

■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／ブラジルリア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-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」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。 | |
| 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（ブラジルリアルコース） | ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円） CAマネープールファンド（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-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円） | 米ドル建のハイイールド債 |
| | CAマネープールファンド（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
（ブラジルリアルコース）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、よろしくごお願い申し上げます。

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（ブラジルリアルコース）

■最近5作成期の運用実績

| | 決 算 期 | 基 準 価 額 (分配落) | 騰 落 率 | | | 投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率 | 投 資 証 券 組 入 比 率 | 純資産総額 |
|--------|--------------------|------------------|-------|-----|-------|-------------------------------|--------------------|-------|
| | | | 税 分 | 込 配 | み 金 | | | |
| 第23作成期 | | 円 | | 円 | % | % | % | 百万円 |
| | 131期 (2020年11月9日) | 1,113 | | 10 | △ 0.2 | 0.3 | 97.8 | 7,893 |
| | 132期 (2020年12月8日) | 1,243 | | 10 | 12.6 | 0.3 | 97.8 | 8,617 |
| | 133期 (2021年1月8日) | 1,180 | | 10 | △ 4.3 | 0.3 | 96.7 | 8,062 |
| | 134期 (2021年2月8日) | 1,203 | | 10 | 2.8 | 0.3 | 98.2 | 8,139 |
| | 135期 (2021年3月8日) | 1,157 | | 10 | △ 3.0 | 0.3 | 98.0 | 7,751 |
| 第24作成期 | 136期 (2021年4月8日) | 1,196 | | 10 | 4.2 | 0.3 | 96.1 | 7,927 |
| | 137期 (2021年5月10日) | 1,259 | | 10 | 6.1 | 0.3 | 91.9 | 8,239 |
| | 138期 (2021年6月8日) | 1,296 | | 10 | 3.7 | 0.3 | 98.1 | 8,376 |
| | 139期 (2021年7月8日) | 1,275 | | 10 | △ 0.8 | 0.3 | 97.1 | 8,135 |
| | 140期 (2021年8月10日) | 1,248 | | 10 | △ 1.3 | 0.3 | 97.3 | 7,858 |
| | 141期 (2021年9月8日) | 1,281 | | 10 | 3.4 | 0.3 | 97.4 | 7,974 |
| 第25作成期 | 142期 (2021年10月8日) | 1,213 | | 10 | △ 4.5 | 0.3 | 97.6 | 7,446 |
| | 143期 (2021年11月8日) | 1,229 | | 10 | 2.1 | 0.3 | 97.5 | 7,446 |
| | 144期 (2021年12月8日) | 1,199 | | 10 | △ 1.6 | 0.3 | 97.5 | 7,105 |
| | 145期 (2022年1月11日) | 1,197 | | 10 | 0.7 | 0.4 | 97.4 | 6,906 |
| | 146期 (2022年2月8日) | 1,256 | | 10 | 5.8 | 0.4 | 97.3 | 7,013 |
| | 147期 (2022年3月8日) | 1,293 | | 10 | 3.7 | 0.3 | 97.7 | 7,161 |
| 第26作成期 | 148期 (2022年4月8日) | 1,457 | | 10 | 13.5 | 0.3 | 97.7 | 7,927 |
| | 149期 (2022年5月9日) | 1,392 | | 10 | △ 3.8 | 0.3 | 95.2 | 7,342 |
| | 150期 (2022年6月8日) | 1,463 | | 10 | 5.8 | 0.3 | 97.6 | 7,647 |
| | 151期 (2022年7月8日) | 1,309 | | 10 | △ 9.8 | 0.4 | 97.0 | 6,788 |
| | 152期 (2022年8月8日) | 1,407 | | 10 | 8.3 | 0.3 | 97.7 | 7,220 |
| | 153期 (2022年9月8日) | 1,443 | | 10 | 3.3 | 0.3 | 97.0 | 7,348 |
| 第27作成期 | 154期 (2022年10月11日) | 1,429 | | 10 | △ 0.3 | 0.3 | 98.0 | 7,152 |
| | 155期 (2022年11月8日) | 1,464 | | 10 | 3.1 | 0.3 | 98.0 | 7,230 |
| | 156期 (2022年12月8日) | 1,381 | | 10 | △ 5.0 | 0.4 | 97.7 | 6,750 |
| | 157期 (2023年1月10日) | 1,334 | | 10 | △ 2.7 | 0.4 | 97.8 | 6,466 |
| | 158期 (2023年2月8日) | 1,366 | | 10 | 3.1 | 0.4 | 97.6 | 6,584 |
| | 159期 (2023年3月8日) | 1,399 | | 10 | 3.1 | 0.4 | 97.2 | 6,726 |
| | 160期 (2023年4月10日) | 1,393 | | 10 | 0.3 | 0.4 | 96.9 | 6,672 |

(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（ブラジルリアルコース）

■ 当作成期中の基準価額等の推移

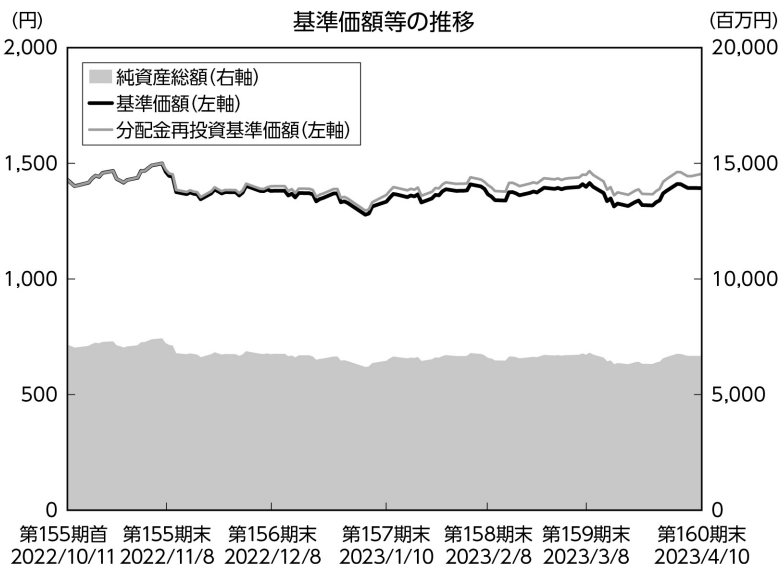
| 決算期 | 年 月 日 | 基準価額 | 騰 落 率 | 投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率 | 投 資 証 券 組 入 比 率 |
|-------|------------------|-------|-------|-------------------------------|--------------------|
| | | | | | |
| 第155期 | (期 首)2022年10月11日 | 円 | % | % | % |
| | 10月末 | 1,429 | - | 0.3 | 98.0 |
| | (期 末)2022年11月8日 | 1,438 | 0.6 | 0.3 | 98.3 |
| 第156期 | (期 首)2022年11月8日 | 1,474 | 3.1 | 0.3 | 98.0 |
| | 11月末 | 1,464 | - | 0.3 | 98.0 |
| | (期 末)2022年12月8日 | 1,374 | △6.1 | 0.4 | 98.2 |
| 第157期 | (期 首)2022年12月8日 | 1,391 | △5.0 | 0.4 | 97.7 |
| | 12月末 | 1,381 | - | 0.4 | 97.7 |
| | (期 末)2023年1月10日 | 1,329 | △3.8 | 0.4 | 98.5 |
| 第158期 | (期 首)2023年1月10日 | 1,344 | △2.7 | 0.4 | 97.8 |
| | 1月末 | 1,334 | - | 0.4 | 97.8 |
| | (期 末)2023年2月8日 | 1,382 | 3.6 | 0.4 | 98.3 |
| 第159期 | (期 首)2023年2月8日 | 1,376 | 3.1 | 0.4 | 97.6 |
| | 2月末 | 1,366 | - | 0.4 | 97.6 |
| | (期 末)2023年3月8日 | 1,394 | 2.0 | 0.4 | 97.9 |
| 第160期 | (期 首)2023年3月8日 | 1,409 | 3.1 | 0.4 | 97.2 |
| | 3月末 | 1,399 | - | 0.4 | 97.2 |
| | (期 末)2023年4月10日 | 1,382 | △1.2 | 0.4 | 97.5 |
| | | 1,403 | 0.3 | 0.4 | 96.9 |

(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。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

【基準価額等の推移】

| | |
|----------------|---------------------|
| 第155期首 | 1,429円 |
| 第160期末 | 1,393円 |
| 既払分配金 (税込み) | 60円 |
| 騰落率 | 1.8% (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月から2月にかけて、ブラジルリアル高・円安傾向となったこと
- ③米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

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月に、ブラジルリアル安・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（ブラジルリアルコース）

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、ブラジルリアル/円相場は28円台で始まり、ブラジル大統領選挙での左派候補の当選見通しなどが支援材料となり29円付近へ上昇しました。その後、次期大統領の政策が財政悪化懸念を高めたことなどから下落しました。さらに、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、ブラジルリアルは下落し、1月の初めには一時24円を割り込む水準となりました。その後、欧米の利上げペース減速期待が高まったことや、中国経済再開が好感されたことに加え、日本銀行の次期総裁候補の植田氏の発言などを受け円安が進行し、ブラジルリアルは緩やかに上昇しました。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、ブラジルリアルは下落した後、財政赤字拡大への懸念が和らいだことなどから反発し、26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「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」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「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」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入れました。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）

<ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）>

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（ブラジルリアルコース）

米ドル建資産に対し、米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引を行い、当作成期を通じてブラジルレア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-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」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-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）>

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／ブラジルリア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)

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■ 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) | 7円 (3) (4) (0) | 0.480% (0.191) (0.273) (0.016) | 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 | 7 | 0.485 | |

期中の平均基準価額は1,383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。

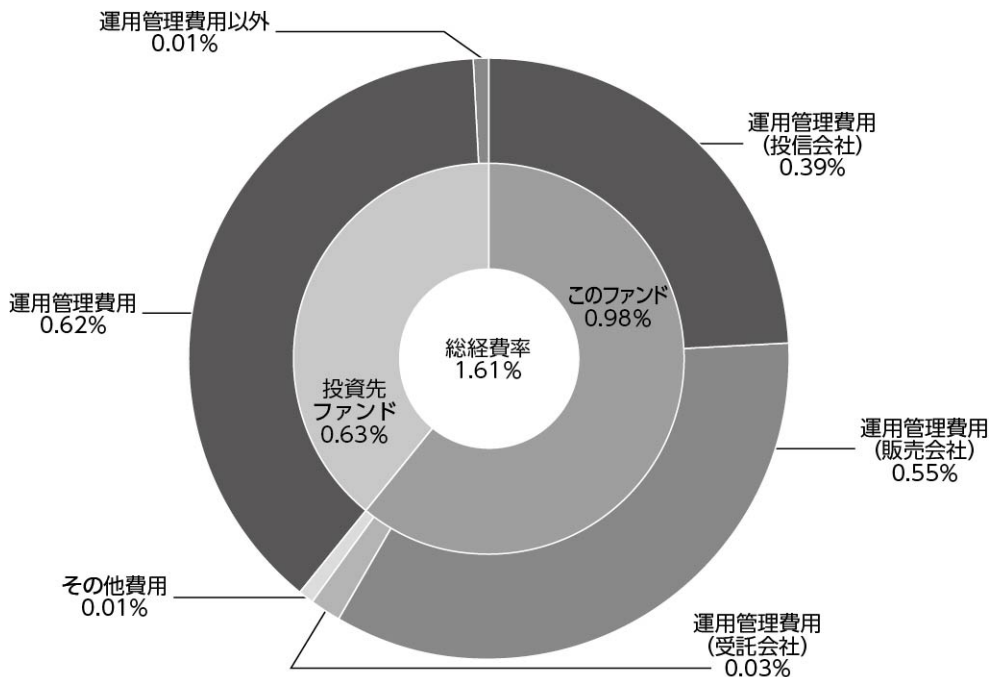
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

（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（ブラジルリアルコース）

■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) | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円) | — | — | 48,000 | 80,912 |

(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 24,626,158 | 口 24,626,158 | 千円 24,692 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 24,626,158 | 24,626,158 | 24,692 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | <0.4%> |

(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（邦貨建）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 |
| (ルクセンブルク) ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円) | | 口 4,103,166 | 口 4,055,166 | 千円 6,463,935 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 4,103,166 | 4,055,166 | 6,463,935 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | <96.9%> |

