

■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／ブラジルレ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-ブラジルレアル（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、「C A 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（ブラジルレアルコース）	ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円） C A 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-ブラジルレアル（I4シェアクラス、円）	米ドル建のハイイールド債
	C A 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（ブラジルレアルコース）

運用報告書（全体版）
第 29 作 成 期

第167期	（決算日	2023年11月8日）
第168期	（決算日	2023年12月8日）
第169期	（決算日	2024年1月9日）
第170期	（決算日	2024年2月8日）
第171期	（決算日	2024年3月8日）
第172期	（決算日	2024年4月8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/>
<3525484・3550589>

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)	税 分 込 金			期 騰 落 中 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 金	期 騰 落 中 率				
第25作成期		円		円	%		%	%	百万円
	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
第28作成期	160期 (2023年4月10日)	1,393		10	0.3		0.4	96.9	6,672
	161期 (2023年5月8日)	1,453		10	5.0		0.4	97.1	6,895
	162期 (2023年6月8日)	1,514		10	4.9		0.4	98.4	6,680
	163期 (2023年7月10日)	1,557		10	3.5		0.4	98.5	6,951
	164期 (2023年8月8日)	1,562		10	1.0		0.4	98.5	6,813
	165期 (2023年9月8日)	1,590		10	2.4		0.4	98.3	6,853
第29作成期	166期 (2023年10月10日)	1,510		10	△ 4.4		0.4	97.6	6,451
	167期 (2023年11月8日)	1,653		10	10.1		0.4	97.9	7,001
	168期 (2023年12月8日)	1,616		10	△ 1.6		0.4	97.8	6,373
	169期 (2024年1月9日)	1,651		10	2.8		0.4	97.7	6,406
	170期 (2024年2月8日)	1,676		10	2.1		0.4	98.4	6,372
	171期 (2024年3月8日)	1,694		10	1.7		0.4	97.8	6,362
	172期 (2024年4月8日)	1,683		10	△ 0.1		0.4	98.0	6,263

(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

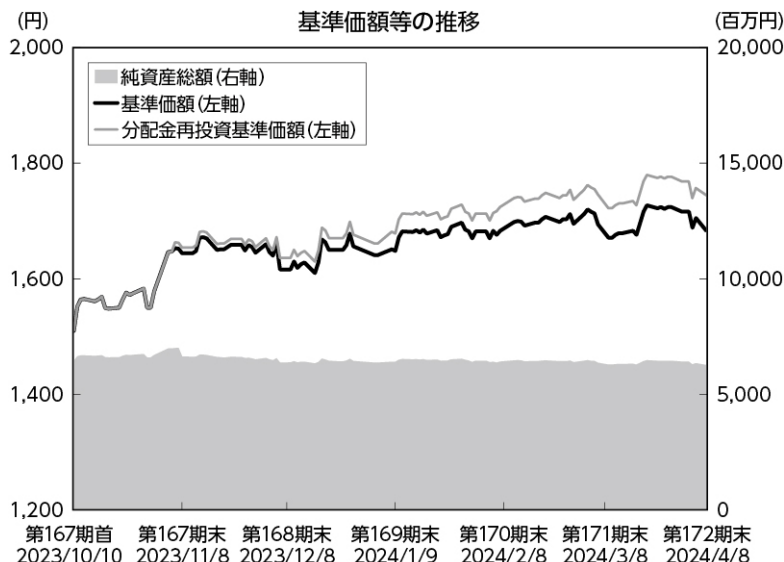
決算期	年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率		
第167期		円	%	%	%
	(期 首)2023年10月10日	1,510	—	0.4	97.6
	10月末	1,550	2.6	0.4	98.1
	(期 末)2023年11月8日	1,663	10.1	0.4	97.9
第168期	(期 首)2023年11月8日	1,653	—	0.4	97.9
	11月末	1,655	0.1	0.4	98.1
	(期 末)2023年12月8日	1,626	△1.6	0.4	97.8
	(期 首)2023年12月8日	1,616	—	0.4	97.8
第169期	12月末	1,656	2.5	0.4	98.3
	(期 末)2024年1月9日	1,661	2.8	0.4	97.7
	(期 首)2024年1月9日	1,651	—	0.4	97.7
	1月末	1,682	1.9	0.4	98.1
第170期	(期 末)2024年2月8日	1,686	2.1	0.4	98.4
	(期 首)2024年2月8日	1,676	—	0.4	98.4
	2月末	1,712	2.1	0.4	98.0
	(期 末)2024年3月8日	1,704	1.7	0.4	97.8
第171期	(期 首)2024年3月8日	1,694	—	0.4	97.8
	3月末	1,724	1.8	0.4	98.3
	(期 末)2024年4月8日	1,693	△0.1	0.4	98.0

