 |
| 50.000 | ALLEGHENY TECHN 5.1250 21-31 01/10S | 44,107.04 | 50.000 | BONANZA CREEK E 5.0000 21-26 15/10S | 46,181.45 |
| | | | 50.000 | BOYD GAMING COR 4.75 21-31 15/06S | 43,602.35 |

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

| 数量 | 評価額 米ドル | 数量 | 評価額 米ドル |
|--|------------|--|------------|
| 50.000 BOYNE USA INC 4.7500 21-29 15/05S | 44,878.33 | 75.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.750 21-28 15/04S | 55,187.13 |
| 12.000 BRAND ENERGY & INF 8.50 17-25 15/07S | 9,643.25 | 25.000 CLEARWAY ENERGY 3.7500 21-32 15/01S | 20,228.90 |
| 25.000 BRIGHTSTAR ESCROW COR 9.75 20-25 15/03S | 23,147.42 | 50.000 CLEARWAY ENERGY 4.7500 19-28 15/03S | 46,392.84 |
| 50.000 BRISTOW GROUP I 6.8750 21-28 01/03S | 46,392.10 | 75.000 CLEVELAND CLIFFS 5.875 20-27 01/06S | 71,902.51 |
| 75.000 BTH & BDY WRKS 6.6250 20-30 01/10S | 70,399.28 | 25.000 CLEVELAND-CLIFFS INC 4.625 21-29 01/03S | 22,452.19 |
| 150.000 BUILDERS FIRSTS 4.2500 21-32 01/02S | 122,257.58 | 50.000 CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875 21-31 01/03S | 44,333.49 |
| 25.000 BUILDERS FIRSTS 5.0000 20-30 01/03S | 22,306.64 | 25.000 CLEVELAND-CLIFFS INC 6.75 20-26 15/03S | 25,142.78 |
| 18.000 BWAY HOLDING CO 5.5 17-24 15/04S | 17,548.59 | 50.000 COEUR MINING IN 5.1250 21-29 15/02S | 39,412.81 |
| 25.000 BWAY HOLDING 7.25 17-25 15/04S | 23,193.44 | 50.000 COHERENT CORP 5.0000 21-29 15/12S | 43,442.54 |
| 250.000 CAESARS ENTERTAINMENT 4.625 21-29 15/10S | 203,820.31 | 50.000 COLT MERGER SUB INC 8.1250 20-27 01/07S | 49,234.41 |
| 25.000 CAESARS ENTERTAINMENT 5.75 20-25 01/07SS | 24,595.18 | 25.000 COMMERCIAL META 4.1250 22-30 15/01S | 22,121.59 |
| 50.000 CALPINE CORP 5.00 20-31 01/02S | 42,176.88 | 25.000 COMMERCIAL METALS CO 4.375 22-32 15/03S | 21,734.89 |
| 75.000 CALPINE CORP 5.125 19-28 15/03S | 67,309.76 | 25.000 COMMSCOPE FINANCE 8.25 19-27 19/02S | 19,604.68 |
| 25.000 CARGO AIRCRAFT MANAG 4.750 20-28 01/02S | 22,739.96 | 75.000 COMMSCOPE INC 7.125 20-28 01/07S | 54,111.58 |
| 75.000 CARPENTER TECHNOLOGY 6.375 20-28 15/07SS | 71,582.96 | 25.000 COMMSCOPE INC 4.7500 21-29 01/09S | 20,235.86 |
| 25.000 CARRIAGE SERVIC 4.2500 21-29 15/05S | 20,047.64 | 50.000 COMMSCOPE TECH 144A 6.00 15-25 15/06S | 45,572.97 |
| 50.000 CARROS RESTAURANT GR 5.875 21-29 01/07S | 35,246.27 | 25.000 COMPASS GROUP D 5.0000 21-32 15/01S | 20,086.73 |
| 100.000 CASTLE US HOLDING CORP 9.5 20-28 15/02S | 39,544.78 | 50.000 COMPASS GROUP D 5.2500 21-29 15/04S | 43,027.68 |
| 100.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.25 20-31 01/02S | 80,524.24 | 25.000 COMPASS MINERALS 6.75 19-27 01/12S | 24,176.10 |
| 300.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S | 239,176.26 | 25.000 CONSOLIDATED COMM INC 6.5 20-28 01/10S | 19,504.39 |
| 225.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.50 21-33 01/06S | 173,510.44 | 25.000 COOPER-STANDARD 13.0000 20-24 01/06 | 26,195.03 |
| 150.000 CCO HOLDINGS LLC / CCO 4.25 21-34 15/01S | 111,023.43 | 25.000 CORNERSTONE BUI 6.1250 20-29 15/01S | 17,651.87 |
| 50.000 CDR FR/CND WNDR 6.5 21-28 01/10S | 48,671.74 | 50.000 COVANTA HOLDING 5.00 20-30 01/09S | 40,705.54 |
| 50.000 CDW LLC CDW FINANCE 3.25 20-29 15/02S | 42,685.57 | 100.000 CRESTWOOD MIDSTREAM 6.00 21-29 01/02S | 92,300.66 |
| 25.000 CEC ENTERTAINMENT 6.75 21-26 01/05S | 23,269.76 | 25.000 CROCS INC 4.125 21-31 15/08S | 20,411.39 |
| 50.000 CEDAR FAIR LP CANADA 5.25 20-29 15/07S | 45,172.47 | 25.000 CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S | 24,320.74 |
| 25.000 CENTENE CORP 2.4500 21-28 15/07S | 21,112.25 | 24.000 CROWNROCK LP 5.625 17-25 15/10S25 15/10S | 23,237.26 |
| 225.000 CENTENE CORP 3.0000 20-30 15/10S | 184,642.11 | 50.000 CS GROUP 5.00 20-28 15/12S | 38,166.17 |
| 100.000 CENTENE CORP 3.375 20-30 15/02S | 84,771.10 | 200.000 CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S | 139,675.84 |
| 125.000 CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S | 117,521.47 | 200.000 CSC HOLDINGS LLC 6.5 19-29 01/02S | 164,359.87 |
| 75.000 CENTENE CORP 4.625 20-29 15/12S | 68,839.84 | 25.000 CSTN MERGER SUB INC 6.75 17-24 15/08S | 20,180.35 |
| 25.000 CENTENE CORP 2.625 21-31 12/08S | 19,662.81 | 25.000 DAVITA INC 3.7500 20-31 15/02S | 18,672.72 |
| 50.000 CENTERFIELD MEDIA PAR 6.625 21-26 01/08S | 32,323.93 | 175.000 DAVITA INC 4.6250 20-30 01/06S | 141,270.13 |
| 25.000 CENTRAL GARDEN & PET 4.125 20-30 15/10S | 20,690.25 | 50.000 DCP MIDSTREAM 5.125 19-29 15/05S | 48,322.13 |
| 25.000 CENTRAL GARDEN & PET 4.125 21-31 30/04S | 20,726.50 | 75.000 DCP MIDSTREAM 8.6250 20-27 15/07S | 74,706.98 |
| 25.000 CENTURY COMMUNI 6.7500 20-27 01/06S | 23,917.51 | 25.000 DEALER TIRE LLC/DT 5.0 20-28 01/02S | 21,577.31 |
| 25.000 CENTURY COMMUNITIES I 3.875 21-29 15/08S | 19,666.22 | 50.000 DELEK 6.75 18-25 15/05S | 48,615.36 |
| 150.000 CHENIERE ENERGY 3.2500 22-32 30/01S | 120,044.42 | 50.000 DELEK LOGISTICS PARTN 7.125 21-28 01/06S | 45,160.15 |
| 25.000 CHENIERE ENERGY INC 4.625 21-28 15/04S | 22,728.50 | 25.000 DELTA AIR LINES INC 3.7375 20-26 12/06S | 25,761.84 |
| 150.000 CHENIERE ENERGY PARTNER 4.0 21-31 01/03S | 128,904.58 | 75.000 DIAMOND SPORTS GR/DIA 6.625 19-27 15/08S | 1,165.34 |
| 25.000 CHORD ENERGY CORP 6.375 21-26 01/06S | 24,309.41 | 200.000 DIRECTV FINANCING LLC 5.875 21-27 15/08S | 179,625.10 |
| 75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 4.75 21-31 15/02S | 54,854.47 | 50.000 DISH DBS CORPORATION 5.75 21-28 01/12S | 39,985.62 |
| 50.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 5.625 20-27 15/03S | 43,016.34 | 24.000 DISH DBS CORPORATION 5.875 15-24 15/11S | 22,438.15 |
| 50.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.00 20-29 15/01S | 41,949.48 | 75.000 DISH DBS CORPORATION 7.375 20-28 01/07S | 53,266.30 |
| 75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.125 21-30 01/04S | 37,949.61 | 75.000 DISH DBS CORPORATION 5.125 21-29 01/06S | 48,538.97 |
| 20.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.875 19-28 01/04S | 9,866.57 | 100.000 DISH DBS CORPORATION 5.25 21-26 01/12S2S | 84,436.63 |
| 150.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.875 21-29 15/04S | 77,968.49 | 50.000 DIVERSIFIED HEALTH 4.375 21-31 01/03S | 31,904.47 |
| 100.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 8.0 19-26 15/03S | 91,344.86 | 39.000 DIVERSIFIED HEALTH 9.75 20-25 15/06S | 37,565.16 |
| 29.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 8.00 19-27 15/12S | 26,309.61 | 42.000 DOMTAR CORP 6.75 21-28 01/10S1-28 01/10S | 36,744.15 |
| 50.000 CHURCHILL DOWNS INC 5.50 19-27 01/04S | 47,694.73 | 100.000 DORNOCHE DEBT ME 6.6250 21-29 15/10S | 71,157.77 |
| 125.000 CINEMARK USA 5.25 21-28 15/07S | 92,991.91 | 100.000 EDGEWELL PERSONAL CAR 4.125 21-29 01/04S | 86,257.19 |
| 50.000 CINEMARK USA INC 5.875 21-26 16/03S | 41,684.10 | 100.000 ENACT HOLDINGS INC 6.5000 20-25 15/08S | 98,561.44 |
| 150.000 CITGO HOLDING I 9.2500 19-24 01/08S | 150,732.51 | 50.000 ENCOMPASS HEALTH 4.75 19-30 01/02S | 44,178.37 |
| 75.000 CITGO PETROLEUM 6.3750 21-26 15/06S | 72,164.45 | 25.000 ENDURANCE ACQ M 6.0000 21-29 15/02S | 16,393.85 |
| 50.000 CITGO PETROLEUM 7.0 20-25 15/06S | 48,946.01 | 75.000 ENLINK MIDSTREAM 4.85 16-26 15/07S07S | 70,998.76 |
| 150.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 5.125 19-27 15/08S | 130,290.33 | 50.000 ENLINK MIDSTREAM 5.45 17-47 01/06S1/06S | 40,205.28 |
| 25.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.500 21-29 01/06S | 18,215.74 | 50.000 ENLINK MIDSTREAM 5.6 14-44 01/10S01/04S | 41,130.67 |