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■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 | 24,692 | 0.4 |
| 投 資 証 券 | 6,463,935 | 96.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 239,047 | 3.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 6,727,674 | 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

| 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 | 7,312,048,698円 | 6,812,142,823円 | 6,520,616,710円 | 6,642,823,227円 | 6,783,257,008円 | 6,727,674,712円 |
| コール・ローン等 | 200,631,564 | 189,689,269 | 173,926,794 | 190,691,593 | 217,578,248 | 239,046,579 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 24,702,499 | 24,697,573 | 24,685,260 | 24,692,648 | 24,695,111 | 24,692,648 |
| 投資証券(評価額) | 7,086,714,635 | 6,597,755,981 | 6,322,004,656 | 6,427,438,986 | 6,540,983,649 | 6,463,935,485 |
| (B) 負 債 | 81,158,413 | 61,657,058 | 54,425,730 | 58,370,406 | 57,023,981 | 55,097,762 |
| 未払収益分配金 | 49,395,977 | 48,881,348 | 48,469,359 | 48,215,818 | 48,070,350 | 47,887,212 |
| 未払解約金 | 26,363,345 | 7,247,850 | 39,390 | 4,818,258 | 3,740,296 | 1,158,356 |
| 未払信託報酬 | 5,340,774 | 5,411,560 | 5,738,115 | 5,102,770 | 4,925,845 | 5,703,662 |
| 未払利息 | 549 | — | 500 | — | 649 | — |
| その他未払費用 | 57,768 | 116,300 | 178,366 | 233,560 | 286,841 | 348,532 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,230,890,285 | 6,750,485,765 | 6,466,190,980 | 6,584,452,821 | 6,726,233,027 | 6,672,576,950 |
| 元 本 | 49,395,977,349 | 48,881,348,909 | 48,469,359,180 | 48,215,818,249 | 48,070,350,988 | 47,887,212,371 |
| 次期繰越損益金 | △42,165,087,064 | △42,130,863,144 | △42,003,168,200 | △41,631,365,428 | △41,344,117,961 | △41,214,635,421 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 49,395,977,349口 | 48,881,348,909口 | 48,469,359,180口 | 48,215,818,249口 | 48,070,350,988口 | 47,887,212,371口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 1,464円 | 1,381円 | 1,334円 | 1,366円 | 1,399円 | 1,393円 |

(注記事項)

| | |
|-------------|-----------------|
| 作成期首元本額 | 50,053,733,180円 |
| 作成期中追加設定元本額 | 815,317,528円 |
| 作成期中一部解約元本額 | 2,981,838,337円 |

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■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 | 101,508,417円 | 101,090,791円 | 101,340,709円 | 101,283,169円 | 101,237,429円 | 101,271,225円 |
| 受 取 配 当 金 | 101,519,123 | 101,097,099 | 101,350,314 | 101,291,556 | 101,248,836 | 101,280,077 |
| 支 払 利 息 | △ 10,706 | △ 6,308 | △ 9,605 | △ 8,387 | △ 11,407 | △ 8,852 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 125,342,020 | △ 451,810,626 | △ 274,515,125 | 104,126,788 | 113,451,976 | △ 75,645,837 |
| 売 買 益 | 126,888,017 | 4,436,362 | 1,181,651 | 105,426,720 | 113,589,822 | 1,408,142 |
| 売 買 損 | △ 1,545,997 | △ 456,246,988 | △ 275,696,776 | △ 1,299,932 | △ 137,846 | △ 77,053,979 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 5,399,395 | △ 5,472,837 | △ 5,801,285 | △ 5,162,869 | △ 4,981,752 | △ 5,767,728 |
| (D) 当 期 繰 越 損 益 (A+B+C) | 221,451,042 | △ 356,192,672 | △ 178,975,701 | 200,247,088 | 209,707,653 | 19,857,660 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 9,103,246,243 | △ 8,814,637,672 | △ 9,115,952,900 | △ 9,267,529,235 | △ 9,062,309,483 | △ 8,842,323,549 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 33,233,895,886 | △ 32,911,151,452 | △ 32,659,770,240 | △ 32,515,867,463 | △ 32,443,445,781 | △ 32,344,282,320 |
| (配当等相当額) | (5,377,911,030) | (5,339,651,494) | (5,313,609,637) | (5,305,129,466) | (5,307,980,417) | (5,306,143,810) |
| (売買損益相当額) | (△38,611,806,916) | (△38,250,802,946) | (△37,973,379,877) | (△37,820,996,929) | (△37,751,426,198) | (△37,650,426,130) |
| (G) 計 (D+E+F) | △ 42,115,691,087 | △ 42,081,981,796 | △ 41,954,698,841 | △ 41,583,149,610 | △ 41,296,047,611 | △ 41,166,748,209 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 49,395,977 | △ 48,881,348 | △ 48,469,359 | △ 48,215,818 | △ 48,070,350 | △ 47,887,212 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △ 42,165,087,064 | △ 42,130,863,144 | △ 42,003,168,200 | △ 41,631,365,428 | △ 41,344,117,961 | △ 41,214,635,421 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 33,233,895,886 | △ 32,911,151,452 | △ 32,659,770,240 | △ 32,515,867,463 | △ 32,443,445,781 | △ 32,344,282,320 |
| (配当等相当額) | (5,377,911,030) | (5,339,651,494) | (5,313,609,637) | (5,305,129,466) | (5,307,980,417) | (5,306,143,810) |
| (売買損益相当額) | (△38,611,806,916) | (△38,250,802,946) | (△37,973,379,877) | (△37,820,996,929) | (△37,751,426,198) | (△37,650,426,130) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 6,766,400,149 | 6,724,946,542 | 6,696,428,741 | 6,692,640,809 | 6,704,455,639 | 6,708,175,660 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 15,697,591,327 | △ 15,944,658,234 | △ 16,039,826,701 | △ 15,808,138,774 | △ 15,605,127,819 | △ 15,578,528,761 |

(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 (99,092,188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 (5,377,911,030円) および分配準備積立金 (6,716,703,938円) より分配対象収益は12,193,707,156円 (10,000口当たり2,468円) であり、うち49,395,977円 (10,000口当たり10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 (95,617,954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 (5,339,651,494円) および分配準備積立金 (6,678,209,936円) より分配対象収益は12,113,479,384円 (10,000口当たり2,478円) であり、うち48,881,348円 (10,000口当たり10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 (95,539,424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 (5,313,609,637円) および分配準備積立金 (6,649,358,676円) より分配対象収益は12,058,507,737円 (10,000口当たり2,487円) であり、うち48,469,359円 (10,000口当たり10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 (98,737,358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 (5,305,129,466円) および分配準備積立金 (6,642,119,269円) より分配対象収益は12,045,986,093円 (10,000口当たり2,498円) であり、うち48,215,818円 (10,000口当たり10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 (98,888,035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 (5,307,980,417円) および分配準備積立金 (6,653,637,954円) より分配対象収益は12,060,506,406円 (10,000口当たり2,508円) であり、うち48,070,350円 (10,000口当たり10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 (95,503,497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 (5,306,143,810円) および分配準備積立金 (6,660,559,375円) より分配対象収益は12,062,206,682円 (10,000口当たり2,518円) であり、うち47,887,212円 (10,000口当たり10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（ブラジルリアルコース）

■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） | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10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 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| （対基準価額比率） | (0.678%) | (0.719%) | (0.744%) | (0.727%) | (0.710%) | (0.713%) |
| 当期の収益 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,458 | 2,468 | 2,477 | 2,488 | 2,498 | 2,508 |

（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-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル」の決算日（毎年12月末）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（円） |
|--------|-----------------------|---------------------|-----|---------|------------|
| パナマ | CARNIVAL CORP | 5.75 21-27 01/03S | USD | 650,000 | 69,965,724 |
| アメリカ | FORD MOTOR CREDIT CO | 5.1130 19-29 03/05S | USD | 400,000 | 50,644,135 |
| パナマ | CARNIVAL CORP | 7.625 20-26 01/03S | USD | 350,000 | 41,857,847 |
| アメリカ | CCO HLDG LLC/CAPITAL | 4.5 21-32 01/05S | USD | 375,000 | 40,986,213 |
| | NAVIENT CORP | 6.75 17-25 25/06S | USD | 300,000 | 39,546,164 |
| | T-MOBILE USA INC | 3.375 21-29 15/04S | USD | 300,000 | 37,033,816 |
| | CCO HOLD | 4.75 22-32 01/02S | USD | 300,000 | 33,177,141 |
| ケイマン諸島 | TRANSOCEAN | 6.80 07-38 15/03S | USD | 350,000 | 32,907,396 |
| カナダ | BOMBARDIER | 7.875 19-27 15/04S | USD | 225,000 | 30,840,893 |
| アメリカ | HCA INC | 5.875 15-26 15/02S | USD | 225,000 | 30,368,722 |
| | IMOLA MERGER CO | 4.7500 21-29 15/05S | USD | 250,000 | 29,938,639 |
| | LIFE TIME INC | 8.00 21-26 15/04S | USD | 225,000 | 29,338,650 |
| リベリア | ROYAL CARIBBEAN | 3.7 17-28 15/03S | USD | 275,000 | 29,301,073 |
| アメリカ | HILTON DOMESTIC | 4.875 19-30 15/01S | USD | 225,000 | 28,679,609 |
| | TENET HEALTHCARE | 6.125 20-28 01/10S | USD | 225,000 | 28,042,579 |
| | BOYD GAMING COR | 4.75 20-27 01/12S | USD | 200,000 | 25,709,125 |
| | FORD MOTOR CREDIT CO | 4.134 15-25 04/08 | USD | 200,000 | 25,347,860 |
| フランス | ALTICE FRANCE SA | 8.1250 18-27 01/02S | USD | 200,000 | 24,250,744 |
| カナダ | 1011778 BC UNLIMITED | 4.0000 20-30 15/10S | USD | 200,000 | 23,091,969 |
| アメリカ | SLM CORP | 3.125 21-26 02/11S | USD | 200,000 | 23,037,623 |
| | FORD MOTOR CREDIT CO | 4.000 20-30 13/11S | USD | 200,000 | 22,963,188 |
| イギリス | VMED O2 UK FINA | 4.7500 21-31 15/07S | USD | 200,000 | 22,819,669 |
| アメリカ | DAVITA INC | 4.6250 20-30 01/06S | USD | 200,000 | 22,816,182 |
| イギリス | JAGUAR LAND ROVER | 5.875 20-28 15/01S | USD | 200,000 | 22,795,420 |
| アメリカ | FORD MOTOR CREDIT CO | 2.9 21-28 16/02S | USD | 200,000 | 22,640,450 |
| イギリス | VMED O2 UK FINANCING | 4.25 20-31 31/01S | USD | 200,000 | 22,382,260 |
| パナマ | CARNIVAL CORPORATION | 6 21-29 01/05S | USD | 200,000 | 21,378,838 |
| アメリカ | CCO HLDG LLC/CAPITAL | 4.50 21-33 01/06S | USD | 200,000 | 21,295,533 |
| | DIRECTV FINANCING LLC | 5.875 21-27 15/08S | USD | 175,000 | 20,967,764 |
| | HILTON DOMESTIC | 4.0 20-31 01/05S | USD | 175,000 | 20,689,828 |

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)

■外国為替取引 [NDF]（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 円 |
|---------|----------------|-----|---------------|----------|--------------|
| ブラジルリアル | 254,027,328.00 | 米ドル | 48,000,000.00 | 2023/6/2 | 231,448,022 |
| | | | | 合計 | 231,448,022 |

< 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 B B 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 1 2 8 回 共 同 発 行 市 場 公 募 地 方 債 | 0.66 | 250,000 | 250,992 | 2023/11/24 |
| | 第 3 7 5 回 大 阪 府 公 募 公 債 (1 0 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-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル
 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。

■費用の明細 (2022年1月1日～2022年12月31日)

| 項目 | 当期 |
|-----------|------------|
| | 円 |
| (a)運用報酬 | 32,222,429 |
| (b)管理費用等 | 11,908,281 |
| (c)その他の費用 | 7,874,267 |
| 合計 | 52,004,977 |

■純資産計算書 (2022年12月31日現在)

| 項目 | 当期末 |
|------------|---------------|
| | 円 |
| 資産合計 | 6,433,138,646 |
| 有価証券 | 5,207,234,138 |
| 預金 | 988,504,540 |
| 未収利息 | 94,718,980 |
| 有価証券売却未収入金 | 5,925,515 |
| 為替予約取引評価勘定 | 136,755,473 |
| 負債合計 | 273,145,676 |
| 借入金 | 160,972,898 |
| 未払配当金 | 101,379,164 |
| 未払運用報酬 | 7,766,755 |
| 未払管理費用 | 2,870,322 |
| 未払税 | 156,537 |
| 純資産 | 6,159,992,970 |

■有価証券明細 (2022年12月31日現在)