(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・リソナ米国ハイ・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167期首	1,510円
第172期末	1,683円
既払分配金 （税込み）	60円
騰落率	15.5% （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、2023年10月10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

- ①2023年11月～12月と2024年3月に、米国ハイイールド債券市場が上昇したこと
- ②2023年11月前半と2024年1月～2月に、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10月、米国ハイイールド債券市場が下落したこと
- ②2023年12月前半、ブラジルリアル安・円高となったこと

【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上昇しました。2023年10月は、堅調な経済指標および予想をやや上回るインフレ率を背景に、市場が米国国債の供給増加およびFF（フェデラルファンド）金利の高金利長期化を捉えたことから、米国国債利回りが上昇（債券価格は下落）し、米国ハイイールド債券市場は下落しました。11月に、雇用統計およびCPI（消費者物価指数）が経済成長およびインフレの鈍化を示す指標となったことや、12月もパウエルFRB（米連邦準備理事会）議長が予想以上に金融政策の転換に前向きな姿勢を示したことなどから、年末にかけて米国ハイイールド債券市場は上昇しました。2024年2月および3月は、CPIお

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）

よびPPI（生産者物価指数）が予想を上回り、年内の利下げ回数の減少見通しが広まりました。投資家が緩やかなプラスの経済成長およびディスインフレーションの再燃を見込んだことや、2023年10-12月期の米国ハイイールド債の発行体の決算が底堅い状況だったことなどを受け、米国ハイイールド債券市場は上昇しました。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、CCC格債以下、BB格債、B格債の順となりました。過去12ヵ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29円付近で始まり、インフレーションが鈍化傾向となるなか米金利低下などが下支えとなり上昇した後、ルラ大統領の歳出拡張路線を受けた財政悪化懸念やブラジル中央銀行の利下げ継続見通し、日銀の金融政策修正観測を受けた円高の動きなどから、ブラジルリアルは下落基調となりました。その後、ブラジル中央銀行の利下げが重しとなるなか、日銀がマイナス金利政策を解除する一方で緩やかな金融環境を継続する見通しを示したことなどが支援材料となり、ブラジルリアル／円相場は緩やかな上昇傾向となり、30円付近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、マイナス圏での推移が続いていたTDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが、当作成期末に向けて0%近辺まで上昇しました。TDB 3ヵ月物利回りは、日銀によるマイナス金利政策や海外投資家からの需要に支えられ、-0.20%前後での推移が続いていましたが、2024年3月に実施された日銀によるマイナス金利解除を背景に、当作成期末に向けては0%近辺まで金利が上昇しました。

【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）」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）」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）＞

ポートフォリオにおいて、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CCC格債以下をオーバーウェイトの保有としました。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、素材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通信、資本財、エネルギーなどをアンダーウェイトとしました。2023年後半に、新型コロナウイルスからの経済再開の好影響を受けるセクターにて好機を捉え利益確定を行いました。業績改善により2023年に上昇した旅行・娯楽関連へのエクスポージャーについて、バリュエーションに留意しながら、年末にかけてウェイトを削減しました。

（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「ストラクチャル-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）

＜ストラクチャル-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、米国ハイイールド債は引き続き魅力的な利回りを提供し、当資産クラスのインカムゲインが2024年のトータル・リターンを下支えすると考えています。ＦＲＢによる利下げが米国債券市場への追い風となるとの市場の見方は後退しつつあります。ＦＦ金利先物市場はＦＯＭＣ（米連邦公開市場委員会）の予想を織り込んで推移しているとみており、2024年年初に予想されていた6回の利下げから、足元では2～3回の利下げを織り込んでいるとみています。発行企業の強固なバランスシートと堅調なインタレスト・カバレッジ（会社の借入金等の利息の支払い能力を測るための指標）にみられるように、米国ハイイールド債のファンダメンタルズ（基礎的条件）は引き続き堅調です。一方、米国ハイイールド債の新規発行額は、2024年1～3月期には活況を呈しましたが、今後は減速すると考えています。新規発行額の多くが既存債務のリファイナンス用途であり、2027年以前に満期償還を迎える発行体は抑えられています。新規発行によるネット流入額は限られたものであり、またグロススペースでの新規発行額が減速傾向にある点を踏まえると、米国ハイイールド債券市場はテクニカルに下支えされるものとみています。