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

| 数量 | 評価額 米ドル | 数量 | 評価額 米ドル |
|--|------------|--|------------|
| 50.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.05 14-45 01/04S | 37,931.08 | 41.000 GULFPORT ENERGY 8 21-26 17/05S | 40,678.40 |
| 50.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.375 19-29 01/06S | 46,536.44 | 75.000 HARVEST MIDSTREAM 7.5 20-28 01/09S | 72,137.04 |
| 25.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.625 20-28 15/01S | 23,902.80 | 75.000 HAT HOLDINGS I LLC 3.375 21-26 15/06S | 65,197.57 |
| 50.000 ENTENNIAL RESOURCE 5.375 17-26 15/01S | 45,782.18 | 25.000 HAT HOLDINGS I LLC 3.75 20-30 15/09S | 18,535.61 |
| 50.000 ENTERPRISE MERGER 8.75 18-26 15/10S | 14,160.94 | 150.000 HCA INC 5.875 15-26 15/02S | 151,026.90 |
| 75.000 EQM MIDSTREAM 4.50 21-29 15/01S | 63,513.66 | 25.000 HEALTHEQUITY INC 4.5 21-29 01/10S | 22,296.92 |
| 50.000 EQM MIDSTREAM PART 4.75 21-31 15/01S1S | 41,240.45 | 100.000 HERTZ CORP 5.0 21-29 01/12S | 75,990.00 |
| 25.000 EQM MIDSTREAM PART 5.50 18-28 15/07S | 22,357.52 | 100.000 HESS MIDSTREAM PART 5.125 19-28 15/06S | 93,268.18 |
| 25.000 EQM MIDSTREAM PART 6.00 20-25 01/07S | 24,304.56 | 75.000 HILCORP ENERGY 6.0000 21-31 01/02S | 63,736.49 |
| 25.000 EQM MIDSTREAM PART 6.50 18-48 15/07S | 18,888.89 | 25.000 HILCORP ENERGY 6.2500 18-28 01/11S | 22,759.12 |
| 25.000 EQM MIDSTREAM PART 6.50 20-27 01/07S | 23,958.47 | 125.000 HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S | 100,151.83 |
| 25.000 EVERI HOLDINGS 5.0000 21-29 15/07S | 21,700.55 | 25.000 HILTON DOMESTIC 3.75 20-29 01/05S | 21,712.28 |
| 109.000 EXEL INEXL FIN 11.50 21-26 15/07S | 17,302.67 | 100.000 HILTON DOMESTIC 4.0 20-31 01/05S | 84,339.99 |
| 50.000 FAIR ISAAC CORP 4.0000 19-28 15/06S | 45,404.23 | 75.000 HILTON DOMESTIC 5.75 20-28 01/05S | 73,138.93 |
| 125.000 FERRELLGAS 5.375 21-26 01/04S | 114,033.04 | 100.000 HILTON DOMESTIC 4.875 19-30 15/01S | 90,815.46 |
| 100.000 FERRELLGAS 5.875 21-29 01/04S | 82,113.16 | 100.000 HILTON GRAND VACATION 4.875 21-31 01/07S | 82,011.30 |
| 50.000 FIRSTCASH HOLDINGS 4.625 20-28 01/09S09S | 44,158.15 | 75.000 HILTON GRAND VACATIONS BO 5 21-29 01/06S | 65,167.41 |
| 25.000 FIRSTCASH INC 5.6250 21-30 01/01S | 22,388.02 | 50.000 HOLLY NRG PRTRN 5.0000 20-28 01/02S | 45,877.36 |
| 100.000 FORD MOTOR CO 3.25 21-32 12/02S32 12/02S | 75,324.08 | 100.000 HOWARD HUGUES CORP 4.125 21-29 01/02S | 83,737.83 |
| 250.000 FORD MOTOR CO 4.75 13-43 15/01S3 15/01S | 181,243.79 | 25.000 HOWARD HUGUES CORP 4.375 21-31 01/02S | 20,152.83 |
| 125.000 FORD MOTOR CO 5.291 16-46 08/12S 08/12S | 96,438.44 | 50.000 HOWARD HUGUES CORP 5.375 20-28 01/08S | 45,065.85 |
| 50.000 FORD MOTOR COMPANY 6.10 22-32 19/08S | 46,376.11 | 50.000 HOWARD MIDSTREAM EN 6.75 21-27 15/01S | 48,375.00 |
| 200.000 FORD MOTOR CREDIT CO 5.125 20-25 19/06S | 193,366.71 | 16.000 HOWMET AEROSPACE INC 5.90 07-27 01/02S | 15,978.80 |
| 400.000 FORD MOTOR CREDIT CO 5.1130 19-29 03/05S | 363,142.57 | 50.000 HOWMET AEROSPACE INC 5.95 07-37 01/02S | 48,604.16 |
| 50.000 FORESTAR GROUP INC 3.85 21-26 15/05S | 44,496.73 | 74.000 HOWNET AEROSPACE INC 5.125 14-24 01/10S | 73,315.64 |
| 50.000 FORESTAR GROUP INC 5.00 20-28 01/03S | 43,175.74 | 25.000 HUB INTERNATION 5.6250 21-29 01/12S | 21,968.32 |
| 50.000 FORTRESS TRANSPORT 5.50 21-28 01/05S | 42,674.61 | 65.000 HUGHES SAT SYS CORP 6.625 17-26 01/08S | 60,898.55 |
| 57.000 FORTRESS TRANSPORT 6.50 18-25 01/10S | 53,768.73 | 50.000 ICAHN ENTER 4.375 21-29 01/02S | 42,565.31 |
| 50.000 FORTRESS TRANSPORT 9.75 20-27 01/08S | 50,253.89 | 175.000 ICAHN ENTERPRISES LP 4.75 19-24 15/09S | 169,319.86 |
| 50.000 FOUNDATION BUIL 6.0000 21-29 01/03S | 37,889.27 | 175.000 ICAHN ENTERPRISES LP 5.25 19-27 15/05S | 160,737.24 |
| 21.000 FOXTROT ESCROW ISSUER 12.25 19-26 15/11S | 17,398.24 | 125.000 ICAHN ENTERPRISES LP 6.25 19-26 15/05S | 121,156.44 |
| 75.000 FREEDOM MORTGAGE CO 6.625 21-27 15/01S | 58,691.19 | 50.000 IHEARTCOMMUNI 6.375 19-26 01/05S | 46,060.11 |
| 75.000 FREEDOM MRTG 7.6250 20-26 01/05S | 63,491.91 | 75.000 IHEARTCOMMUNICATIONS 05.00 19-27 15/08S | 63,586.75 |
| 25.000 FREEPORT MCMORAN 4.250 20-30 01/03S | 22,835.72 | 25.000 ILLUMINATE BUYER LLC 9.0 20-28 01/07S | 21,184.05 |
| 50.000 FREEPORT MCMORAN 4.375 20-28 01/08S | 46,958.35 | 250.000 IMOLA MERGER CO 4.7500 21-29 15/05S | 216,948.05 |
| 25.000 FRONTIER COM CORP 5.875 20-27 15/10S5/10 | 23,313.72 | 50.000 INGLS MARKETS 4.0000 21-31 15/06S | 42,083.97 |
| 25.000 FRONTIER COMMUN 6.0000 21-30 15/01S | 19,741.82 | 25.000 INNOPHOS HOLDINGS INC 9.375 20-28 15/02S | 24,763.76 |
| 50.000 FRONTIER COMMUNICATION 5.00 20-28 01/05S | 43,723.41 | 50.000 INSTALLED BUILDING 5.75 19-28 01/02S | 45,380.71 |
| 25.000 FRONTIER COMMUNICATION 6.75 20-29 01/05S | 20,699.14 | 75.000 IRON MOUNTAIN INC 4.5000 20-31 15/02S | 61,875.72 |
| 50.000 FULL HOUSE RESORTS INC 8.25 21-28 15/02S | 44,318.19 | 25.000 IRON MOUNTAIN INC 5.0000 20-28 15/07S | 22,591.44 |
| 50.000 GAP INC 3.625 21-29 01/10S | 35,625.00 | 75.000 IRON MOUNTAIN INC 5.2500 20-30 15/07S | 65,187.54 |
| 50.000 GCI LLC 4.75 20-28 15/0S | 42,743.65 | 25.000 IRON MOUNTAIN INC 5.25 17-28 15/03S | 23,013.22 |
| 25.000 GENESIS ENERGY 6.50 17-25 01/10S | 23,891.86 | 125.000 IRON MOUNTAIN INFORMATION 5.0 21-32 15/07S | 104,831.03 |
| 25.000 GLATFELTER CORP 4.75 21-29 15/11S 15/11S | 15,300.63 | 25.000 ITAN INTL 7.0 21-28 30/04S | 23,874.67 |
| 25.000 GO DADDY OPCO/GD FIN CO 3.5 21-29 01/03S | 21,123.59 | 50.000 ITT HOLDINGS LLC 6.5 21-29 01/08S | 42,233.38 |
| 75.000 GO DADDY OPERATING COM 5.25 19-27 01/12S | 71,210.40 | 50.000 JANE STREET GRP 4.5000 21-29 15/11S | 43,726.53 |
| 125.000 GOLDEN ENTERTAI 7.6250 19-26 15/04S | 123,362.38 | 50.000 JEFFERSON CAPITAL HOLDING 6 21-26 15/08S | 41,525.22 |
| 75.000 GOODYEAR TIRE AND RUBB 5.00 22-29 15/07S | 62,683.92 | 45.000 JELD-WEN INC 4.625 17-25 15/12S | 37,960.59 |
| 75.000 GOODYEAR TIRE RUBBER 5.25 22-31 15/07S | 61,517.50 | 11.000 KAR AUCTION SERVICES 5.125 17-25 01/06S | 10,788.47 |
| 50.000 GOODYEAR TIRE 5.625 21-33 30/04S 30/04S | 41,386.29 | 50.000 KB HOME 4.000 21-31 15/06S | 40,430.98 |
| 75.000 GOODYEAR TIRE 9.5 20-25 31/05S25 31/05S | 77,755.21 | 50.000 KB HOME 6.875 19-27 15/06S | 50,354.85 |
| 75.000 GPS HOSPITALITY HOLDING 7 21-28 15/08S | 48,167.87 | 25.000 KEN GARFF AUTOM 4.8750 20-28 15/09S | 21,008.61 |
| 100.000 GRAY ESCROW II 5.3750 21-31 15/11S | 72,516.08 | 50.000 KENNEDY WILSON INC 4.75 21-30 01/02S | 38,270.00 |
| 100.000 GRAY TELEVISION INC 4.75 20-30 15/10S | 72,477.49 | 25.000 KONTOOR BRANDS 4.1250 21-29 15/11S | 20,369.04 |
| 25.000 GRAY TELEVISION 144A 5.875 16-26 15/07S | 22,301.86 | 25.000 KRONOS ACQUISITION 7.0 20-27 31/12S | 20,603.99 |
| 25.000 GREYSTAR REAL ESTAT 5.75 17-25 01/12S | 24,465.58 | 25.000 LABL INC 5.8750 21-28 01/11S | 21,416.57 |
| 100.000 GRIFFON 5.75 20-28 01/03S | 91,526.74 | 25.000 LABL INC 8.2500 21-29 01/11S | 19,997.27 |