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|---|--------------------|--|----------------------|
| 債券 | 524,125,030 | | |
| オーストラリア | 13,006,939 | | |
| 25,000 FMG RESO AUG 2006 PTY 6.125 22-32 15/04S | 3,080,732 | 75,000 JACOBS ENTERTAI 6.7500 22-29 15/02S | 9,028,943 |
| 25,000 FMG RESOURCES A 5.8750 22-30 15/04S | 3,112,830 | 50,000 KAISER ALUMINUM 4.6250 19-28 01/03S | 5,815,200 |
| 25,000 MINERAL RESOURCES 8.0 22-27 01/11S | 3,374,096 | 25,000 KB HOME 7.25 22-30 15/07S | 3,206,036 |
| 25,000 MINERAL RESOURCES 8.5 22-30 01/05S | 3,396,396 | 50,000 KINETIK HOLDING 5.8750 22-30 15/06S | 6,187,489 |
| 50,000 VIRGIN AUSTRALIA 19-24 15/11S - DEFAULT | 42,885 | 25,000 LEVEL 3 FINANCING INC 3.625 20-29 15/01S | 2,416,569 |
| バミューダ | 5,617,037 | 25,000 LINDBLAD EXPEDITIO LLC 6.75 22-27 15/02S | 2,995,266 |
| 25,000 NABORS INDUSTRI 7.2500 20-26 15/01S | 3,128,141 | 25,000 MATCH GP 5.625 19-29 15/02S | 3,048,908 |
| 25,000 NCL 7.75 22-29 15/02S | 2,488,896 | 50,000 MATCH GROUP HLD 3.6250 21-31 01/10S | 5,086,398 |
| カナダ | 19,733,827 | 50,000 MATTEL INC 3.375 21-26 19/03S | 6,109,329 |
| 50,000 BAUSCH HEALTH C 6.1250 22-27 01/02S | 4,551,450 | 25,000 MATTEL INC 3.75 21-29 01/04S | 2,902,031 |
| 50,000 BAUSCH HEALTH 5.2500 19-30 30/01S | 3,207,380 | 100,000 MINERVA MERGER 6.5000 22-30 15/02S | 9,790,903 |
| 50,000 VERMILION ENERGY 6.875 22-30 01/05S | 6,061,164 | 25,000 MIVD HOLDCO II 5.5 22-30 01/02S | 2,660,404 |
| 25,000 VIDEOTRON 3.625 21-29 15/06S | 2,793,681 | 25,000 MOLINA HEALTHCARE INC 4.35 20-28 15/06S | 3,011,797 |
| 25,000 VIDEOTRON LTEE 5.125 17-27 15/04S04S | 3,120,152 | 25,000 NATL FI 7.5 22-30 01/10S | 3,108,207 |
| アメリカ | 413,035,547 | 50,000 NEWS 5.125 22-32 15/02S | 6,007,419 |
| 25,000 ADVANCED DRAIN 6.3750 22-30 15/06S | 3,205,990 | 50,000 NORTONLIFELOCK INC 6.75 -27 30/09S | 6,484,946 |
| 25,000 ALBERTSONS COMPANIES 4.875 20-30 15/02S | 2,946,903 | 50,000 NORTONLIFELOCK INC 7.125 -30 30/09 | 6,506,764 |
| 25,000 ALLEGIANT TRAVEL 7.25 22-27 15/08S | 3,143,919 | 50,000 OSCAR ACQUISITI 9.5000 22-30 15/04S | 5,918,791 |
| 200,000 ALLIED UNIVERSAL 6.0 21-29 01/06S | 19,383,734 | 25,000 OWENS & MINOR I 6.6250 22-30 01/04S | 2,839,216 |
| 50,000 ARAMARK SERVICES INC 6.375 20-25 01/05S | 6,543,876 | 50,000 OWENS BROCKWAY 144A 5.375 14-25 15/01S | 6,366,387 |
| 50,000 AVIENT CORP 7.125 22-30 01/08S | 6,496,683 | 25,000 OXFORD FINANCE LLC/OX 6.375 22-27 01/02S | 3,034,350 |
| 50,000 BELLRING BRANDS 7.0000 22-30 15/03S | 6,409,635 | 25,000 PEDIATRIX MEDICAL 5.3750 22-30 15/02U | 2,836,180 |
| 50,000 BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375 22-32 15/06S | 6,216,196 | 25,000 REALOGY GROUP/C 5.2500 22-30 15/04S | 2,410,217 |
| 25,000 CAESARS ENTERTAINMENT 6.25 20-25 01/07S | 3,212,050 | 100,000 ROCKETMTGE CO-I 4.0000 21-33 15/10S | 9,883,609 |
| 100,000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.75 19-30 01/03S | 11,409,284 | 25,000 RYAN SPECIALTY 4.3750 22-30 01/02S | 2,886,736 |
| 300,000 CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S | 32,218,638 | 25,000 SCI GAMES 6.625 22-30 01/03S | 2,789,820 |
| 50,000 CCO HOLDINGS 5 17-28 01/02S 17-28 01/02S | 6,005,362 | 75,000 SEALED AIR 5.0 22-29 15/04S | 9,306,470 |
| 75,000 CCO HOLLDLCCCO HOLD C 6.375 22-29 01/09S | 9,303,334 | 100,000 SENSATA TECHNOLOGIES 20-31 20-31 15/02S | 10,933,398 |
| 75,000 CDI ESCROW ISSU 5.7500 22-30 01/04S | 8,938,448 | 50,000 SIRIUS XM RADIO 5.00 17-27 01/08S | 6,122,879 |
| 25,000 CHARLES RIVER L 4.0 21-31 15/03S | 2,859,039 | 50,000 TENET HEALTHCARE 6.125 22-30 15/06S | 6,287,034 |
| 100,000 CHS/COMMUNITY H 5.2500 22-30 15/05S | 9,992,250 | 50,000 UNIVISION COMMUNICAT 7.375 22-30 30/06S | 6,319,785 |
| 50,000 CIENA CORP 4.0 22-30 31/01S | 5,832,155 | ケイマン諸島 | 15,649,722 |
| 75,000 COGENT COMMUNIC 7.0000 22-27 15/06S | 9,638,363 | 88,800 SEAGATE HDD CAYMAN 9.625 22-32 01/12S | 12,863,611 |
| 25,000 COINBASE GLOBAL 3.6250 21-31 01/10S | 1,607,023 | 25,000 TRANSOCEAN INC 7.50 17-26 15/01S | 2,786,111 |
| 25,000 CONSENSUS CLOUD 6.5000 21-28 15/10S | 3,035,239 | リベリア | 16,118,167 |
| 400,000 CSC HOLDINGS LLC 5.0 21-31 15/11S | 29,576,514 | 25,000 ROYAL CARIB CRUISES 4.25 21-26 01/07S | 2,676,332 |
| 100,000 DIAMOND SPORTS 5.375 22-26 15/08S | 1,634,171 | 125,000 ROYAL CARIB CRUISES 5.375 22-27 15/07S | 13,441,835 |
| 51,000 DIEBOLD NIXDORF INC 9.375 22-25 15/07S | 4,812,384 | マルタ | 11,278,227 |
| 25,000 ENERGIZER 6.5 22-27 31/12S | 3,155,999 | 50,000 VISTAJET MAL FIN 7.875 22-27 01/05S | 5,977,645 |
| 50,000 ENLINK MIDSTREAM 6.5 22-30 01/09S | 6,541,530 | 50,000 VISTAJET MALT 6.375 22-30 01/02S | 5,300,582 |
| 25,000 EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-27 01/06S06S | 3,235,778 | パナマ | 8,107,986 |
| 25,000 EQM MIDSTREAM PARTNER 7.5 22-30 01/06S | 3,182,843 | 75,000 CARNIVAL CORPORATION 10.5 22-30 01/06S | 8,107,986 |
| 50,000 FERTITTA ENTERT 6.7500 22-30 15/01S | 5,333,826 | イギリス | 21,577,578 |
| 50,000 FERTITTA ENTERTMT FIN 4.625 22-29 15/01S | 5,594,607 | 200,000 VMED O2 UK FINA 4.7500 21-31 15/07S | 21,577,578 |
| 75,000 GAP INC 3.875 21-31 01/10S | 6,993,676 | 債券 | 4,664,657,460 |
| 25,000 HESS MIDSTREAM 5.5000 22-30 15/10S | 3,038,889 | オーストラリア | 17,367,563 |
| 50,000 HILCORP ENERGY 6.0000 22-30 15/04S | 5,911,657 | 125,000 FMG RES AUG 2006 PTY 4.375 21-31 01/04SS | 13,995,750 |
| 25,000 HILTON DOMESTIC 5.375 20-25 01/05S | 3,277,472 | 25,000 MINERAL RESOURCES LTD 8.125 19-27 01/05S | 3,371,813 |
| 75,000 HLF FIN SARL LLCHERB 4.875 21-29 01/06S | 6,787,592 | | |
| 25,000 HOLLY ENERGY PARTNER 6.375 22-27 15/04SS | 3,259,007 | | |