（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167期～第172期 (2023年10月11日 ～2024年4月8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)	8円 (3) (5) (0)	0.479% (0.190) (0.272) (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	8	0.484	

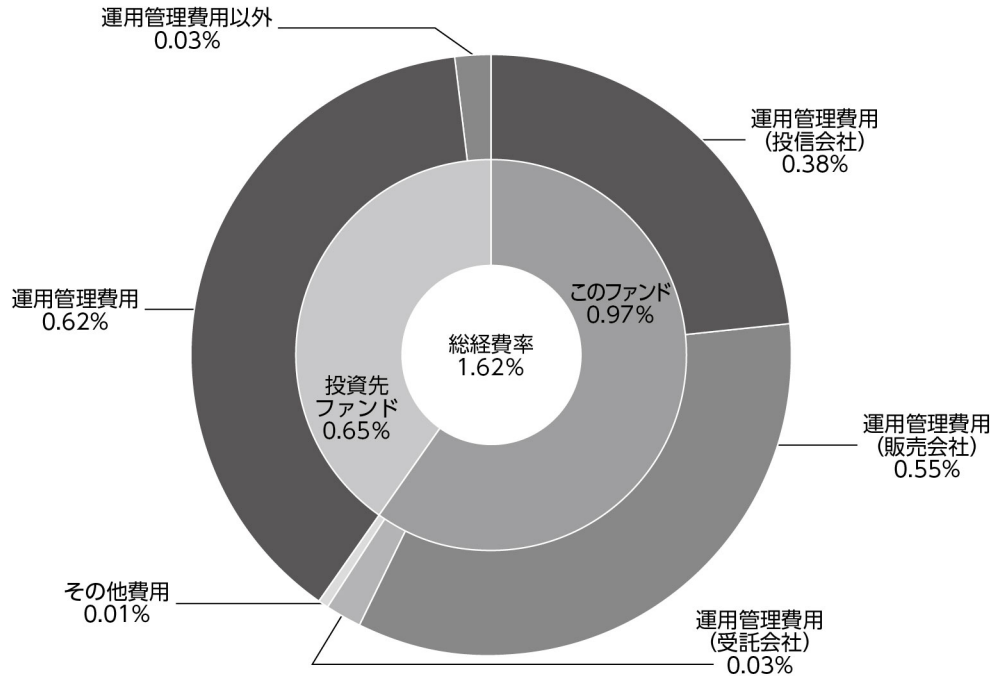
期中の平均基準価額は1,663円です。

- (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1.62%です。



総経費率（①+②+③）	1.62%
①このファンドの費用の比率	0.97%
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	0.03%

（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（2023年10月11日から2024年4月8日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 167 期 ～ 第 172 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)	—	—	343,000	620,796

(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（2023年10月11日から2024年4月8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（2024年4月8日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第28作成期末 (第166期末)	第29作成期末（第172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 24,670
合 計	口 数 ・ 金 額	24,626,158	24,626,158	24,670
	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28作成期末 (第166期末)	第29作成期末（第172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 3,793,000	口 3,450,000	千円 6,137,550
合 計	口 数 ・ 金 額	3,793,000	3,450,000	6,137,550
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<98.0%>