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

| 数量 | 評価額 米ドル | 数量 | 評価額 米ドル |
|--|------------|--|------------|
| 25.000 LADDER CAP FIN 4.7500 21-29 15/06S | 20,221.02 | 50.000 MPT OPER PARTNERSHIP 4.625 19-29 01/08S | 38,797.15 |
| 50.000 LADDER CAP FIN 4.25 20-27 01/02S | 42,135.78 | 75.000 MSCI INC 3.6250 21-31 01/11S | 62,609.97 |
| 25.000 LAMAR MEDIA CORPORAT 4.00 20-30 15/02S | 21,857.53 | 50.000 MSCI INC 4.0000 19-29 15/11S | 43,811.78 |
| 25.000 LAMAR MEDIA CORPORATIO 3.75 20-28 15/02S | 22,457.47 | 25.000 MURPHY OIL USA INC 4.75 19-29 15/09S | 22,906.69 |
| 50.000 LAMB WESTON HOLDINGS 4.125 21-30 31/01S | 44,271.99 | 25.000 NABORS INDUSTRI 7.3750 21-27 15/05S | 24,524.39 |
| 25.000 LAMB WESTON HOLDINGS 4.375 21-32 31/01S | 21,855.76 | 75.000 NABORS INDUSTRIES INC 5.75 18-25 01/02S | 71,943.66 |
| 100.000 LBM ACQUISITION 6.2500 20-29 15/01S | 64,986.10 | 18.000 NATHAN'S FAMOUS IN 6.625 17-25 01/11S | 17,405.47 |
| 100.000 LCM INVESTM HLDS II 4.875 21-29 01/05S | 80,868.00 | 25.000 NATIONSTAR MORTGAGE HO 5.75 21-31 15/11S | 19,492.90 |
| 25.000 LEEWARD RENEWAB 4.2500 21-29 01/07S | 21,686.15 | 25.000 NATIONSTAR MTG 5.125 20-30 15/12S | 19,379.46 |
| 50.000 LEVEL 3 FINANCING INC 3.75 21-29 15/07S | 36,051.89 | 75.000 NATIONSTAR MTG 5.5 20-28 15/08S | 61,691.74 |
| 125.000 LEVEL 3 FINANCING INC 4.25 20-28 01/07S | 98,558.24 | 25.000 NATIONSTAR MTG 6.0000 20-27 15/01S | 22,485.07 |
| 25.000 LFS TOPCO LLC 5.8750 21-26 15/10S | 20,224.74 | 100.000 NAVIENT CORP 5.5 21-29 15/03S | 82,100.41 |
| 125.000 LIFE TIME INC 5.7500 21-26 15/01S | 116,808.39 | 150.000 NAVIENT CORP 5.8750 14-24 25/10S | 145,873.51 |
| 225.000 LIFE TIME INC 8.00 21-26 15/04S | 202,779.03 | 25.000 NAVIENT CORP 5.00 20-27 15/03S | 21,887.89 |
| 50.000 LIFEPOINT HEALTH INC 5.375 20-29 15/01S | 28,574.26 | 25.000 NAVIENT CORP 5.50 13-23 25/01S | 25,000.32 |
| 100.000 LITHIA MOTORS INC 3.875 21-29 01/06S | 82,618.29 | 125.000 NAVIENT CORP 6.75 17-25 25/06S | 120,520.52 |
| 50.000 LITHIA MOTORS INC 4.625 19-27 15/12S | 45,623.20 | 75.000 NAVIENT CORP 6.75 18-26 15/06S | 71,732.62 |
| 75.000 LIVE NATION ENTERT 5.625 18-26 15/03U | 71,328.51 | 50.000 NCR CORP 5.00 20-28 01/10S | 42,944.75 |
| 25.000 LIVE NATION INC 3.75 21-28 15/01S | 21,451.74 | 100.000 NCR CORP 5.125 21-29 15/04S | 83,743.88 |
| 100.000 LOGAN MERGER SUB INC 5.5 20-27 01/09S | 54,076.09 | 25.000 NCR CORP 5.25 20-30 01/10S | 20,628.00 |
| 25.000 LSB INDUSTRIES 6.2500 21-28 15/10S | 22,810.70 | 75.000 NCR CORP 5.75 19-27 01/09S | 72,044.15 |
| 75.000 LSF9 ATL HLDG/V 7.7500 21-26 15/02S | 66,863.98 | 75.000 NCR CORP 6.125 19-29 01/09 | 70,196.74 |
| 75.000 LUCENT TECHNOLOGIES 6.45 99-29 15/03S | 72,551.49 | 50.000 NESCO HOLDINGS II INC 5.5 21-29 15/04S | 44,259.34 |
| 25.000 LUMEN TECHNOLOGIES 4.5 20-29 15/01S | 17,334.51 | 25.000 NETFLIX INC 4.875 17-28 15/04S | 24,323.17 |
| 75.000 LUMEN TECHNOLOGIES 7.995 06-36 01/06S06S | 34,964.16 | 50.000 NEW ENTERPRISE 5.2500 21-28 15/07S | 45,223.20 |
| 75.000 MACYS RET HLDG INC 5.125 12-42 15/01SS | 49,113.69 | 50.000 NEW ENTERPRISE 9.7500 20-28 15/07S | 46,481.60 |
| 25.000 MACYS RET HLDG INC 6.375 07-37 15/03SS | 20,068.12 | 25.000 NEW FORTRESSEN 6.5000 21-26 30/09S | 23,303.65 |
| 75.000 MACYS RETAIL HLDG 5.875 21-29 01/04S | 66,813.98 | 25.000 NEWELL BRANDS I 6.6250 22-29 15/09S | 24,734.16 |