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|--|------------|---|------------|
| バミューダ | | 48,180,685 | |
| 25,000 NABORS INDUSTRIES INC 7.50 20-28 15/01S | 3,032.421 | 100,000 AG ISSUER LLC 6.25 20-28 01/03S | 12,174.303 |
| 150,000 NCL CORP LTD 5.875 20-26 15/03S | 15,612.043 | 25,000 AHP HEALTH PARTNERS 5.75 21-29 15/07S | 2,585.863 |
| 25,000 NCL CORPORATION 3.6250 19-24 15/12S | 2,839.447 | 100,000 ALBERTSONS COMPANIES 4.625 19-27 15/01S | 12,296.296 |
| 50,000 NCL FINANCE LTD6.125 21-28 15/03S | 4,915.126 | 50,000 ALLEGHENY TECHN 4.8750 21-29 01/10S | 5,838.044 |
| 25,000 VIKING OCEAN CR 5.6250 21-29 15/02S | 2,661.897 | 25,000 ALLEGHENY TECHN 5.1250 21-31 01/10S | 2,909.851 |
| 50,000 VOC ESCROW LTD 5.00 18-28 15/02S | 5,677.455 | 50,000 ALLEGHENY TECHNO 5.875 19-27 01/12S | 6,336.046 |
| 5,000 WEATHERFORD 11.00 19-24 01/12S | 678.661 | 25,000 ALLEN MEDIA LLC 10.5 20-28 15/02S | 1,257.489 |
| 100,000 WEATHERFORD INT 8.6250 21-30 30/04S | 12,763.635 | 25,000 ALLIED UNIVERSAL 6.625 19-26 15/07S | 3,032.855 |
| カナダ | | 125,000 ALLIED UNIVERSAL 9.75 19-27 15/07S | 14,509.970 |
| 50,000 BAFFINLAND IRON MINES 8.75 18-26 15/07A | 6,267.613 | 25,000 ALTA EQUIPMENT GROUP 5.625 21-26 15/04S | 2,997.191 |
| 25,000 BAUSCH HEALTH CO 7.25 19-29 30/05S | 1,595.575 | 75,000 AMC NETWORKS INC 4.25 21-29 15/02S | 6,183.736 |
| 50,000 BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.25 20-31 15/02S | 3,207.824 | 100,000 AMERICAN AIRLINES 11.7500 20-25 15/07 | 14,207.415 |
| 25,000 BAUSCH HEALTH 7.0000 19-28 15/01S | 1,611.943 | 50,000 AMERIGAS PART/FIN 5.50 16-25 20/05S | 6,347.668 |
| 174,000 BAUSCH HEALTH 9.00 17-25 15/12S | 18,164.977 | 150,000 AMN HEALTHCARE 4,0000 20-29 15/04S | 17,153.927 |
| 61,000 BOMBARDIER 7.50 17-24 01/12S | 8,072.012 | 25,000 AMN HEALTHCARE 4.625 19-27 01/10S | 3,044.080 |
| 225,000 BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S | 28,935.090 | 25,000 ANTERO MIDSTREAM 5.375 21-29 15/06S | 3,019.532 |
| 50,000 BOMBARDIER INC 6.0 21-28 15/02S | 6,133.707 | 50,000 ANTERO MIDSTREAM 5.750 19-27 01/03S | 6,241.533 |
| 50,000 BROOKFIELD RESIDEN 5.00 21-29 15/06S | 5,274.246 | 50,000 ANTERO MIDSTREAM 7.875 20-26 15/05S | 6,704.355 |
| 50,000 EMPIRE COMMUNIT 7.0000 20-25 15/12S | 6,009.741 | 25,000 APACHE CORP 4.25 13-44 15/01S | 2,339.040 |
| 25,000 ENSIGN DRILLING INC 9.25 19-24 15/04S | 3,146.136 | 100,000 APACHE CORP 5.10 10-40 01/09S | 10,968.774 |
| 125,000 GARDA WORLD SECURITY 6.0 21-29 01/06S | 13,503.618 | 75,000 APACHE CORP 5.35 19-49 01/07S | 8,054.983 |
| 25,000 HUSKY III HOLDING 13.0 20-25 15/02S | 2,932.203 | 25,000 API ESCROW CORP 4.75 21-29 15/10S | 2,907.061 |
| 25,000 INTELLIGENT PACKAGING 6.00 20-28 15/09S | 2,675.495 | 50,000 API GROUP DE INC 4.125 21-29 15/07S | 5,589.059 |
| 50,000 MATTAMY GROUP 4.625 20-30 01/03S | 5,412.450 | 25,000 APX GROUP INC 5.7500 21-29 15/07S | 2,746.547 |
| 25,000 METHANEX CORP 5.125 20-27 15/10S7 15/10S | 3,071.583 | 50,000 ARAMARK SERVICES INC 5.00 18-28 01/02S | 6,170.393 |
| 25,000 NOVA CHEMICALS 4.2500 21-29 15/05S | 2,705.602 | 50,000 ARCHES BUYER 4.250 20-28 01/06S | 5,190.082 |
| 33,000 NOVA CHEMICALS CORP 5.25 17-27 01/06S6S | 3,920.479 | 25,000 ARCHROCK PARTNE 6.2500 19-28 01/04S | 3,038.884 |
| 75,000 OPEN TEXT CORP 3.875 21-29 01/12S | 7,976.257 | 50,000 ARCHROCK PARTNE 6.8750 19-27 01/04S | 6,334.285 |
| 50,000 PARKLAND CORP/C 4.6250 21-30 01/05S | 5,507.888 | 25,000 ARCONIC CORPORATION 6.125 20-28 15/02S | 3,109.331 |
| 150,000 PARKLAND CORPORATION 4.5 -21-29 01/10S | 16,626.899 | 50,000 ARCONIC CORPORATION 6.20-25 13/05S | 6,536.545 |
| 50,000 PRECISION DRILL 6.8750 21-29 15/01S | 6,198.376 | 25,000 ARKO CORP 5.125 21-29 15/11S | 2,591.016 |
| 25,000 PRECISION DRILLING 7.125 17-26 15/01S | 3,221.453 | 25,000 ASBURY AUTOMOTI 4.6250 21-29 15/11S | 2,787.710 |
| 50,000 SUPERIOR PLUS LP SUP 4.5 21-29 15/03S | 5,674.120 | 25,000 ASBURY AUTOMOTI 5.0000 21-32 15/02S | 2,727.022 |
| 25,000 TASEKO MINES LT 7.0000 21-26 15/02S | 2,913.727 | 25,000 ASBURY AUTOMOTIVE 4.75 20-30 01/03S | 2,774.789 |
| 25,000 TEINE ENERGY LT 6.8750 21-29 15/04S | 2,984.577 | 50,000 ASCENT RESOURCE 8.25 20-28 31/12S | 6,493.408 |
| 50,000 TELESAT CANADA 5.625 21-26 08/12S | 3,101.671 | 64,000 ASCENT RESOURCES UTI 9.0 20-27 01/11S | 10,360.911 |
| 25,000 TELESAT CANADA 6.50 19-27 15/10S | 986.343 | 75,000 ASGN INCORPORAT 4.6250 19-28 15/05S | 8,988.473 |
| 50,000 TITAN ACQUISITION LTD 7.75 18/26 15/04S | 5,964.178 | 50,000 ASHTON WOODS US 4.6250 21-30 01/04S | 5,349.970 |
| 200,000 1011778 BC UNLIMITED 4.0000 20-30 15/10S | 21,476.988 | 50,000 ASHTON WOODS USA LLC 6.625 20-28 15/01S | 5,806.882 |
| 25,000 1011778 BC UNLIMITED 4.3750 19-28 15/01S | 2,974.267 | 75,000 ASP AMC MERGER SUB 8.00 17-25 15/05S | 584.379 |
| デンマーク | | 25,000 ASSURED PARTNERS 5.6250 20-29 15/01S | 2,740.795 |
| 25,000 COMMSCOPE FINANCE LLC 6 19-28 01/03S | 3,054.943 | 50,000 AUDACY CAPITAL 6.75 21-29 31/03S | 1,212.333 |
| アメリカ | | 50,000 AUSTIN BIDCO INC 7.125 20-28 15/12S | 5,122.201 |
| 50,000 ABERCROMBIE 8.75 20-25 15/07S | 6,536.188 | 125,000 AVANTOR FUNDING 3.8750 21-29 01/11S | 13,877.835 |
| 25,000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.00 20-29 15/04S | 3,056.506 | 75,000 AVANTOR FUNDING INC 4.6250 20-28 15/07S | 8,994.525 |
| 25,000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.50 20-28 01/07S | 3,134.661 | 50,000 AVIS BUDGET CAR RENT 4.75 21-28 23/03S | 5,603.990 |
| 75,000 ACRISURE LLC 0.125 19-26 01/08S | 9,705.337 | 25,000 AVIS BUDGET CAR 5.375 21-29 01/03S | 2,838.098 |
| 75,000 ACRISURE LLC 4.25 21-29 15/02S | 8,237.092 | 25,000 AVIS BUDGET CAR 5.750 19-27 15/07S | 3,000.048 |
| 25,000 ACRISURE LLC 7.0 17-25 15/11S | 3,043.252 | 100,000 BALL CORP 6.875 22-28 15/03S | 13,574.238 |
| 50,000 ADAMS HOMES 7.50 20-25 15/02S | 5,632.536 | 50,000 BASIC ENERGY SERVICES 0.00 18-23 15/10S | 169.055 |
| 50,000 ADT SEC CORP 4.1250 21-29 01/08S | 5,661.279 | 125,000 BATH&BODY WORKS INC 6.75 16-36 01/07S | 14,496.611 |
| 40,000 ADTALEM ESCROW CORP 5.50 21-28 01/03S | 4,848.677 | 50,000 BCPE EMPIRE HOLDINGS 7.625 21-27 01/05S | 5,936.959 |
| 25,000 AETHON UN/AETHIN UN F 8.25 21-26 15/02S | 3,280.175 | 50,000 BCPE ULYSSES INTERMED 7.75 21-27 01/04S | 4,109.352 |
| 50,000 AFFINITY GAMING 6.8750 20-27 15/12S | 5,617.554 | 50,000 BEACON ROOFING 4.125 21-29 15/05S | 5,516.631 |
| | | 50,000 BEAZER HOMES USA INC 6.7500 17-25 15/03 | 6,422.242 |
| | | 50,000 BEAZER HOMES USA INC 7.25 19-29 15/10S | 5,913.708 |
| | | 40,000 BIG RIVER STEEL 6.6250 20-29 31/01S | 5,075.772 |

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|--|------------|--|------------|
| 75.000 BLACKSTONE MORTGAGE 3.750 21-27 15/01S | 8,464.896 | 25.000 CITGO PETROLEUM 6.3750 21-26 15/06S | 3,173.912 |
| 50.000 BLUE RACER MIDSTREAM 7.625 20-25 15/12S | 6,572.017 | 50.000 CITGO PETROLEUM 7.0 20-25 15/06S | 6,458.181 |
| 50.000 BONANZA CREEK E 5.0000 21-26 15/10S | 6,093.411 | 100.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 5.125 19-27 15/08S | 11,460.771 |
| 50.000 BOYD GAMING COR 4.75 21-31 15/06S | 5,753.112 | 75.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.500 21-29 01/06S | 7,210.426 |
| 75.000 BOYNE USA INC 4.7500 21-29 15/05S | 8,882.208 | 50.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.750 21-28 15/04S | 4,854.444 |
| 50.000 BRIGHTSTAR ESCROW COR 9.75 20-25 15/10S | 6,108.373 | 25.000 CLEARWAY ENERGY 3.7500 21-32 15/01S | 2,669.103 |
| 50.000 BRISTOW GROUP I 6.8750 21-28 01/03S | 6,121.206 | 25.000 CLEARWAY ENERGY 4.7500 19-28 15/03S | 3,060.653 |
| 15.000 BTH & BDY WRKS 9.375 20-25 01/07S | 2,128.220 | 75.000 CLEVELAND CLIFFS 5.875 20-27 01/06S | 9,487.176 |
| 100.000 BTH & BDY WRKS 6.6250 20-30 01/10S | 12,385.111 | 50.000 CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875 21-31 01/03S | 5,849.582 |
| 125.000 BUILDERS FIRSTS 4.2500 21-32 01/02S | 13,442.731 | 50.000 COEUR MINING IN 5.1250 21-29 15/02S | 5,200.323 |
| 25.000 BUILDERS FIRSTS 5.0000 20-30 01/03S | 2,943.250 | 25.000 COHERENT CORP 5.0000 21-29 15/12S | 2,866.013 |
| 25.000 BWAY HOLDING CO 5.5 17-24 15/04S | 3,215.901 | 50.000 COLT MERGER SUB INC 8.1250 20-27 01/07S | 6,496.234 |
| 175.000 CAESARS ENTERTAINMENT 4.625 21-29 15/10S | 18,825.148 | 25.000 COMMERCIAL META 4.1250 22-30 15/01S | 2,918.833 |
| 25.000 CAESARS ENTERTAINMENT 5.75 20-25 01/07SS | 3,245.211 | 25.000 COMMERCIAL METALS CO 4.375 22-32 15/03S | 2,867.810 |
| 25.000 CALPINE CORP 4.625 20-29 01/02S | 2,845.872 | 25.000 COMMSCOPE FINANCE 8.25 19-27 19/02S | 2,586.740 |
| 25.000 CALPINE CORP 5.00 20-31 01/02S | 2,782.514 | 50.000 COMMSCOPE INC 7.125 20-28 01/07S | 4,759.835 |
| 75.000 CALPINE CORP 5.125 19-28 15/03S | 8,881.186 | 25.000 COMMSCOPE INC 4.7500 21-29 01/09S | 2,670.021 |
| 50.000 CARGO AIRCRAFT MANAG 4.750 20-28 01/02S | 6,000.846 | 25.000 COMMSCOPE TECH 144A 6.00 15-25 15/06S | 3,006.563 |
| 50.000 CARPENTER TECHNOLOGY 6.375 20-28 15/07SS | 6,296.675 | 25.000 COMPASS GROUP D 5.0000 21-32 15/01S | 2,650.343 |
| 25.000 CARRIAGE SERVIC 4.2500 21-29 15/05S | 2,645.185 | 50.000 COMPASS GROUP D 5.2500 21-29 15/04S | 5,677.287 |
| 50.000 CARROLS RESTAURANT GR 5.875 21-29 01/07S | 4,650.569 | 25.000 COMPASS MINERALS 6.75 19-27 01/12S | 3,189.915 |
| 75.000 CASTLE US HOLDING CORP 9.5 20-28 15/02S | 3,913.301 | 25.000 CONSOLIDATED COMM INC 6.5 20-28 01/10S | 2,573.506 |
| 125.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.25 20-31 01/02S | 13,280.965 | 25.000 COOPER-STANDARD 13.0000 20-24 01/06 | 3,456.303 |
| 425.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S | 44,707.323 | 25.000 CORNERSTONE BUI 6.1250 20-29 15/01S | 2,329.076 |
| 200.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.50 21-33 01/06S | 20,350.075 | 25.000 COVANTA HOLDING 5.00 20-30 01/09S | 2,685.448 |
| 100.000 CCO HOLDINGS LLC / CCO 4.25 21-34 15/01S | 9,765.991 | 100.000 CRESTWOOD MIDSTREAM 6.00 21-29 01/02S | 12,178.610 |
| 50.000 CDR FR/CND WNRD 6.5 21-28 01/10S | 6,421.992 | 25.000 CROCS INC 4.125 21-31 15/08S | 2,693.181 |
| 25.000 CDW LLC CDW FINANCE 3.25 20-29 15/02S | 2,816.073 | 25.000 CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S | 3,209.000 |
| 25.000 CDW LLC CDW FINANCE 4.1250 20-25 01/05S | 3,217.700 | 26.000 CROWNROCK LP 5.625 17-25 15/10S25 15/10S | 3,321.543 |
| 25.000 CEC ENTERTAINMENT 6.75 21-26 01/05S | 3,070.328 | 50.000 CS GROUP 5.00 20-28 15/12S | 5,035.835 |
| 25.000 CEDAR FAIR LP CANADA 5.25 20-29 15/07S | 2,980.141 | 200.000 CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S | 18,429.529 |
| 50.000 CENTENE CORP 2.4500 21-28 15/07S | 5,571.311 | 26.000 CSTN MERGER SUB INC 6.75 17-24 15/08S | 2,769.204 |
| 175.000 CENTENE CORP 3.0000 20-30 15/10S | 18,948.691 | 200.000 DAVITA INC 4.6250 20-30 01/06S | 21,302.729 |
| 100.000 CENTENE CORP 3.375 20-30 15/02S | 11,185.122 | 50.000 DCP MIDSTREAM 5.125 19-29 15/05S | 6,375.864 |
| 100.000 CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S | 12,405.095 | 50.000 DCP MIDSTREAM 5.6250 20-27 15/07S | 6,571.474 |
| 75.000 CENTENE CORP 4.625 20-29 15/12S | 9,083.073 | 25.000 DEALER TIRE LLC/DT 8.0 20-28 01/02S | 2,847.019 |
| 50.000 CENTENE CORP 2.625 21-31 12/08S | 5,188.818 | 50.000 DELEK 6.75 18-25 15/06S | 6,414.554 |
| 50.000 CENTERFIELD MEDIA PAR 6.625 21-26 01/08S | 4,264.981 | 50.000 DELEK LOGISTICS PARTN 7.125 21-28 01/06S | 5,958.655 |
| 25.000 CENTRAL GARDEN & PET 4.125 20-30 15/10S | 2,729.975 | 25.000 DELTA AIR LINES INC 3.375 20-26 12/06S | 3,399.146 |
| 50.000 CENTRAL GARDEN & PET 4.125 21-31 30/04S | 5,469.517 | 50.000 DIAMOND SPORTS GR/DIA 6.625 19-27 15/08S | 102.507 |
| 25.000 CENTURY COMMUNI 6.7500 20-27 01/06S | 3,155.795 | 175.000 DIRECTV FINANCING LLC 5.875 21-27 15/08S | 20,738.054 |
| 25.000 CENTURY COMMUNITIES I 3.875 21-29 15/08S | 2,594.859 | 25.000 DISH DBS CORPORATION 5.75 21-28 01/12S | 2,637.952 |
| 100.000 CHENIERE ENERGY 3.2500 22-32 30/01S | 10,559.507 | 50.000 DISH DBS CORPORATION 5.875 15-24 15/11S | 6,167.919 |
| 25.000 CHENIERE ENERGY INC 4.625 21-28 15/04S | 2,998.912 | 50.000 DISH DBS CORPORATION 7.375 20-28 01/07S | 4,685.481 |
| 200.000 CHENIERE ENERGY PARTNER 4.0 21-31 01/03S | 22,677.753 | 75.000 DISH DBS CORPORATION 5.125 21-29 01/06S | 6,404.475 |
| 25.000 CHORD ENERGY CORP 6.375 21-26 01/06S | 3,207.505 | 100.000 DISH DBS CORPORATION 5.25 21-26 01/12S2S | 11,140.991 |
| 125.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 4.75 21-31 15/02S | 12,062.957 | 75.000 DIVERSIFIED HEALTH 4.375 21-31 01/03S | 6,314.452 |
| 75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 5.625 20-27 15/03S | 8,513.687 | 42.000 DOMTAR CORP 6.75 21-28 01/10S1-28 01/10S | 4,848.206 |
| 25.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.00 20-29 15/01S | 2,767.512 | 100.000 DORNOCH DEBT ME 6.6250 21-29 15/10S | 9,388.912 |
| 75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.125 21-30 01/04S | 5,007.262 | 75.000 EDGEWELL PERSONAL CAR 4.125 21-29 01/04S | 8,535.903 |
| 45.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.875 19-28 01/04S | 2,929.150 | 75.000 ENACT HOLDINGS INC 6.5000 20-25 15/08S | 9,753.516 |
| 75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.875 21-29 15/04S | 5,143.777 | 75.000 ENCOMPASS HEALTH 4.75 19-30 01/02S | 8,743.673 |
| 79.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 8.00 19-27 15/12S | 9,456.633 | 25.000 ENDURANCE ACQ M 6.0000 21-29 15/02S | 2,163.087 |
| 50.000 CHURCHILL DOWNS INC 5.50 19-27 01/04S | 6,293.081 | 50.000 ENLINK MIDSTREAM 4.85 16-26 15/07S5/07S | 6,245.286 |
| 100.000 CINEMARK USA 5.25 21-28 15/07S | 9,815.852 | 75.000 ENLINK MIDSTREAM 5.45 17-47 01/06S1/06S | 7,957.327 |
| 50.000 CINEMARK USA INC 5.875 21-26 16/03S | 5,500.008 | 25.000 ENLINK MIDSTREAM 5.6 14-44 01/10S01/04S | 2,713.494 |
| 250.000 CITGO HOLDING I 9.2500 19-24 01/08S | 33,147.335 | 50.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.05 14-45 01/04S | 5,004.817 |