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（2024年4月8日現在）

項 目	第 29 作 成 期 末 (第 172 期 末)	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	24,670	0.4
投 資 証 券	6,137,550	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	155,892	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	6,318,112	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 167 期 末 (2023年11月8日)	第 168 期 末 (2023年12月8日)	第 169 期 末 (2024年1月9日)	第 170 期 末 (2024年2月8日)	第 171 期 末 (2024年3月8日)	第 172 期 末 (2024年4月8日)
(A) 資 産	7,064,277,181円	6,428,800,530円	6,456,971,517円	6,453,392,233円	6,411,420,043円	6,318,112,135円
コール・ローン等	181,847,921	173,875,120	172,078,645	160,676,823	166,397,096	155,891,625
投資信託受益証券(評価額)	24,685,260	24,675,410	24,677,872	24,675,410	24,672,947	24,670,485
投資証券(評価額)	6,857,744,000	6,230,250,000	6,260,215,000	6,268,040,000	6,220,350,000	6,137,550,000
未 収 利 息	—	—	—	—	—	25
(B) 負 債	62,472,858	55,585,875	50,322,035	80,580,306	48,944,859	54,779,406
未払収益分配金	42,365,111	39,433,393	38,806,960	38,025,163	37,559,236	37,205,689
未 払 解 約 金	14,928,718	10,779,578	5,912,544	37,190,883	6,168,522	11,996,164
未 払 信 託 報 酬	5,123,610	5,260,070	5,431,465	5,137,167	4,936,580	5,240,842
未 払 利 息	—	519	—	462	496	—
その他未払費用	55,419	112,315	171,066	226,631	280,025	336,711
(C) 純資産総額(A－B)	7,001,804,323	6,373,214,655	6,406,649,482	6,372,811,927	6,362,475,184	6,263,332,729
元 本	42,365,111,670	39,433,393,188	38,806,960,802	38,025,163,585	37,559,236,588	37,205,689,204
次期繰越損益金	△35,363,307,347	△33,060,178,533	△32,400,311,320	△31,652,351,658	△31,196,761,404	△30,942,356,475
(D) 受 益 権 総 口 数	42,365,111,670口	39,433,393,188口	38,806,960,802口	38,025,163,585口	37,559,236,588口	37,205,689,204口
1万口当たり基準価額(C/D)	1,653円	1,616円	1,651円	1,676円	1,694円	1,683円

（注記事項）

作成期首元本額	42,735,313,609円
作成期中追加設定元本額	464,987,744円
作成期中一部解約元本額	5,994,612,149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 167 期 自2023年10月11日 至2023年11月8日	第 168 期 自2023年11月9日 至2023年12月8日	第 169 期 自2023年12月9日 至2024年1月9日	第 170 期 自2024年1月10日 至2024年2月8日	第 171 期 自2024年2月9日 至2024年3月8日	第 172 期 自2024年3月9日 至2024年4月8日
(A) 配 当 等 収 益	94,625,520円	88,429,744円	87,789,221円	86,597,171円	85,960,970円	85,844,720円
受 取 配 当 金	94,632,866	88,437,456	87,797,762	86,605,570	85,968,362	85,848,026
受 取 利 息	—	—	—	—	—	254
支 払 利 息	△ 7,346	△ 7,712	△ 8,541	△ 8,399	△ 7,392	△ 3,560
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	558,617,298	△ 188,199,632	91,116,113	51,722,550	24,229,210	△ 82,625,907
売 買 益	561,333,432	406,475	92,993,834	53,311,056	25,472,380	390,520
売 買 損	△ 2,716,134	△ 188,606,107	△ 1,877,721	△ 1,588,506	△ 1,243,170	△ 83,016,427
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,183,116	△ 5,320,610	△ 5,495,097	△ 5,195,450	△ 4,991,865	△ 5,297,528
(D) 当期損益金(A+B+C)	648,059,702	△ 105,090,498	173,410,237	133,124,271	105,198,315	△ 2,078,715
(E) 前期繰越損益金	△ 6,915,962,404	△ 5,862,266,366	△ 5,900,089,610	△ 5,637,560,064	△ 5,462,696,701	△ 5,335,741,094
(F) 追加信託差損益金	△29,053,039,534	△27,053,388,276	△26,634,824,987	△26,109,890,702	△25,801,703,782	△25,567,330,977
(配当等相当額)	(5,056,792,344)	(4,717,131,177)	(4,652,518,725)	(4,569,909,104)	(4,525,403,366)	(4,491,263,525)
(売買損益相当額)	(△34,109,831,878)	(△31,770,519,453)	(△31,287,343,712)	(△30,679,799,806)	(△30,327,107,148)	(△30,058,594,502)
(G) 計 (D+E+F)	△35,320,942,236	△33,020,745,140	△32,361,504,360	△31,614,326,495	△31,159,202,168	△30,905,150,786
(H) 収 益 分 配 金	△ 42,365,111	△ 39,433,393	△ 38,806,960	△ 38,025,163	△ 37,559,236	△ 37,205,689
次期繰越損益金(G+H)	△35,363,307,347	△33,060,178,533	△32,400,311,320	△31,652,351,658	△31,196,761,404	△30,942,356,475
追加信託差損益金	△29,053,039,534	△27,053,388,276	△26,634,824,987	△26,109,890,702	△25,801,703,782	△25,567,330,977
(配当等相当額)	(5,056,792,344)	(4,717,131,177)	(4,652,518,725)	(4,569,909,104)	(4,525,403,366)	(4,491,263,525)
(売買損益相当額)	(△34,109,831,878)	(△31,770,519,453)	(△31,287,343,712)	(△30,679,799,806)	(△30,327,107,148)	(△30,058,594,502)
分配準備積立金	5,906,540,816	5,531,448,605	5,479,608,362	5,403,507,622	5,370,356,072	5,354,733,784
繰 越 損 益 金	△12,216,808,629	△11,538,238,862	△11,245,094,695	△10,945,968,578	△10,765,413,694	△10,729,759,282