| 50.000 MADISON IAQ LLC 5.875 21-29 30/06S | 34,480.42 | 125.000 NEWELL BRANDS INC 4.70 16-26 01/04S | 118,516.08 |
| 25.000 MAGIC MERGERCO INC 5.250 21-28 01/05S | 20,273.77 | 25.000 NEWELL BRANDS INC 5.375 16-36 01/04S | 21,645.03 |
| 75.000 MAJORDRIVE HOLDING IV 6.375 21-29 01/06S | 56,346.26 | 50.000 NEWELL BRANDS INC 5.5 16-46 01/04S01/04S | 39,674.95 |
| 50.000 MATCH GROUP INC 5.00 17-27 15/12S | 46,506.13 | 25.000 NEWELL BRANDS INC 6.375 22-27 15/09S/09S | 24,850.71 |
| 25.000 MATTEL INC 5.45 11-41 01/11S | 20,425.05 | 100.000 NEWS CORP 3.875 21-29 15/05S | 86,824.50 |
| 25.000 MATTHEWS INTERNATIONAL 5.25 17-25 01/12S | 23,705.16 | 3.000 NEXTERA ENERGY 144A 4.25 17-24 15/09S | 2,794.26 |
| 50.000 MAV ACQUISITION CORP 8 21-29 01/08S | 41,429.00 | 50.000 NEXSTAR BROADCAST 4.7500 20-28 01/11S | 43,414.21 |
| 50.000 MERCER INTERNATIONAL 5.125 21-29 01/02S | 41,825.62 | 25.000 NEXSTAR ESCROW 5.6250 19-27 15/07S | 22,992.35 |
| 50.000 MERITAGE HOME CORP 6 15-25 01/06S/06S | 49,888.82 | 50.000 NEXTERA ENERGY OPER 3.875 19-26 15/10S0S | 46,009.88 |
| 100.000 METIS MERGER SUB LLC 6.5 21-29 15/05S | 85,039.52 | 100.000 NFP CORP 6.875 20-28 15/08S | 82,981.39 |
| 100.000 MGIC INVESTMENT CORP 5.25 20-28 15/08S8S | 92,451.83 | 25.000 NFP CORP 4.8750 21-28 15/08S | 21,349.12 |
| 25.000 MGM RESORTS INT 4.7500 20-28 15/10S | 21,850.79 | 100.000 NGL ENERGY 7.50 21-26 01/02S | 89,152.10 |
| 50.000 MGM RESORTS INTL 5.5 19-27 15/04S | 46,526.32 | 50.000 NMI HOLDINGS 7.3750 20-25 01/06S | 50,774.36 |
| 25.000 MGM RESORTS INTL 5.75 18-25 18/06S | 24,358.16 | 25.000 NORDSTROM INC 4.3750 19-30 01/04S | 18,822.55 |
| 99.000 MGM RESORTS INTL 6.00 14-23 15/03S | 99,097.07 | 25.000 NORTHWEST FIBER 4.7500 21-27 30/04S | 22,028.73 |
| 50.000 MIDCONTINENT CO 5.3750 19-27 15/08S | 45,673.80 | 25.000 NOVELIS CORP 4.7500 20-30 30/01S | 22,121.49 |
| 25.000 MIDWEST GAMING BORRO 4.875 21-29 01/05S | 21,391.46 | 25.000 NRG ENERGY INC 3.375 20-29 15/02S | 20,223.10 |
| 50.000 MINERALS TECHNOLOGIE 5.00 20-28 01/07S | 45,673.40 | 25.000 NRG ENERGY INC 3.625 20-31 15/02S | 19,181.94 |
| 25.000 MODIVCARE 5.00 21-29 01/10S | 21,082.97 | 32.000 NRG ENERGY INC 6.625 17-27 15/01S | 31,880.20 |
| 50.000 MOHEGAN TRIBAL GAM 8.00 21-26 01/02S | 46,543.69 | 25.000 NUSTAR LOGISTICS LP 6.00 19-26 01/06S | 24,195.10 |
| 12.000 MOHEGAN TRIBAL GAM 7.875 16-24 15/10S | 12,006.53 | 100.000 OLIN CORP 5.625 19-29 01/08S | 95,013.70 |
| 125.000 MOLINA HEALTHCA 3.8750 21-32 15/05S | 104,071.34 | 50.000 OPEN TEXT HOLDINGS IN 4.125 20-30 15/02S | 40,767.01 |
| 75.000 MOLINA HEALTHCARE INC 0.875 20-30 15/11S | 63,768.33 | 100.000 OPEN TEXT/OPEN 4.1250 21-31 01/12S | 78,128.47 |
| 24.000 MOSS CREEK RESOU HLD 7.5 18-26 15/01S | 21,651.61 | 200.000 ORGANON COMPANY 5.125 21-31 30/04S30/04S | 173,604.45 |
| 125.000 MOZART DEBT MERGE 3.875 21-29 01/04S | 100,963.85 | 75.000 OUTFRONT MEDIA 4.2500 21-29 15/01S | 62,278.71 |
| 125.000 MOZART DEBT MERGER 5.25 21-29 01/10S | 99,558.36 | 125.000 OUTFRONT MEDIA 5.0000 19-27 15/08S | 113,128.92 |
| 50.000 MPH ACQUISITION 144A 5.75 29-28 01/11S | 33,298.09 | 75.000 OWENS & MINOR I 4.5000 21-29 31/03S | 59,806.86 |
| 50.000 MPT OPER PARTNE 3.5000 20-31 15/03S | 34,437.43 | 50.000 P L DEVELOPMENT LLC 7.75 20-25 15/11S | 40,545.13 |
| 50.000 MPT OPER PARTNER 5.00 17-27 15/10S | 42,150.50 | 25.000 PANTHER BF AGGREGATOR 8.5 19-27 15/05S | 24,497.78 |