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|--|------------|--|------------|
| 50.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.375 19-29 01/06S | 6,140,250 | 25.000 HAT HOLDINGS I LLC 3.75 20-30 15/09S | 2,445,681 |
| 25.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.625 20-28 15/01S | 3,153,854 | 25.000 HCA INC 5.875 15-26 15/02S | 3,321,207 |
| 50.000 ENTENNAL RESOURCE 6.375 17-26 15/01S | 6,040,730 | 75.000 HCA INC 5.375 18-26 01/09S | 9,805,024 |
| 100.000 ENTERPRISE MERGER 8.75 18-26 15/10S | 3,736,931 | 25.000 HEALTHEQUITY INC 4.5 21-29 01/10S | 2,941,967 |
| 50.000 EQM MIDSTREAM 4.50 21-29 15/01S | 5,586,873 | 100.000 HERTZ CORP 5.0 21-29 01/12S | 10,026,500 |
| 25.000 EQM MIDSTREAM PART 4.75 21-31 15/01S1S | 2,720,735 | 125.000 HESS MIDSTREAM PART 5.125 19-28 15/06S | 15,382,837 |
| 25.000 EQM MIDSTREAM PART 5.50 18-28 15/07S | 2,949,963 | 50.000 HESS MIDSTREAM PART 5.625 19-26 15/02S | 6,427,645 |
| 175.000 EQM MIDSTREAM PART 6.50 18-48 15/07S | 17,446,063 | 75.000 HILCORP ENERGY 6.0000 21-31 01/02S | 8,409,711 |
| 50.000 EVERI HOLDINGS 5.0000 21-29 15/07S | 5,726,559 | 50.000 HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S | 5,285,813 |
| 74.000 EXEL INEXL FIN 11.50 21-26 15/07S | 1,549,926 | 175.000 HILTON DOMESTIC 4.0 20-31 01/05S | 19,474,422 |
| 25.000 FAIR ISAAC CORP 4.0000 19-28 15/06S | 2,995,430 | 75.000 HILTON DOMESTIC 5.75 20-28 01/05S | 9,650,316 |
| 100.000 FERRELLGAS 5.375 21-26 01/04S | 12,036,871 | 25.000 HILTON DOMESTIC 4.875 19-30 15/01S | 2,995,662 |
| 75.000 FERRELLGAS 5.875 21-29 01/04S | 8,125,816 | 75.000 HILTON GRAND VACATION 4.875 21-31 01/07S | 8,115,736 |
| 25.000 FIRST STUDENT BIDCO 4.21-29 31/07S | 2,763,217 | 75.000 HILTON GRAND VACATIONS BO 5 21-29 01/06S | 8,598,514 |
| 25.000 FIRSTCASH HOLDINGS 4.625 20-28 01/09S09S | 2,913,225 | 50.000 HOLLY NRG PRNTNR 5.0000 20-28 01/02S | 6,053,288 |
| 25.000 FIRSTCASH INC 5.6250 21-30 01/01S | 2,953,987 | 75.000 HOWARD HUGUES CORP 4.125 21-29 01/02S | 8,286,590 |
| 25.000 FORD MOTOR CO 3.25 21-32 12/02S32 12/02S | 2,484,658 | 25.000 HOWARD HUGUES CORP 4.375 21-31 01/02S | 2,659,065 |
| 200.000 FORD MOTOR CO 4.75 13-43 15/01S3 15/01S | 19,131,369 | 25.000 HOWARD HUGUES CORP 5.375 20-28 01/08S | 2,973,107 |
| 75.000 FORD MOTOR CO 5.291 16-46 08/12S 08/12S | 7,634,742 | 25.000 HOWARD MIDSTREAM ENE 6.75 21-27 15/01S | 3,191,419 |
| 25.000 FORD MOTOR COMPANY 6.10 22-32 19/08S | 3,059,549 | 19.000 HOWMET AEROSPACE INC 5.90 07-27 01/02S | 2,503,632 |
| 200.000 FORD MOTOR CREDIT CO 2.9 21-28 16/02S | 21,848,643 | 50.000 HOWMET AEROSPACE INC 5.95 07-37 01/02S | 6,413,075 |
| 200.000 FORD MOTOR CREDIT CO 4.000 20-30 13/11S | 21,725,360 | 25.000 HOWNET AEROSPACE INC 5.125 14-24 01/10S | 3,288,119 |
| 200.000 FORD MOTOR CREDIT CO 4.134 15-25 04/08 | 24,747,858 | 25.000 HUB INTERNATION 5.6250 21-29 01/12S | 2,898,610 |
| 200.000 FORD MOTOR CREDIT CO 5.1130 19-29 03/05S | 23,957,422 | 65.000 HUGHES SAT SYS CORP 6.625 17-26 01/08S | 8,035,259 |
| 50.000 FORESTAR GROUP INC 3.85 21-26 15/05S | 5,871,121 | 50.000 ICAHN ENTER 4.375 21-29 01/02S | 5,616,280 |
| 50.000 FORESTAR GROUP INC 5.00 20-28 01/03S | 5,696,823 | 125.000 ICAHN ENTERPRISES LP 4.75 19-24 15/09S | 15,957,793 |
| 50.000 FORTRESS TRANSPORT 5.50 21-28 01/05S | 5,630,702 | 150.000 ICAHN ENTERPRISES LP 5.25 19-27 15/05S | 18,178,693 |
| 7.000 FORTRESS TRANSPORT 6.50 18-25 01/10S | 871,256 | 125.000 ICAHN ENTERPRISES LP 6.25 19-26 15/05S | 15,985,986 |
| 50.000 FORTRESS TRANSPORT 9.75 20-27 01/08S | 6,630,749 | 25.000 IHEARTCOMMUNI 6.375 19-26 01/05S | 3,038,700 |
| 50.000 FOUNDATION BUIL 6.0000 21-29 01/03S | 4,999,300 | 50.000 IHEARTCOMMUNICATIONS 05.00 19-27 15/08S | 5,593,302 |
| 21.000 FOXTROT ESCROW ISSUER 12.25 19-26 15/11S | 2,295,611 | 25.000 IHEARTCOMMUNICATIONS 4.750 19-28 15/01S | 2,691,303 |
| 75.000 FREEDOM MORTGAGE CO 6.625 21-27 15/01S | 7,744,009 | 25.000 ILLUMINATE BUYER LLC 9.0 20-28 01/07S | 2,795,130 |
| 75.000 FREEDOM MRTG 7.6250 20-26 01/05S | 8,377,440 | 250.000 IMOLA MERGER CO 4.7500 21-29 15/05S | 28,625,210 |
| 100.000 FREEPORT MCMORAN 4.375 20-28 01/08S | 12,391,839 | 50.000 INGLES MARKETS 4.0000 21-31 15/06S | 5,552,769 |
| 50.000 FRONTIER COMMUN 6.0000 21-30 15/01S | 5,209,669 | 25.000 INNOPHOS HOLDINGS INC 9.375 20-28 15/02S | 3,267,454 |
| 50.000 FRONTIER COMMUNICATION 5.00 20-28 01/05S | 5,769,085 | 50.000 INSTALLED BUILDING 5.75 19-28 01/02S | 5,987,758 |
| 25.000 FRONTIER COMMUNICATION 6.75 20-29 01/05S | 2,731,148 | 75.000 IRON MOUNTAIN INC 4.5000 20-31 15/02S | 8,164,191 |
| 25.000 FULL HOUSE RESORTS INC 8.25 21-28 15/02S | 2,923,781 | 75.000 IRON MOUNTAIN INC 5.2500 20-30 15/07S | 8,601,170 |
| 25.000 FXI HOLDINGS INC 7.875 17-24 01/11S | 2,740,516 | 25.000 IRON MOUNTAIN INC 5.625 20-32 15/07S | 2,879,586 |
| 25.000 GAP INC 3.625 21-29 01/10S | 2,350,271 | 100.000 IRON MOUNTAIN INFORMATI 5.0 21-32 15/07S | 11,065,543 |
| 25.000 GCI LLC 4.75 20-28 15/10S | 2,819,905 | 25.000 ITAN INTL 7.0 21-28 30/04S | 3,150,144 |
| 25.000 GENESIS ENERGY 6.50 17-25 01/10S | 3,152,411 | 75.000 ITT HOLDINGS LLC 6.5 21-29 01/08S | 8,358,725 |
| 25.000 GLATFELTER CORP 4.75 21-29 15/11S 15/11S | 2,018,842 | 50.000 JANE STREET GRP 4.5000 21-29 15/11S | 5,769,496 |
| 75.000 GO DADDY OPCO/GD FIN CO 3.5 21-29 01/03S | 8,361,457 | 75.000 JEFFERSON CAPITAL HOLDING 6 21-26 15/08S | 8,218,568 |
| 100.000 GOLDEN ENTERTAI 7.6250 19-26 15/04S | 13,021,640 | 45.000 JELD-WEN INC 4.625 17-25 15/12S | 5,008,710 |
| 25.000 GOODYEAR T & RUBBER 5.25 21-31 30/04S | 2,770,837 | 50.000 KAR AUCTION SERVICES 5.125 17-25 01/06S | 6,470,385 |
| 50.000 GOODYEAR TIRE AND RUBB 5.00 22-29 15/07S | 5,513,886 | 50.000 KB HOME 4.000 21-31 15/06S | 5,334,666 |
| 75.000 GOODYEAR TIRE RUBBER 5.25 22-31 15/07S | 8,116,926 | 50.000 KB HOME 6.875 19-27 15/06S | 6,644,071 |
| 75.000 GOODYEAR TIRE 9.5 20-25 31/05S25 31/05S | 10,259,411 | 25.000 KEN GARFF AUTOM 4.8750 20-28 15/09S | 2,771,981 |
| 100.000 GPS HOSPITALITY HOLDING 7 21-28 15/08S | 8,474,013 | 25.000 KENNEDY WILSON INC 4.75 21-30 01/02S | 2,524,768 |
| 100.000 GRAY ESCROW II 5.3750 21-31 15/11S | 9,568,134 | 25.000 KONTOOR BRANDS 4.1250 21-29 15/11S | 2,687,593 |
| 100.000 GRAY TELEVISION INC 4.75 20-30 15/10S | 9,563,042 | 25.000 KRONOS ACQUISITION 5.0 20-26 31/12S | 2,885,029 |
| 25.000 GREYSTAR REAL ESTAT 5.75 17-25 01/12S | 3,228,111 | 25.000 KRONOS ACQUISITION7.0 20-27 31/12S | 2,718,594 |
| 100.000 GRIFFON 5.75 20-28 01/03S | 12,076,495 | 25.000 LABL INC 5.8750 21-28 01/11S | 2,825,810 |
| 49.000 GULFPORT ENERGY 8 21-26 17/05S | 6,414,590 | 50.000 LABL INC 8.2500 21-29 01/11S | 5,277,078 |
| 75.000 HARVEST MIDSTREAM 7.5 20-28 01/09S | 9,518,121 | 25.000 LADDER CAP FIN 4.7500 21-29 15/06S | 2,668,062 |
| 75.000 HAT HOLDINGS LLC 3.375 21-26 15/06S | 8,602,493 | 25.000 LADDER CAP FIN 4.25 20-27 01/02S | 2,779,803 |