(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167期計算期間末における費用控除後の配当等収益（93,874,486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（5,056,792,344円）および分配準備積立金（5,855,031,441円）より分配対象収益は11,005,698,271円（10,000口当たり2,597円）であり、うち42,365,111円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第168期計算期間末における費用控除後の配当等収益（83,109,134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（4,717,131,177円）および分配準備積立金（5,487,772,864円）より分配対象収益は10,288,013,175円（10,000口当たり2,608円）であり、うち39,433,393円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第169期計算期間末における費用控除後の配当等収益（85,092,777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（4,652,518,725円）および分配準備積立金（5,433,322,545円）より分配対象収益は10,170,934,047円（10,000口当たり2,620円）であり、うち38,806,960円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第170期計算期間末における費用控除後の配当等収益（83,344,300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（4,569,909,104円）および分配準備積立金（5,358,188,485円）より分配対象収益は10,011,441,889円（10,000口当たり2,632円）であり、うち38,025,163円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第171期計算期間末における費用控除後の配当等収益（82,066,816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（4,525,403,366円）および分配準備積立金（5,325,848,492円）より分配対象収益は9,933,318,674円（10,000口当たり2,644円）であり、うち37,559,236円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第172期計算期間末における費用控除後の配当等収益（80,547,192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（4,491,263,525円）および分配準備積立金（5,311,392,281円）より分配対象収益は9,883,202,998円（10,000口当たり2,656円）であり、うち37,205,689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167期	第168期	第169期	第170期	第171期	第172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167期	第168期	第169期	第170期	第171期	第172期
	(2023年10月11日 ～2023年11月8日)	(2023年11月9日 ～2023年12月8日)	(2023年12月9日 ～2024年1月9日)	(2024年1月10日 ～2024年2月8日)	(2024年2月9日 ～2024年3月8日)	(2024年3月9日 ～2024年4月8日)
当期分配金 (対基準価額比率)	10 (0.601%)	10 (0.615%)	10 (0.602%)	10 (0.593%)	10 (0.587%)	10 (0.591%)
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	2,587	2,598	2,610	2,622	2,634	2,646