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

| 数量 | 評価額 米ドル | 数量 | 評価額 米ドル |
|-----------|---|---------|--|
| 117.000 | PAR PHARMACEUTI 7.5000 19-2701/04S | 100.000 | SERVICE CORPORATION 4 21-31 15/05S |
| 75.000 | PARK INTERMED HOLD 4.875 21-29 15/05S | 50.000 | SERVICE PROPERTIES 4.3500 19-24 01/10S |
| 50.000 | PARK INTERMEDIATE 7.5 20-25 01/06S06S | 50.000 | SERVICE PROPERTIES 4.3750 18-30 15/02S |
| 43.000 | PARK RIVER 5.625 21-29 01/02S | 75.000 | SERVICE PROPERTIES 5.25 16-26 15/02S |
| 75.000 | PARK-OHIO INDUSTRIES 6.625 17-27 15/04S | 25.000 | SERVICE PROPERTIES 7.50 20-25 15/09S |
| 75.000 | PATRICK INDUSTRIES 4.750 21-29 01/05S | 50.000 | SERVICE PROPERTIES 4.95 19-29 01/10S10S |
| 50.000 | PATRICK INDUSTRIES 7.500 19-27 15/10S | 50.000 | SHEA HOMES 4.7500 20-28 15/02U |
| 100.000 | PBF HOLDING CO LLC 6.0 20-28 15/02S | 50.000 | SHEA HOMES 4.7500 20-29 01/04U |
| 25.000 | PBF HOLDING CO LLC 7.25 17-25 15/06S | 75.000 | SIMMONS FOODS INC 4.625 21-29 01/03S |
| 25.000 | PECF USS INTERM 8.0000 21-29 15/11S | 75.000 | SINCLAIR TELEVISION 4.125 20-30 01/12S |
| 100.000 | PENN NATIONAL G 4.1250 21-29 01/07S | 64.000 | SINCLAIR TELEVISION 5.125 16-27 15/02S |
| 75.000 | PENN VIRGINIA ESCROW L 9.25 21-26 15/08S | 75.000 | SIRIUS SATELLITE 3.125 21-26 16/08S |
| 50.000 | PENNYMAC FINANCIAL 4.25 21-29 15/02S | 75.000 | SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S |
| 50.000 | PENNYMAC FINANCIAL SER 5.75 21-31 15/09S | 75.000 | SIRIUS XM RADIO 5.50 19-29 01/07S |
| 75.000 | PERFORMANCE FOOD GR 4.25 21-29 01/06S | 175.000 | SIRIUS XM RADIO INC 3.875 21-31 01/09S |
| 50.000 | PGT INC 4.375 21-29 01/10S | 75.000 | SIZZLING PLATTER LLC 8.5 20-25 28/11S |
| 75.000 | PLAYTIKA HOLDIN 4.2500 21-29 15/03S | 25.000 | SKYMILES IP LIMITED 4.50 20-25 20/10Q |
| 25.000 | PM GENERAL PURCHASER 9.5 20-28 01/10S | 75.000 | SLM CORP 3.125 21-26 02/11S |
| 25.000 | POLAR US BOR LLC 6.75 21-26 15/05S | 50.000 | SOLARIS MIDSTREAM HOL 7.625 21-26 01/04S |
| 50.000 | POST HOLDINGS INC 4.5 21-31 15/09S | 50.000 | SONIC AUTOMOTV 4.6250 21-29 15/11S |
| 25.000 | POST HOLDINGS INC 5.50 19-29 15/12S | 50.000 | SONIC AUTOMOTIVE 4.875 21-31 15/11S |
| 50.000 | POST HOLDINGS INC 5.625 17-28 15/01S | 75.000 | SPECIALTY BUILDING 6.37520-2630/09S |
| 25.000 | PREM ENMTM SUB LLC PR 5.625 21-29 01/09S | 25.000 | SPECTRUM BRANDS 3.875 21-31 15/03S |
| 75.000 | PREM ENMTM SUB LLC PR 5.875 21-31 01/09S | 25.000 | SPECTRUM BRANDS 5.5 20-30 15/07B |
| 100.000 | PRESIDIO HOLDINGS INC 8.25 20-28 01/02S | 3.000 | SPECTRUM BRANDS 5.75 16-25 15/07S |
| 75.000 | PRESTIGE BRANDS 3.7500 21-31 01/04S | 25.000 | SPIRIT AEROSYSTEMS 4.6 18-28 15/06S |
| 75.000 | PRIME HEALTHCARE SERV 7.25 20-25 01/11S | 24.000 | SPRINGLEAF FINANCE CO 6.875 18-25 15/03S |
| 25.000 | PRIME SECURITY SERV 5.25 19-24 15/04S4S | 25.000 | SPRINGLEAF FINANCE 5.3750 19-29 15/11S |
| 25.000 | PRIME SECURITY SERVIC 3.375 20-27 31/06S | 75.000 | SPRINGLEAF FINANCE 6.625 19-28 15/01S |
| 25.000 | PRIME SECURITY SERVIC 6.25 20-28 15/01S | 115.000 | SPRINGLEAF FINANCE 7.1250 18-26 15/03S |
| 75.000 | PRIMO WATER HOLD INC 21-29 30/04S | 75.000 | SPRINT CAPITAL CORP 6.875 98-28 15/11S |
| 25.000 | PROG HOLDINGS I 6.0000 21-29 15/11S | 82.000 | SPRINT CAPITAL CORP 8.75 02-32 15/03S |
| 25.000 | QVC INC 4.7500 20-27 15/02S | 125.000 | SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S |
| 100.000 | RADIAN GROUP INC 4.875 19-27 15/03S | 50.000 | SPRINT CORPORATION 7.125 14-24 15/06S |
| 50.000 | RAPTOR ACQUISITION CO 4.875 21-26 01/11S | 25.000 | SPRINT CORPORATION 7.625 19-26 01/03S |
| 3.734.026 | REICHHOLD 144A 9.00 12-17 20/04S (IN DEFAULT) | 100.000 | SRM ESCROW ISSUER 6.00 20-28 01/11S |