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|--|------------|--|------------|
| 25.000 LAMAR MEDIA CORPORAT 4.00 20-30 15/02S | 2,883.992 | 50.000 MSCI INC 4.0000 19-29 15/11S | 5,780.745 |
| 25.000 LAMB WESTON HOLDINGS 4.125 21-30 31/01S | 2,920.734 | 100.000 NABORS INDUSTRIES INC 5.75 18-25 01/02S | 12,656.809 |
| 25.000 LAMB WESTON HOLDINGS 4.375 21-30 31/01S | 2,883.759 | 17.000 NATHAN'S FAMOUS IN 6.625 17-25 01/11S | 2,168.978 |
| 50.000 LBM ACQUISITION 6.2500 20-29 15/01S | 4,287.295 | 25.000 NATIONSTAR MORTGAGE HO 5.75 21-31 15/11S | 2,571.991 |
| 100.000 LCM INVESTM HLD S II 4.875 21-29 01/05S | 10,670.128 | 25.000 NATIONSTAR MTG 5.125 20-30 15/12S | 2,557.022 |
| 25.000 LEEWARD RENEWAB 4.2500 21-29 01/07S | 2,861.379 | 75.000 NATIONSTAR MTG 5.5 20-28 15/08S | 8,139.917 |
| 75.000 LEVEL 3 FINANCING INC 3.75 21-29 15/07S | 7,135.301 | 25.000 NATIONSTAR MTG 6.0000 20-27 15/01S | 2,966.793 |
| 100.000 LEVEL 3 FINANCING INC 4.25 20-28 01/07S | 10,403.519 | 150.000 NAVIENT CORP 5.5 21-29 15/03S | 16,249.109 |
| 25.000 LFS TOPCO LLC 5.8750 21-26 15/10S | 2,668.553 | 25.000 NAVIENT CORP 5.00 20-27 15/03S | 2,887.997 |
| 100.000 LIFE TIME INC 5.7500 21-26 15/01S | 12,308.715 | 25.000 NAVIENT CORP 5.50 13-23 25/01S | 3,298.667 |
| 225.000 LIFE TIME INC 8.00 21-26 15/04S | 26,755.678 | 300.000 NAVIENT CORP 6.75 17-25 25/06S | 38,164.993 |
| 25.000 LIFEPOINT HEALTH INC 5.375 20-29 15/01S | 1,885.115 | 125.000 NCR CORP 5.125 21-29 15/04S | 13,811.981 |
| 75.000 LITHIA MOTORS INC 3.875 21-29 01/06S | 8,175.803 | 75.000 NCR CORP 5.75 19-27 01/09S | 9,505.865 |
| 75.000 LITHIA MOTORS INC 4.625 19-27 15/12S | 9,029.628 | 100.000 NCR CORP 6.125 19-29 01/09 | 12,349.478 |
| 75.000 LIVE NATION ENTERT 5.625 18-26 15/03U | 9,411.440 | 50.000 NESCO HOLDINGS II INC 5.5 21-29 15/04S | 5,839.798 |
| 25.000 LIVE NATION INC 3.75 21-28 15/01S | 2,830.450 | 25.000 NETFLIX INC 4.875 17-28 15/04S | 3,209.321 |
| 100.000 LOGAN MERGER SUB INC 5.5 20-27 01/09S | 7,135.070 | 50.000 NEW ENTERPRISE 5.2500 21-28 15/07S | 5,966.975 |
| 25.000 LSB INDUSTRIES 6.2500 21-28 15/10S | 3,009.758 | 50.000 NEW ENTERPRISE 9.7500 20-28 15/07S | 6,133.015 |
| 75.000 LSF9 ATL HLDG/V 7.7500 21-26 15/02S | 8,822.368 | 25.000 NEW FORTRESS EN 6.5000 21-26 30/09S | 3,074.800 |
| 100.000 LUCENT TECHNOLOGIES 6.45 99-29 15/03S | 12,763.741 | 25.000 NEWELL BRANDS I 6.6250 22-29 15/09S | 3,263.548 |
| 50.000 LUMEN TECHNOLOGIES 4.5 20-29 15/01S | 4,574.405 | 125.000 NEWELL BRANDS INC 4.70 16-26 01/04S | 15,637.604 |
| 75.000 LUMEN TECHNOLOGIES 7.995 06-36 01/06S06S | 4,613.346 | 50.000 NEWELL BRANDS INC 5.375 16-36 01/04S | 5,711.905 |
| 75.000 MACYS RET HLDG INC 5.125 12-42 15/01SS | 6,480.306 | 50.000 NEWELL BRANDS INC 5.5 16-46 01/04S01/04S | 5,234.911 |
| 25.000 MACYS RET HLDG INC 6.375 07-37 15/03SS | 2,647.888 | 25.000 NEWELL BRANDS INC 6.375 22-27 15/09S/09S | 3,278.927 |
| 25.000 MACYS RET HLDG INC 4.50 14-34 15/12S | 2,268.101 | 31.000 NEWMARK GROUP INC 6.125 18-23 15/11S | 4,066.789 |
| 75.000 MACYS RETAIL HLDG 5.875 21-29 01/04S | 8,815.771 | 100.000 NEWS CORP 3.875 21-29 15/05S | 11,456.058 |
| 25.000 MADISON IAQ LLC 5.875 21-29 30/06S | 2,274.759 | 3.000 NEXETERA ENERGY 144A 4.25 17-24 15/09S | 368.689 |
| 25.000 MAGIC MERGERCO INC 5.250 21-28 01/05S | 2,675.023 | 100.000 NEXSTAR BROADCA 4.7500 20-28 01/11S | 11,456.576 |
| 75.000 MAJORDRIVE HOLDING IV 6.375 21-29 01/06S | 7,434.607 | 50.000 NEXTERA ENERGY OPER 3.875 19-26 15/10S0S | 6,070.773 |
| 25.000 MATCH GROUP INC 5.00 17-27 15/12S | 3,068.126 | 75.000 NFP CORP 6.875 20-28 15/08S | 8,211.735 |
| 25.000 MATTEL INC 5.45 11-41 01/11S | 2,694.983 | 25.000 NFP CORP 4.8750 21-28 15/08S | 2,816.909 |
| 25.000 MATTHEWS INTERNATIONAL 5.25 17-25 01/12S | 3,127.777 | 100.000 NGL ENERGY 7.50 21-26 01/02S | 11,763.173 |
| 50.000 MAV ACQUISITION CORP 8 21-29 01/08S | 5,466.349 | 75.000 NMI HOLDINGS 7.3750 20-25 01/06S | 10,049.135 |
| 75.000 MERCER INTERNATIONAL 5.125 21-29 01/02S | 8,278.022 | 25.000 NORDSTROM INC 4.3750 19-30 01/04S | 2,483.541 |
| 70.000 MERITAGE HOME CORP 6 15-25 01/06S/06S | 9,215.613 | 25.000 NORTHWEST FIBER 4.7500 21-27 30/04S | 2,906.581 |
| 75.000 METIS MERGER SUB LLC 6.5 21-29 15/05S | 8,415.403 | 100.000 NOVELIS CORP 4.7500 20-30 30/01S | 11,675.278 |
| 125.000 MGIC INVESTMENT CORP 5.25 20-28 15/08S8S | 15,248.196 | 25.000 NRG ENERGY INC 3.375 20-29 15/02S | 2,668.337 |
| 25.000 MGM RESORTS INT 4.7500 20-28 15/10S | 2,883.103 | 25.000 NRG ENERGY INC 3.625 20-31 15/02S | 2,530.961 |
| 55.000 MGM RESORTS INTL 5.5 19-27 15/04S | 6,752.808 | 15.000 NRG ENERGY INC 6.625 17-27 15/01S | 1,971.765 |
| 25.000 MGM RESORTS INTL 5.75 18-25 18/06S | 3,213.937 | 50.000 NUSTAR LOGISTICS LP 6.00 19-26 01/06S | 6,384.844 |
| 75.000 MGM RESORTS INTL 6.00 14-23 15/03S | 9,905.578 | 50.000 OLIN CORP 5.625 19-29 01/08S | 6,288.292 |
| 50.000 MIDCONTINENT CO 5.3750 19-27 15/08S | 6,026.430 | 100.000 OPEN TEXT HOLDINGS IN 4.125 20-30 15/02S | 10,758.008 |
| 25.000 MIDWEST GAMING BORRO 4.875 21-29 01/05S | 2,822.496 | 75.000 OPEN TEXT/OPEN 4.1250 21-31 01/12S | 7,731.496 |
| 50.000 MINERALS TECHNOLOGIE 5.00 20-28 01/07S | 6,026.376 | 25.000 OUTFRONT MEDIA 4.2500 21-29 15/01S | 2,739.121 |
| 25.000 MODIVCARE 5.00 21-29 01/10S | 2,781.792 | 75.000 OUTFRONT MEDIA 4.6250 19-30 15/03S | 8,214.067 |
| 50.000 MOHEGAN TRIBAL GAM 8.00 21-26 01/02S | 6,141.207 | 100.000 OUTFRONT MEDIA 5.0000 19-27 15/08S | 11,941.436 |
| 13.000 MOHEGAN TRIBAL GAM 7.875 16-24 15/10S | 1,716.219 | 50.000 OWENS & MINOR I 4.5000 21-29 31/03S | 5,260.811 |
| 100.000 MOLINA HEALTHCA 3.8750 21-32 15/05S | 10,985.352 | 25.000 P L DEVELOPMENT LLC 7.75 20-25 15/11S | 2,674.864 |
| 50.000 MOLINA HEALTHCARE INC 0.875 20-30 15/11S | 5,609.275 | 25.000 PANTHER BF AGGREGATOR 8.5 19-27 15/05S | 3,232.359 |
| 51.000 MOSS CREEK RESOU HLD 7.5 18-26 15/01S | 6,070.744 | 131.000 PAR PHARMACEUTI 7.5000 19-27/01/04S | 13,198.056 |
| 125.000 MOZART DEBT MERGE 3.875 21-29 01/04S | 13,321.675 | 50.000 PARK INTERMED HOLD 4.875 21-29 15/05S | 5,591.877 |
| 125.000 MOZART DEBT MERGER 5.25 21-29 01/10S | 13,136.227 | 50.000 PARK INTERMEDIATE 7.5 20-25 01/06S06S | 6,611.720 |
| 25.000 MPH ACQUISITION 144A 5.75 29-28 01/11S | 2,196.759 | 50.000 PARK RIVER 5.625 21-29 01/02S | 4,504.952 |
| 50.000 MPT OPER PARTNE 3.5000 20-31 15/03S | 4,543.847 | 75.000 PARK-OHIO INDUSTRIES 6.625 17-27 15/04S | 6,475.411 |
| 50.000 MPT OPER PARTNER 5.00 17-27 15/10S | 5,561.548 | 75.000 PATRICK INDUSTRIES 4.750 21-29 01/05S | 8,312.220 |
| 25.000 MPT OPER PARTNERSHIP 4.625 19-29 01/08S | 2,559.544 | 50.000 PATRICK INDUSTRIES 7.500 19-27 15/10S | 6,439.639 |
| 75.000 MSCI INC 3.6250 21-31 01/11S | 8,261.072 | 75.000 PBF HOLDING CO LLC 6.0 20-28 15/02S | 8,805.208 |