| 25.000 | RESIDEO FUNDING | 25.000 | SRS DISTRIBUTION INC 6.0 21-29 01/12S |
| 25.000 | RHP HOTEL PROPERTIES 4.5 21-29 15/02S | 25.000 | SRS DISTRIBUTION INC 4.625 21-28 01/07S |
| 75.000 | RLJ LODGING TRUST 4.00 21-29 15/09S | 75.000 | SSC TECHNOLOGIE 5.5 19-27 28/03S |
| 75.000 | RLJ LODGING TRUST 3.75 21-26 17/06S | 50.000 | STANDARD INDUSTRIES 4.3750 20-30 15/07S |
| 50.000 | ROCKCLIFF ENERG 5.5000 21-29 15/10S | 100.000 | STAPLES INC 7.5 19-26 15/04S |
| 25.000 | ROCKET MORTGAGE LLC 2.875 21-26 15/10S0S | 100.000 | STAPLES INC 10.75 19-27 15/04S |
| 50.000 | ROCKIES EXP PIPELINE 6.875 10-40 15/04S | 25.000 | STARWOOD PROPER 3.7500 21-24 31/12S |
| 50.000 | ROLLER BEARING COMP 4.375 21-29 15/10S | 25.000 | STATION CASINOS 4.6250 21-31 01/12S |
| 25.000 | R ESCROW ISSUER LLC 5.25 20-25 15/12S | 50.000 | STL HOLDING CO LLC 7.5 20-26 15/02S |
| 25.000 | SABRE GBL INC 7.3750 20-25 01/09S | 50.000 | SUBURBAN PROPANE PARTN 5.0 21-31 01/06S |
| 50.000 | SCIENCE APPLICA 4.8750 20-28 01/04S | 75.000 | SUMMIT MATERIALS LLC 5.2500 20-29 15/01S |
| 125.000 | SCIENTIFIC GAMES 7.000 19-28 15/05S | 125.000 | SUNOCO LP/SUNOCO FIN 4.50 22-30 30/04S |
| 25.000 | SCIENTIFIC GAMES 7.2500 19-29 15/11S | 50.000 | SWF ESCROW ISSUER 6.5 21-29 01/10S |
| 75.000 | SCIH SALT 6.625 21-29 01/05S | 50.000 | SYNAPTICS INC 4 21-29 15/06S21-29 15/06S |
| 75.000 | SCIH SALT HOLDI 4.8750 21-28 01/05S | 50.000 | TALLGRASS ENERGY 6.00 20-30 31/12S |
| 25.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 5.375 20-31 15/01S | 25.000 | TALLGRASS ENERGY 7.5 20-25 01/10S |
| 25.000 | SCRIPPS ESCROW INC 19-27 15/07S | 50.000 | TALLGRASS ENERGY PARTN 6.0 21-31 01/09S |
| 25.000 | SEALED AIR CORP 4.0000 19-27 01/12S | 25.000 | TALOS PRODUCTION LLC 12.21-26 15/01S |
| 100.000 | SEAWORLD PARKS 5.2500 21-29 15/08S | 25.000 | TAP ROCK RESOURCES 7.00 21-26 01/10S |
| 100.000 | SEG HLD LLC/SEG 5.6250 20-28 15/10S | 75.000 | TEGNA INC 4.625 20-28 15/03S |
| 50.000 | SELECT MEDICAL CORP 6.25 19-26 15/08S S | 25.000 | TEGNA INC 5 20-29 15/09S |
| | 89.337,04 | | 85.185,07 |
| | 63.570,54 | | 45.647,16 |
| | 50.109,67 | | 33.608,99 |
| | 29.362,68 | | 62.638,38 |
| | 49.076,59 | | 23.942,02 |
| | 62.997,61 | | 35.065,88 |
| | 48.805,48 | | 43.750,00 |
| | 88.978,57 | | 42.390,57 |
| | 24.684,92 | | 61.843,11 |
| | 16.247,27 | | 56.205,42 |
| | 79.877,56 | | 52.463,29 |
| | 75.184,30 | | 66.698,27 |
| | 39.302,82 | | 65.205,84 |
| | 40.549,92 | | 68.660,54 |
| | 65.085,00 | | 138.398,47 |
| | 41.941,50 | | 69.348,17 |
| | 58.937,92 | | 24.433,28 |
| | 19.035,68 | | 64.237,75 |
| | 9.621,51 | | 49.838,05 |
| | 42.290,69 | | 40.404,37 |
| | 22.670,10 | | 39.405,39 |
| | 47.367,35 | | 60.321,52 |
| | 18.447,05 | | 19.563,56 |
| | 53.049,83 | | 22.320,43 |
| | 92.766,57 | | 2.974,09 |
| | 62.106,89 | | 20.267,36 |
| | 63.612,45 | | 23.134,11 |
| | 24.649,91 | | 20.505,01 |
| | 21.813,26 | | 69.236,05 |
| | 22.847,77 | | 109.428,12 |
| | 65.050,70 | | 78.065,53 |
| | 20.167,48 | | 97.636,22 |
| | 17.731,97 | | 126.961,98 |
| | 91.859,49 | | 51.048,12 |
| | 44.908,49 | | 26.356,66 |
| | 0,04 | | 89.572,66 |
| | 20.245,16 | | 20.089,25 |
| | 21.714,38 | | 22.385,44 |
| | 61.327,93 | | 70.756,97 |
| | 67.050,40 | | 40.992,13 |
| | 45.823,26 | | 86.275,84 |
| | 21.570,58 | | 72.232,98 |
| | 42.154,24 | | 23.703,54 |
| | 43.500,83 | | 20.165,87 |
| | 19.148,47 | | 43.717,19 |
| | 23.990,10 | | 42.894,64 |
| | 46.497,72 | | 69.960,13 |
| | 119.672,89 | | 108.685,22 |
| | 24.018,85 | | 29.080,44 |
| | 60.725,88 | | 42.183,59 |
| | 64.688,35 | | 43.581,60 |
| | 20.146,30 | | 25.236,94 |
| | 22.506,90 | | 43.152,17 |
| | 22.825,92 | | 26.400,62 |
| | 87.335,21 | | 23.293,85 |
| | 93.756,30 | | 71.288,55 |
| | 47.716,89 | | 23.706,59 |

ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

| 数量 | 評価額 米ドル | 数量 | 評価額 米ドル |
|---------|--|---------|---|
| 75.000 | TEMPUR SEALY INTL INC 4.0 21-29 15/04S | 25.000 | VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-29 15/08S |
| 100.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.25 21-29 01/06S | 50.000 | VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-33 01/11S |
| 250.000 | TENET HEALTHCARE CORP 6.125 20-28 01/10S | 50.000 | VENTURE GLOBAL CALCAS 4.125 21-31 15/08S |
| 75.000 | TENET HEALTHCARE 4.625 19-24 01/09S | 26.500 | VERICAST MERGER SUB 11.00 21-26 15/09S |
| 100.000 | TENET HEALTHCARE 4.875 19-26 01/01S | 25.000 | VERSCEND 9.75 18-26 27/08S |
| 75.000 | TEREX CORP 5.0000 21-29 15/05S | 50.000 | VICI PROPERTIES 3.75 20-27 15/02S |
| 75.000 | TERRAFORM POWER 4.7500 19-30 15/01S | 25.000 | VICI PROPERTIES LP 4.125 20-30 15/08S8S |
| 25.000 | THE ADT CORPORATION 4.875 16-32 15/07S | 25.000 | VICTORIA'S SECR 4.6250 21-29 15/07S |
| 50.000 | THE CHEMOURS CO 5.375 17-27 15/05S | 50.000 | VIKING CRUISES LTD 5.875 17-27 15/09S |
| 50.000 | THE SCOTTS MIRACLE-GRO 4.00 22-31 01/04S | 50.000 | VIKING CRUISES LTD 6.25 15-25 15/05S |
| 25.000 | THOR INDUSTRIES 4.0000 21-29 15/10S | 50.000 | VIKING CRUISES LTD 7.00 21-29 15/02S |
| 50.000 | TKC HOLDINGS INC 10.5 21-29 15/05S | 25.000 | VISTRA OPERATIONS CO 4.375 21-29 01/05S |
| 75.000 | T-MOBILE USA INC 3.375 21-29 15/04S | 75.000 | VISTRA OPERATIONS CO 5 19-27 31/07S |
| 25.000 | T-MOBILE USA INC 2.8750 21-31 15/02S | 50.000 | WASH MULTIFAMILY ACQ 5.75 21-26 15/04S |
| 25.000 | T-MOBILE USA INC 3.50 21-31 15/04S | 50.000 | WEEKLEY HOMES LLC 4.875 20-28 15/09S |
| 100.000 | T-MOBILE USA INC 4.75 18-28 01/02S | 100.000 | WERNER FINCO LP1N 8.75 17-25 15/07S |
| 25.000 | TMS INTERNATIONAL CORP 6.25 21-29 15/04S | 50.000 | WESTERN GAS PARTNERS 4.50 18-28 01/03S |
| 25.000 | TOLL BROS FINANCE 4.875 17-27 15/03S | 25.000 | WESTERN GAS PARTNERS 4.7500 18-28 15/08S |
| 25.000 | TOPBUILD CORP 4.1250 21-32 15/02S | 100.000 | WESTERN GAS PARTNERS 5.30 18-48 01/03S |
| 21.875 | TRANSOCEAN POSEIDON 6.875 19-27 01/02S | 25.000 | WESTERN GAS PARTNERS 5.45 14-44 01/04S |
| 75.000 | TRAVEL + LEISURE CO 6.625 20-26 31/07S | 25.000 | WESTERN GAS PARTNERS 5.5 18-48 15/08S08S |
| 25.000 | TRAVEL + LEISURE CO 4.6250 19-30 01/03S | 50.000 | WESTERN GLOBAL 10.3750 20-25 15/08 |
| 50.000 | TRI POINTE HOMES 5.25 17-27 01/06S | 50.000 | WHEEL PROS ESCROW ISS 6.500 21-29 15/05S |
| 50.000 | TRIDENT TPI-144A 9.25 19-24 01/08S | 50.000 | WHITE CAP BUYER 6.875 20-28 15/10S |
| 50.000 | TRIMAS CORP 4.125 21-29 15/04S | 50.000 | WILLIAMS SCOTSMAN 4.6250 20-28 15/08S |
| 100.000 | TRINSEO OP 5.125 21-29 01/04S | 50.000 | WINNEBAGO INDUS 6.2500 20-28 15/07S |
| 75.000 | TRINSEO OP 5.375 17-25 01/09S | 50.000 | WORLD ACCEPTANCE CORP 7.00 21-26 01/11S |
| 50.000 | TRITON WATER HOLDINGS 6.25 21-29 01/04S | 25.000 | W.R. GRACE HOLDINGS 4.875 21-27 15/06S |
| 25.000 | TRIUMPH GROUP I 6.2500 19-24 15/09S | 25.000 | WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625 21-29 15/08S |
| 15.000 | TRIUMPH GROUP I 8.8750 20-24 01/06S | 75.000 | WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S |
| 75.000 | TRONOX INC 4.625 21-29 15/03S | 100.000 | WYNN RESORTS FINANCE 5.125 19-29 01/10S |
| 75.000 | TTM TECHNOLOGIES INC 4 21-29 10/03S | 50.000 | XEROX HOLDINGS CORP 5.00 20-25 15/08S |
| 50.000 | TWILIO INC3.875 21-31 15/03S | 25.000 | XEROX HOLDINGS CORP 5.50 20-28 15/08S |
| 50.000 | UBER TECHNOLOGIES 6.25 20-28 15/01S | 50.000 | XHR LP 4.875 21-29 01/06S |
| 50.000 | UBER TECHNOLOGIES 7.5 19-27 15/09S | 25.000 | XHR LP 6.375 20-25 15/08S |
| 100.000 | UBER TECHNOLOGIES 8.0 18-26 01/11S | 100.000 | YUM BRANDS 5.375 22-32 01/04S |
| 50.000 | UBER TECHNOLOGIES 4.5 21-29 15/08S | | フランス |
| 25.000 | UNIFRAX ESCROW 5.2500 21-28 30/09S | 225.000 | ALTICE FRANCE SA 5.125 21-29 15/07S |
| 50.000 | UNITED AIR LINES INC 4.375 21-26 21/04S | 200.000 | ALTICE FRANCE SA 8.1250 18-27 01/02S |
| 19.760 | UNITED AIRLINES 2020 5.875 20-27 28/10Q | | ケイマン諸島 |
| 50.000 | UNITED AIRLINES 4.6250 21-29 15/04S | 50.000 | AMERICAN AIRLINES 5.5 21-26 24/03Q |
| 25.000 | UNITED RENTALS 3.7500 21-32 15/01S | 75.000 | AMERICAN AIRLINES 5.75 21-29 20/04Q |
| 75.000 | UNITED RENTALS INC 3.875 20-31 15/02S | 50.000 | HAWAIIAN BRAND 5.75 21-26 20/01Q 04/02Q |
| 100.000 | UNITED RENTALS NORTH 5.25 19-30 15/01S | 25.000 | HERBALIFE NUTRITION 7.875 20-25 01/09S |
| 75.000 | UNITED SHORE FIN SERV 5.5 21-29 15/04S | 55.000 | SEAGATE HDD CAYMAN 4.125 20-31 15/01S |
| 25.000 | UNITED WHOLESAL 5.7500 21-27 15/06S | 14.960 | SPIRIT LOYALTY 8.0000 20-25 20/09Q |
| 50.000 | UNITI GROUP/CSL 4.7500 21-28 15/04S | 12.484 | TRANSOCEAN GUARDIAN 5.875 18-24 15/01S |
| 50.000 | UNITI GROUP/CSL 6.5000 21-29 15/02S | 47.000 | TRANSOCEAN INC 11.5 20-27 30/01S |
| 50.000 | UNITI GROUP/CSL 7.875 20-25 15/02S | 25.000 | TRANSOCEAN INC 7.35 11-41 15/12S |
| 75.000 | UNIVAR SOLUTION 5.1250 19-27 01/12S | 25.000 | TRANSOCEAN INC 7.50 01-31 15/04S |
| 25.000 | UNIVISION COMM 5 125 15-25 15/02S 15/02S | 50.000 | TRANSOCEAN INC 7.25 18-25 01/11S |
| 125.000 | UNIVISION COMMUNICATI 4.5 21-29 01/05S | 50.000 | TRANSOCEAN LTD 8.0000 20-27 01/02S |
| 100.000 | UNIVISION COMMUNICATI 6.625 20-27 01/06S | | アイルランド |
| 125.000 | US FOODS INC 4.75 21-29 15/02S | 161.000 | ENDO DESIGNATED ACTIVI 6.00 20-28 DEFAULT |
| 49.000 | USA COMPRESSION PART 6.875 18-26 01/04S | 77.000 | ENDO LTD / ENDO FINANCE 9.5 20-27 DEFAULT |
| 25.000 | USA COMPRESSION PART 6.875 19-27 17/12S | | |
| 125.000 | VALEANT PHARMA 8.5 18-27 01/06S | | |