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|---|------------|--|------------|
| 50.000 PBF HOLDING CO LLC 7.25 17-25 15/06S | 6,514.103 | 50.000 SINCLAIR TELEVISION 4.125 20-30 01/12S | 4,944.016 |
| 25.000 PECF USS INTERM 8.0000 21-29 15/11S | 2,143.746 | 50.000 SINCLAIR TELEVISION 5.125 16-27 15/02S | 5,408.022 |
| 75.000 PENN NATIONAL G 4.1250 21-29 01/07S | 7,904.584 | 50.000 SINCLAIR TELEVISION 5.5 19-30 27/11S | 4,626.307 |
| 50.000 PENN VIRGINIA ESCROW L 9.25 21-26 15/08S | 6,613.460 | 50.000 SIRIUS SATELLITE 3.125 21-26 16/08S | 5,867.003 |
| 75.000 PENNYMAC FINANCIAL 4.25 21-29 15/02S | 7,778.717 | 75.000 SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S | 8,603.585 |
| 25.000 PENNYMAC FINANCIAL SER 5.75 21-31 15/09S | 2,675.179 | 50.000 SIRIUS XM RADIO 5.50 19-29 01/07S | 6,039.611 |
| 25.000 PERFORMANCE FOOD 5.50 19-27 15/10S | 3,138.306 | 150.000 SIRIUS XM RADIO INC 3.875 21-31 01/09S | 15,652.273 |
| 50.000 PERFORMANCE FOOD GR 4.25 21-29 01/08S | 5,725.093 | 75.000 SIZZLING PLATTER LLC 8.5 20-25 28/11S | 9,150.144 |
| 50.000 PGT INC 4.375 21-29 01/10S | 5,533.971 | 50.000 SKYMILES IP LIMITED 4.50 20-25 20/10Q | 6,447.697 |
| 75.000 PLAYTIKA HOLDIN 4.2500 21-29 15/03S | 7,776.564 | 75.000 SLM CORP 3.125 21-26 02/11S | 8,475.850 |
| 25.000 PM GENERAL PURCHASER 9.5 20-28 01/10S | 2,511.662 | 50.000 SOLARIS MIDSTREAM HOL 7.625 21-26 01/04S | 6,575.882 |
| 25.000 POLAR US BOR LLC 6.75 21-26 15/05S | 1,269.511 | 25.000 SONIC AUTOMOTIV 4.6250 21-29 15/11S | 2,665.578 |
| 25.000 POST HOLDINGS INC 4.5 21-31 15/09S | 2,790.022 | 50.000 SONIC AUTOMOTIVE 4.875 21-31 15/11S | 5,199.344 |
| 50.000 POST HOLDINGS INC 5.50 19-29 15/12S | 5,982.413 | 75.000 SPECIALTY BUILDING 6.37520-2630/09S | 7,959.123 |
| 26.000 POST HOLDINGS INC 5.75 17-27 01/03S | 3,325.708 | 25.000 SPECTRUM BRANDS 3.875 21-31 15/03S | 2,581.314 |
| 50.000 PREM ENTMT SUB LLC PR 5.625 21-29 01/09S | 4,867.989 | 25.000 SPECTRUM BRANDS 5.5 20-30 15/07B | 2,945.069 |
| 50.000 PREM ENTMT SUB LLC PR 5.875 21-31 01/09S | 4,666.439 | 25.000 SPIRIT AEROSYSTEMS 4.6 18-28 15/06S | 2,674.177 |
| 100.000 PRESIDIO HOLDINGS INC 8.25 20-28 01/02S | 12,240.085 | 50.000 SPRINGLEAF FINANCE 8.25 13-23 01/10S | 6,642.055 |
| 50.000 PRESTIGE BRANDS 3.7500 21-31 01/04S | 5,463.128 | 25.000 SPRINGLEAF FINANCE 5.3750 19-29 15/11S | 2,705.533 |
| 75.000 PRIME HEALTHCARE SERV 7.25 20-25 01/11S | 8,393.344 | 50.000 SPRINGLEAF FINANCE 6.625 19-28 15/01S | 6,090.233 |
| 25.000 PRIME SECURITY SERV 5.25 19-24 15/04S4S | 3,252.432 | 50.000 SPRINGLEAF FINANCE 7.1250 18-26 15/03S | 6,277.605 |
| 25.000 PRIME SECURITY SERVIC 3.375 20-27 31/08S | 2,878.151 | 150.000 SPRINT CAPITAL CORP 6.875 98-28 15/11S | 20,600.712 |
| 25.000 PRIME SECURITY SERVIC 6.25 20-28 15/01S | 3,014.649 | 100.000 SPRINT CAPITAL CORP 8.75 02-32 15/03S | 15,710.501 |
| 50.000 PRIMO WATER HOLD INC 21-29 30/04S | 5,722.077 | 50.000 SPRINT CORP 7.875 14-23 15/09S | 6,700.799 |
| 50.000 PROVIDENT FDG ASSO LP 6.375 17-25 15/06S | 5,862.089 | 25.000 SPRINT CORPORATION 7.125 14-24 15/06S | 3,367.772 |
| 25.000 QVC INC 4.7500 20-27 15/02S | 2,339.645 | 25.000 SPRINT CORPORATION 7.625 18-26 01/03S | 3,477.630 |
| 125.000 RADIAN GROUP INC 4.875 19-27 15/03S | 15,150.501 | 100.000 SRM ESCROW ISSUER 6.00 20-28 01/11S | 11,818.665 |
| 25.000 RAPTOR ACQUISITION CO 4.875 21-26 01/11S | 2,962.724 | 50.000 SRS DISTRIBUTION INC 4.625 21-28 01/07S | 5,907.293 |
| 25.000 RESIDEO FUNDING | 2,671.247 | 50.000 SSC TECHNOLOGIE 5.5 19-27 28/03S | 6,224.019 |
| 50.000 RHP HOTEL PROPERTIES 4.5 21-29 15/02S | 5,730.207 | 50.000 STANDARD INDUSTRIES 4.3750 20-30 15/07S | 5,408.707 |
| 50.000 RLJ LODGING TRUST 4.00 21-29 15/09S | 5,394.610 | 100.000 STAPLES INC 7.5 19-26 15/04S | 11,383.666 |
| 100.000 RLJ LODGING TRUST 3.75 21-26 17/06S | 11,795.954 | 100.000 STAPLES INC 10.75 19-27 15/04S | 9,530.781 |
| 50.000 ROCKCLIFF ENERG 5.5000 21-29 15/10S | 6,046.150 | 25.000 STARWOOD PROPER 3.7500 21-24 31/12S | 3,127.564 |
| 25.000 ROCKET MORTGAGE LLC 2.875 21-26 15/10S0S | 2,846.131 | 25.000 STATION CASINOS 4.6250 21-31 01/12S | 2,660.786 |
| 50.000 ROCKIES EXP PIPELINE 6.875 10-40 15/04S | 5,562.042 | 50.000 STL HOLDING CO LLC 7.5 20-26 15/02S | 5,768.264 |
| 25.000 ROLLER BEARING COMP 4.375 21-29 15/10S | 2,869.859 | 50.000 SUBURBAN PROPANE PARTN 5.0 21-31 01/06S | 5,659.734 |
| 50.000 RP ESCROW ISSUER LLC 5.25 20-25 15/12S | 5,053.090 | 50.000 SUMMIT MATERIALS LLC 5.2500 20-29 15/01S | 6,153.927 |
| 50.000 SCIENCE APPLICA 4.8750 20-28 01/04S | 6,135.142 | 25.000 SUMMIT MATERIALS LLC 6.50 19-27 15/03S | 3,255.298 |
| 75.000 SCIENTIFIC GAMES 7.000 19-28 15/05S | 9,474.143 | 38.000 SUMMIT MID HILDS LL 5.75 17-25 15/04S | 4,241.608 |
| 50.000 SCIENTIFIC GAMES 7.2500 19-29 15/11S | 6,338.332 | 50.000 SUNOCO LP 6 15-27/04S | 6,526.834 |
| 50.000 SCIH SALT 6.625 21-29 01/06S | 5,341.651 | 75.000 SUNOCO LP/SUNOCO FIN 4.50 22-30 30/04S | 8,604.282 |
| 75.000 SCIH SALT HOLDI 4.8750 21-28 01/05S | 8,535.304 | 50.000 SWF ESCROW ISSUER 6.5 21-29 01/10S | 3,837.018 |
| 25.000 SCRIPPS ESCROW II INC 5.375 20-31 15/01S | 2,658.203 | 50.000 SYNAPTICS INC 4 21-29 15/06S21-29 15/06S | 5,565.914 |
| 25.000 SCRIPPS ESCROW INC 19-27 15/07S | 2,969.673 | 25.000 TALEN ENERGY SUPPLY 6.625 19-28 DEFAULT | 3,374.554 |
| 100.000 SEAWORLD PARKS 5.2500 21-29 15/08S | 11,523.444 | 50.000 TALLGRASS ENERGY 6.00 20-30 31/12S | 5,750.374 |
| 100.000 SEG HLD LLC/SEG 5.6250 20-28 15/10S | 12,370.675 | 50.000 TALLGRASS ENERGY 7.5 20-25 01/10S | 6,659.777 |
| 75.000 SELECT MEDICAL CORP 6.25 19-26 15/08S S | 9,444.010 | 25.000 TALLGRASS ENERGY PARTN 6.0 21-31 01/09S | 2,846.857 |
| 25.000 SERVICE CORPORATION 3.375 20-30 15/08U | 2,715.628 | 25.000 TALOS PRODUCTION LLC 12 21-26 15/01S | 3,483.430 |
| 75.000 SERVICE CORPORATION 4 21-31 15/05S | 8,429.808 | 25.000 TAP ROCK RESOURCES 7.00 21-26 01/10S | 3,073.480 |
| 100.000 SERVICE PROPERTIES 4.3500 19-24 01/10S | 12,045.829 | 75.000 TEGNA INC 4.625 20-28 15/03S | 9,406.168 |
| 50.000 SERVICE PROPERTIES 5.25 16-26 15/02S | 5,527.473 | 25.000 TEGNA INC 5 20-29 15/09S | 3,127.965 |
| 25.000 SERVICE PROPERTIES 7.50 20-25 15/09S | 3,159.030 | 50.000 TEMPUR SEALY INTL INC 4.0 21-29 15/04S | 5,548.932 |
| 50.000 SERVICE PROPERTIES 4.95 17-27 15/02S/02S | 5,206.981 | 50.000 TENET HEALTHCAR 4.3750 21-30 15/01S | 5,722.350 |
| 25.000 SERVICE PROPERTIES 4.95 19-29 01/10S/10S | 2,313.384 | 50.000 TENET HEALTHCARE CORP 4.25 21-29 01/06S | 5,717.198 |
| 25.000 SHEA HOMES 4.7500 20-28 15/02U | 2,886.297 | 25.000 TENET HEALTHCARE CORP 4.625 20-28 15/06S | 2,963.334 |
| 50.000 SHEA HOMES 4.7500 20-29 01/04U | 5,593.224 | 225.000 TENET HEALTHCARE CORP 6.125 20-28 01/10S | 26,672.007 |
| 75.000 SIMMONS FOODS INC 4.625 21-29 01/03S | 8,159.889 | 100.000 TENET HEALTHCARE 4.875 19-26 01/01S | 12,588.256 |