| 数量 | 評価額 米ドル |
|--|----------------------|
| イタリア | 23,741,04 |
| 25,000 TELECOM ITALIA SPA 5.303 14-24 30/05S | 23,741,04 |
| リベリア | 241,133,84 |
| 50,000 ROYAL CARIBBEAN CRUISES 5.5 21-26 31/08S | 42,140,13 |
| 75,000 ROYAL CARIBBEAN 3.7 17-28 15/03S | 55,712,43 |
| 125,000 ROYAL CARIBBEAN 5.5 21-28 01/04S | 99,969,25 |
| 50,000 ROYAL CARIBBEAN 7.5000 97-27 15/10S | 43,312,03 |
| ルクセンブルク | 389,359,07 |
| 200,000 ALTICE FRANCE HOLDIN 6 20-28 06/02S | 118,594,65 |
| 50,000 CAMELOT FINANCE SA 4.5 19-26 01/11S1/11S | 47,051,54 |
| 75,000 ENDO LUX FINANCE COM 7.125 21-29 DEFAULT | 57,093,75 |
| 50,000 JBS USA LUX SA 5.50 19-30 15/01S | 47,596,73 |
| 75,000 TELECOM ITALIA CAP 6 05-34 30/09S 30/09S | 57,515,03 |
| 50,000 TELECOM ITALIA CAP 6.375 04-33 15/11S | 41,200,33 |
| 25,000 TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20 06-36 18/07S | 20,307,04 |
| パナマ | 1,068,396,05 |
| 825,000 CARNIVAL CORP 5.75 21-27 01/03S | 589,923,18 |
| 200,000 CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S | 160,023,85 |
| 275,000 CARNIVAL CORPORATION 6 21-29 01/05S | 184,782,92 |
| 100,000 CARNIVAL CORPORATION 10.50 20-26 01/02S | 100,631,51 |
| 50,000 CARNIVAL CORPORATION 6.65 98-28 15/01S | 33,034,59 |
| オランダ | 296,454,74 |
| 50,000 ELASTIC NV 4.1250 21-29 15/07S | 40,506,88 |
| 100,000 OI EUROPEAN GROUP BV 4.75 21-30 15/02S | 88,527,68 |
| 200,000 UPC BROADBAND FINCO B 4.875 21-31 15/07S | 167,420,18 |
| イギリス | 38,429,46 |
| 50,000 PAYSAFE FIN PLC 4.0000 21-29 15/06S | 38,429,46 |
| スイス | 32,929,20 |
| 33,077 TRANSOCEAN SENTRY LT 5.375 19-23 15/05S | 32,929,20 |
| 変動利付債 | 212,295,32 |
| カナダ | 35,252,93 |
| 50,000 INTELLIGENT PACKAGING FL.R 20-26 15/01S | 35,252,93 |
| アメリカ | 177,042,39 |
| 215,847 AMC ENTERTAINMENT HO FL.R 20-26 15/06S | 89,908,39 |
| 50,000 IRIS HOLDINGS INC FL.R 21-26 15/02S | 43,786,25 |
| 50,000 WHITE CAPITAL PARENT FL.R 21-26 15/03S | 43,347,75 |
| 合計 | 41,194,809,95 |

■外国為替先物契約（IH3シェアクラス、豪ドル）（2022年12月31日現在）

| 買建 | 契約額 | 売建 | 契約額 | 満期日 | 評価損益 米ドル |
|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|-------------|
| 米ドル | 677,147.60 | オーストラリアドル | 1,000,000.00 | 2023/2/2 | △ 1,876.50 |
| オーストラリアドル | 44,300,000.00 | 米ドル | 29,283,473.95 | 2023/2/2 | 797,401.32 |
| | | | | 合計 | 795,524.82 |

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

運用報告書

《第16期》

決算日：2023年2月15日

（計算期間：2022年2月16日～2023年2月15日）

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、期中の運用状況についてご報告申し上げます。

■投資対象ファンドの概要

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 主として本邦通貨表示の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行うとともに、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図ります。 |
| 主要運用対象 | 本邦通貨表示の短期公社債を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 外貨建資産への投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基 | 準 価 額 | | 債券組入率 比 | 純 資 産 額 |
|-----------------|--------|-----------|-----------|------------|---------|
| | | 税 込 分 配 金 | 期 騰 落 中 率 | | |
| 12期（2019年2月15日） | 円 | 円 | % | % | 百万円 |
| 12期（2019年2月15日） | 10,055 | 0 | △0.1 | 59.0 | 763 |
| 13期（2020年2月17日） | 10,048 | 0 | △0.1 | 61.1 | 788 |
| 14期（2021年2月15日） | 10,042 | 0 | △0.1 | 64.6 | 773 |
| 15期（2022年2月15日） | 10,035 | 0 | △0.1 | 70.8 | 552 |
| 16期（2023年2月15日） | 10,027 | 0 | △0.1 | 74.3 | 473 |

（注）当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

■ 当期中の基準価額等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 券 組 入 率 |
|----------------------|-------------|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 | 落 | |
| (期 首) 2022年 2月15日 | 円 10,035 | % — | % 70.8 | % 70.8 |
| 2月末 | 10,035 | 0.0 | | 72.7 |
| 3月末 | 10,034 | △0.0 | | 70.4 |
| 4月末 | 10,033 | △0.0 | | 72.0 |
| 5月末 | 10,033 | △0.0 | | 76.0 |
| 6月末 | 10,033 | △0.0 | | 71.3 |
| 7月末 | 10,033 | △0.0 | | 71.8 |
| 8月末 | 10,032 | △0.0 | | 71.7 |
| 9月末 | 10,031 | △0.0 | | 71.8 |
| 10月末 | 10,031 | △0.0 | | 72.0 |
| 11月末 | 10,028 | △0.1 | | 77.3 |
| 12月末 | 10,024 | △0.1 | | 67.3 |
| 2023年 1月末 | 10,026 | △0.1 | | 70.8 |
| (期 末) 2023年 2月15日 | 10,027 | △0.1 | | 74.3 |

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 第16期 (2022年 2月16日 ～2023年 2月15日) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|---------------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 1円 | 0.011% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (1) | (0.009) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (0) | (0.001) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (0) | (0.002) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 1 | 0.007 | その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （その他） | (1) | (0.007) | 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 2 | 0.018 | |

期中の平均基準価額は10,031円です。

(注1) 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。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 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（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|-------|---------|----------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 地方債証券 | 724,687 | 100,031 (660,000) |

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ()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。

■主要な売買銘柄（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

公社債

| 買付 | | 売付 | |
|------------------------|---------|--------------|---------|
| 銘柄 | 金額 | 銘柄 | 金額 |
| 千円 | | 千円 | |
| 第128回共同発行市場公募地方債 | 251,715 | 第715回東京都公募公債 | 100,031 |
| 第116回共同発行市場公募地方債 | 150,919 | | |
| 第715回東京都公募公債 | 120,642 | | |
| 第375回大阪府公募公債（10年） | 100,821 | | |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債（10年） | 100,590 | | |

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細（2023年2月15日現在）

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 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 | | | | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | | | |
| 千円 | 千円 | % | % | % | % | % | % | | | |
| 地方債証券 | 350,000 (350,000) | 351,667 (351,667) | 74.3 (74.3) | — | — | — | — | 74.3 (74.3) | | |
| 合計 | 350,000 (350,000) | 351,667 (351,667) | 74.3 (74.3) | — | — | — | — | 74.3 (74.3) | | |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 一印は組入れなしです。

(注4) 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おります。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

| 種類 | 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|-------|-------------------|-------|---------|---------|------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| | | % | 千円 | 千円 | % | 千円 | 千円 | |
| 地方債証券 | 第375回大阪府公募公債（10年） | 0.835 | 100,000 | 100,435 | 0.66 | 250,000 | 251,232 | 2023/8/29 |
| | 第128回共同発行市場公募地方債 | | | | | | | 2023/11/24 |
| 合計 | | | 350,000 | 351,667 | | | | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成（2023年2月15日現在）

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 351,667 | 74.3 |
| コー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 121,795 | 25.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 473,462 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年2月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 473,462,230円 |
| コー ル ・ ロ ー ン 等 | 120,619,388 |
| 公 社 債(評価額) | 351,667,500 |
| 未 収 利 息 | 667,316 |
| 前 払 費 用 | 508,026 |
| (B) 負 債 | 73,719 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 67,433 |
| 未 払 利 息 | 346 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 5,940 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 473,388,511 |
| 元 本 | 472,090,843 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 1,297,668 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 472,090,843口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D) | 10,027円 |

(注記事項)

| | |
|-----------|---------------|
| 期首元本額 | 550,147,769 円 |
| 期中追加設定元本額 | 168,597,032 円 |
| 期中一部解約元本額 | 246,653,958 円 |

■損益の状況

当期 自2022年2月16日 至2023年2月15日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,428,904円 |
| 受 取 利 息 | 2,536,785 |
| 支 払 利 息 | △ 107,881 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 2,670,152 |
| 売 買 損 益 | 364,823 |
| 売 買 損 益 | △ 3,034,975 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 111,094 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △ 352,342 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 506,244 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,156,254 |
| (配 当 等 相 当 額) | (14,497,773) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△12,341,519) |
| (G) 計 (D+E+F) | 1,297,668 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H) | 1,297,668 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,156,254 |
| (配 当 等 相 当 額) | (14,497,773) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△12,341,519) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 6,399,260 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 7,257,846 |

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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