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

| 数量 | 評価額 円 | 数量 | 評価額 円 |
|--|------------|---|-------------------|
| 25.000 TENET HEALTHCARE 6.25 19-27 01/02S | 3,174.744 | 25.000 VERSCEND 9.75 18-26 27/08S | 3,238.029 |
| 50.000 TEREX CORP 5.0000 21-29 15/05S | 5,934.658 | 50.000 VICI PROPERTIES 3.75 20-27 15/02S | 6,002.127 |
| 75.000 TERRAFORM POWER 4.7500 19-30 15/01S | 8,659.830 | 150.000 VICI PROPERTIES LP 4.25 19-26 01/12S/12S | 18,489.170 |
| 25.000 THE ADT CORPORATION 4.875 16-32 15/07S | 2,819.476 | 50.000 VICTORIA'S SECR 4.6250 21-29 15/07S | 5,184.939 |
| 25.000 THE CHEMOURS CO 5.375 17-27 15/05S | 3,051.364 | 100.000 VIKING CRUISES LTD 5.875 17-27 15/09S | 10,786.279 |
| 50.000 THE SCOTTS MIRACLE-GRO 4.00 22-31 01/04S | 5,082.533 | 75.000 VIKING CRUISES LTD 6.25 15-25 15/05S | 8,980.893 |
| 25.000 THOR INDUSTRIES 4.0000 21-29 15/10S | 2,607.318 | 25.000 VISTRA OPERATIONS CO 4.375 21-29 01/05S | 2,855.568 |
| 50.000 TKC HOLDINGS INC 10.5 21-29 15/05S | 3,754.662 | 125.000 VISTRA OPERATIONS CO 5 19-27 31/07S | 15,360.722 |
| 100.000 T-MOBILE USA INC 3.375 21-29 15/04S | 11,644.854 | 50.000 WASH MULTIFAMILY ACQ 5.75 21-26 15/04S | 6,225.844 |
| 50.000 T-MOBILE USA INC 2.625 21-26 23/03S | 6,047.904 | 75.000 WEEKLEY HOMES LLC 4.875 20-28 15/09S | 8,383.270 |
| 25.000 TMS INTERNATIONAL CORP 6.25 21-29 15/04S | 2,383.085 | 75.000 WERNER FINCO LP/IN 8.75 17-25 15/07S | 6,694.730 |
| 25.000 TOLL BROS FINANCE 4.875 17-27 15/03S | 3,137.552 | 25.000 WESTERN GAS PARTNERS 4.50 18-28 01/03S | 3,037.736 |
| 25.000 TOPBUILD CORP 4.1250 21-32 15/02S | 2,681.869 | 25.000 WESTERN GAS PARTNERS 4.7500 18-28 15/08S | 3,035.952 |
| 25.000 TRAVEL + LEISURE CO 6.625 20-26 31/07S | 3,236.309 | 100.000 WESTERN GAS PARTNERS 5.30 18-48 01/03S | 10,943.619 |
| 50.000 TRAVEL + LEISURE CO 4.6250 19-30 01/03S | 5,502.096 | 50.000 WESTERN GAS PARTNERS 5.45 14-44 01/04S | 5,539.122 |
| 25.000 TRI POINTE HOMES 5.25 17-27 01/06S | 2,946.107 | 25.000 WESTERN GAS PARTNERS 5.5 18-48 15/08S08S | 2,744.544 |
| 50.000 TRIDENT TPI -144A 9.25 19-24 01/08S | 6,296.003 | 50.000 WESTERN GLOBAL 10.3750 20-25 15/08 | 4,999.656 |
| 75.000 TRIMAS CORP 4.125 21-29 15/04S | 8,702.953 | 50.000 WHEEL PROS ESCROW ISS 6.500 21-29 15/05S | 2,489.102 |
| 75.000 TRINSEO OP 5.125 21-29 01/04S | 6,433.860 | 50.000 WHITE CAP BUYER 6.875 20-28 15/10S | 5,768.142 |
| 89.000 TRINSEO OP 5.375 17-25 01/09S | 9,717.897 | 75.000 WILLIAMS SCOTSMAN 4.6250 20-28 15/08S | 9,023.410 |
| 50.000 TRITON WATER HOLDINGS 6.25 21-29 01/04S | 5,351.761 | 75.000 WINNEBAGO INDUS 6.2500 20-28 15/07S | 9,315.484 |
| 25.000 TRIUMPH GROUP I 6.2500 19-24 15/09S | 3,130.005 | 50.000 WORLD ACCEPTANCE CORP 7.00 21-26 01/11S | 3,858.217 |
| 19.000 TRIUMPH GROUP I 8.8750 20-24 01/06S | 2,555.848 | 25.000 W.R. GRACE HOLDINGS 4.875 21-27 15/06S | 2,925.962 |
| 75.000 TRONOX INC 4.625 21-29 15/03S | 8,232.150 | 25.000 WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625 21-29 15/08S | 2,671.129 |
| 75.000 TTM TECHNOLOGIES INC 4 21-29 10/03S | 8,511.434 | 75.000 WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S | 9,451.048 |
| 50.000 TWILIO INC 3.875 21-31 15/03S | 5,243.496 | 75.000 WYNN RESORTS FINANCE 5.125 19-29 01/10S | 8,503.133 |
| 25.000 UBER TECHNOLOGIES 6.25 20-28 15/01S | 3,183.945 | 50.000 XEROX HOLDINGS CORP 5.00 20-25 15/08S | 6,083.856 |
| 50.000 UBER TECHNOLOGIES 7.5 19-27 15/09S | 6,611.085 | 25.000 XEROX HOLDINGS CORP 5.50 20-28 15/08S | 2,668.065 |
| 75.000 UBER TECHNOLOGIES 7.5000 20-25 15/05S | 9,921.044 | 25.000 XHR LP 4.875 21-29 01/06S | 2,727.071 |
| 75.000 UBER TECHNOLOGIES 8.0 18-26 01/11S | 9,987.617 | 25.000 XHR LP 6.375 20-25 15/08S | 3,224.311 |
| 25.000 UBER TECHNOLOGIES 4.5 21-29 15/08S | 2,879.796 | 75.000 YUM BRANDS 5.375 22-32 01/04S | 9,179.636 |
| 25.000 UNITED AIR LINES INC 4.375 21-26 21/04S | 3,075.315 | 22.000 ZIFF DAVIS INC 4.625 20-30 15/10S | 2,461.353 |
| 19.760 UNITED AIRLINES 2020 5.875 20-27 28/10Q | 2,571.691 | | |
| 50.000 UNITED AIRLINES 4.6250 21-29 15/04S | 5,769.169 | フランス | 43,968,448 |
| 25.000 UNITED NATURAL FOODS 6.75 20-28 15/10S | 3,176.556 | 200.000 ALTICE FRANCE SA 5.125 21-29 15/07S | 19,815.886 |
| 100.000 UNITED RENTALS 4.0000 20-30 15/07S | 11,315.553 | 200.000 ALTICE FRANCE SA 8.1250 18-27 01/02S | 24,152.562 |
| 25.000 UNITED RENTALS INC 3.875 20-31 15/02S | 2,778.510 | | |
| 25.000 UNITED RENTALS NORTH 4.875 17-28 15/01 | 3,128.737 | ケイマン諸島 | 74,935,743 |
| 50.000 UNITED RENTALS NORTH 5.25 19-30 15/01S | 6,201.733 | 50.000 AMERICAN AIRLINES 5.5 21-26 24/03Q | 6,352.733 |
| 75.000 UNITED SHORE FIN SERV 5.5 21-29 15/04S | 7,919.833 | 50.000 AMERICAN AIRLINES 5.75 21-29 20/04Q | 6,041.409 |
| 10.000 UNITED STATES STEEL 6.875 21-29 01/03S | 1,286.566 | 131.343 GLOBAL AIRCRAFT 6.50 19-24 15/09S | 14,802.536 |
| 25.000 UNITED WHOLESAL 5.7500 21-27 15/06S | 2,857.199 | 50.000 HAWAIIAN BRAND 5.75 21-26 20/01Q 04/02Q | 5,973.608 |
| 50.000 UNITI GROUP/CSL 4.7500 21-28 15/04S | 5,282.890 | 25.000 SEAGATE HDD CAYMAN 4.091 21-29 01/06S | 2,738.281 |
| 25.000 UNITI GROUP/CSL 6.5000 21-29 15/02S | 2,189.145 | 64.000 SEAGATE HDD CAYMAN 4.125 20-31 15/01S | 6,623.453 |
| 50.000 UNITI GROUP/CSL 7.875 20-25 15/02S | 6,407.678 | 14.960 SPIRIT LOYALTY 8.0000 20-25 20/09Q | 1,983.769 |
| 75.000 UNIVAR SOLUTION 5.1250 19-27 01/12S | 9,407.841 | 67.849 TRANSOCEAN GUARDIAN 5.875 18-24 15/01S | 8,785.038 |
| 25.000 UNIVISION COMM 5.125 15-25 15/02S 15/02S | 3,149.374 | 41.000 TRANSOCEAN INC 11.5 20-27 30/01S | 5,451.943 |
| 100.000 UNIVISION COMMUNICATI 4.5 21-29 01/05S | 11,062.025 | 25.000 TRANSOCEAN INC 7.35 11-41 15/12S | 2,228.427 |
| 125.000 UNIVISION COMMUNICATI 6.625 20-27 01/06S | 15,955.311 | 25.000 TRANSOCEAN INC 7.50 01-31 15/04S | 2,228.173 |
| 125.000 US FOODS INC 4.75 21-29 15/02S | 14,661.585 | 100.000 TRANSOCEAN INC 7.25 18-25 01/11S | 11,726.373 |
| 25.000 USA COMPRESSION PART 6.875 18-26 01/04S | 3,172.516 | | |
| 50.000 USA COMPRESSION PART 6.875 19-27 17/12S | 6,201.308 | アイルランド | 2,356,404 |
| 100.000 VALEANT PHARMA 8.5 18-27 01/06S | 6,951.602 | 122.000 ENDO DESIGNATED ACTIVI 6.00 20-28 DEFAULT | 936.883 |
| 25.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-29 15/08S | 2,892.061 | 75.000 ENDO LTD / ENDO FINANCE 9.5 20-27 DEFAULT | 1,419.521 |
| 75.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-33 01/11S | 8,090.789 | | |
| 25.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 4.125 21-31 15/08S | 2,815.657 | イタリア | 3,132,512 |
| 26.000 VERICAST MERGER SUB 11.00 21-26 15/09S | 3,654.369 | 25.000 TELECOM ITALIA SPA 5.303 14-24 30/05S | 3,132.512 |

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

| 数量 | 評価額 円 |
|--|----------------------|
| リベリア | 26,946,441 |
| 24,000 ROYAL CARIB CRUISES 11.5 20-25 01/06S | 3,405,620 |
| 25,000 ROYAL CARIBBEAN CRUISES 5.5 21-26 31/08S | 2,780,089 |
| 75,000 ROYAL CARIBBEAN 3.7 17-28 15/03S | 7,350,976 |
| 100,000 ROYAL CARIBBEAN 5.5 21-28 01/04S | 10,552,354 |
| 25,000 ROYAL CARIBBEAN 7.5000 97-27 15/10S | 2,857,402 |
| ルクセンブルク | 42,394,271 |
| 200,000 ALTICE FRANCE HOLDIN 6 20-28 06/02S | 15,647,971 |
| 50,000 CAMELOT FINANCE SA 4.5 19-26 01/11S1/11S | 6,208,215 |
| 50,000 ENDO LUX FINANCE COM 7.125 21-29 DEFAUT | 5,022,156 |
| 100,000 TELECOM ITALIA CAP 6 05-34 30/09S 30/09S | 10,118,428 |
| 25,000 TELECOM ITALIA CAP 6.375 04-33 15/11S | 2,718,088 |
| 25,000 TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20 06-36 18/07S | 2,679,413 |
| パナマ | 127,005,980 |
| 650,000 CARNIVAL CORP 5.75 21-27 01/03S | 61,326,446 |
| 350,000 CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S | 36,950,106 |
| 200,000 CARNIVAL CORPORATION 6 21-29 01/05S | 17,731,768 |
| 50,000 CARNIVAL CORPORATION 10.50 20-26 01/02S | 6,638,911 |
| 50,000 CARNIVAL CORPORATION 6.65 98-28 15/01S | 4,358,749 |
| オランダ | 14,105,268 |
| 50,000 ELASTIC NV 4.1250 21-29 15/07S | 5,344,680 |
| 75,000 OI EUROPEAN GROUP BV 4.75 21-30 15/02S | 8,760,588 |
| イギリス | 46,917,123 |
| 200,000 JAGUAR LAND ROVER 5.875 20-28 15/01S | 20,437,113 |
| 50,000 PAYSAFE FIN PLC 4.0000 21-29 15/06S | 5,070,575 |
| 200,000 VMED O2 UK FINANCING 4.25 20-31 31/01S | 21,409,435 |
| 変動利付債 | 18,451,648 |
| カナダ | 2,325,723 |
| 25,000 INTELLIGENT PACKAGING FLR 20-26 15/01S | 2,325,723 |
| アメリカ | 16,125,925 |
| 188,155 AMC ENTERTAINMENT HO FLR 20-26 15/06S | 10,341,008 |
| 25,000 BANK OF AMERICA CORP FLR 18-XX 2803S | 2,925,157 |
| 25,000 WHITE CAPITAL PARENT FLR 21-26 15/03S | 2,859,760 |
| 合計 | 5,207,234,138 |

■外国為替取引 [N D F] (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 円 |
|---------|----------------|-----|---------------|----------|--------------|
| ブラジルリアル | 254,610,204.10 | 米ドル | 46,900,000.00 | 2023/2/2 | 136,755,473 |
| | | | | 合計 | 136,755,473 |

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 |
| 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 | | | 2年未満 | | |
| | | | | | 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 | | | | 2023/8/29 |
| | 第128回共同発行市場公募地方債 | 0.66 | 250,000 | 251,232 | | | | 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。