（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 「ストラクチュラ-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、2024年4月5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）（2024年4月5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	300,000	45,031,612
アメリカ	CCO HOLDINGS	4.75 22-32 01/02S	USD	300,000	36,826,321
バミューダ	WEATHERFORD INT	8.6250 21-30 30/04S	USD	225,000	36,551,446
アメリカ	IMOLA MERGER CO	4.7500 21-29 15/05S	USD	250,000	36,067,017
カナダ	BOMBARDIER	7.875 19-27 15/04S	USD	225,000	35,431,407
アメリカ	HILTON DOMESTIC	4.875 19-30 15/01S	USD	225,000	32,749,076
	OLYMPUS WTR US	9.7500 23-28 15/11S	USD	200,000	32,246,133
ケイマン諸島	TRANSOCEAN	6.80 07-38 15/03S	USD	250,000	32,163,933
アメリカ	NAVIENT CORP	6.75 17-25 25/06S	USD	200,000	31,068,301
パナマ	CARNIVAL CORP	7.625 20-26 01/03S	USD	200,000	30,829,191
イギリス	JAGUAR LAND ROVER	5.875 20-28 15/01S	USD	200,000	30,197,328
アメリカ	NEPTUNE BIDCO US CO	9.29 22-29 15/04S	USD	200,000	29,873,955
	SLM CORP	3.125 21-26 02/11S	USD	200,000	28,564,718
	VENTURE GLOBAL	8.1250 23-28 01/06S	USD	175,000	27,746,139
	CCO HOLDINGS	4.5 21-32 01/05S	USD	225,000	27,510,400
	ORGANON COMPANY	5.125 21-31 30/04S30/04S	USD	200,000	27,221,977
カナダ	1011778 BC UNLIMITED	4.0000 20-30 15/10S	USD	200,000	27,163,607
アメリカ	ALLIED UNIVERSAL	6.0 21-29 01/06S	USD	200,000	26,793,631
イギリス	VMED 02 UK FINANCING	4.25 20-31 31/01S	USD	200,000	25,633,787
アメリカ	CLOUD SOFTWARE	9.0000 23-29 30/09S	USD	175,000	25,243,734
	CSC HOLDINGS LLC	6.5 19-29 01/02S	USD	200,000	25,224,629
	FRONTIER COMMUNICATION	5.00 20-28 01/05S	USD	175,000	25,035,859
	LIFE TIME INC	8.00 21-26 15/04S	USD	150,000	23,874,903
	CCO HLDG LLC/CAPITAL	4.50 21-33 01/06S	USD	200,000	23,795,108
	SPIRIT AEROSYSTEMS	4.6 18-28 15/06S	USD	165,000	23,794,864
	BALL CORP	6.875 22-28 15/03S	USD	150,000	23,707,843
	BUILDERS FIRSTS	4.2500 21-32 01/02S	USD	175,000	23,590,971
	TENET HEALTHCARE CORP	6.125 22-30 15/06S	USD	150,000	23,006,472
	MPT OPER PARTNER	5.00 17-27 15/10S	USD	175,000	22,356,046
	VICI PROPERTIES LP	4.25 19-26 01/12S/12S	USD	150,000	22,174,493

（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 [N D F] （2024年4月5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		212,980,292.50		米ドル		42,500,000.00		2024／6／4		△ 83,280,644
米ドル		1,000,000.00		ブラジルリアル		5,079,073.00		2024／6／4		△ 63,739
								合計		△ 83,344,383

< 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（2024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、2024年 4 月 8 日現在の情報を掲載しています。

■組入資産の明細（2024年 4 月 8 日現在）

公社債
(A) 債券種類別開示
国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 4 月 8 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
地 方 債 証 券	千円 350,000	千円 350,472	% 67.8	% —	% —	% —	% 67.8
合 計	350,000	350,472	67.8	—	—	—	67.8

(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	2024 年 4 月 8 日 現 在			
		利率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地 方 債 証 券	第 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	% 0.001	千円 50,000	千円 49,978	2024／8／28
	第 1 3 4 回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,074	2024／5／24
	第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,080	2024／8／23
	第 1 3 9 回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,340	2024／10／25
	合 計		350,000	350,472	

(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 2023年12月31日
 (計算期間：2023年1月1日～2023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 (2023年1月1日～2023年12月31日)

項目	当期
	円
(a)運用報酬	30,400,488
(b)管理費用等	11,234,962
(c)その他の費用	8,907,054
合計	50,542,504

■純資産計算書 (2023年12月31日現在)

項目	当期末
	円
資産合計	6,314,276,747
有価証券	5,990,960,574
預金	132,333,453
未収利息	98,772,912
為替予約取引評価勘定	92,209,808
負債合計	94,691,397
借入金	3,452,593
未払配当金	87,875,000
未払運用報酬	2,342,254
未払管理費用	865,613
未払税	155,937
純資産	6,219,585,350

■有価証券明細 (2023年12月31日現在)

数量	評価額 円	数量	評価額 円
債券			
オーストラリア	41,785,116	25.000 TASEKO MINES LT 7.0000 21-26 15/02S	3,359,308
125.000 FMG RES AUG 2006 PTY 4.375 21-31 01/04SS	16,015,810	50.000 TELESAT CANADA 5.625 21-26 06/12S	4,396,915
54.000 FMG RESO AUG 2006 PTY 6.125 22-32 15/04S	7,681,951	25.000 TELESAT CANADA 6.50 19-27 15/10S	1,667,294
25.000 FMG RESOURCES A 5.8750 22-30 15/04S	3,506,442	100.000 TITAN ACQUISITION LTD 7.75 18/26 15/04S	14,205,833
25.000 MINERAL RESOURC 9.2500 23-28 01/10S	3,722,207	50.000 VERMILION ENERGY 6.875 22-30 01/05S	6,799,401
25.000 MINERAL RESOURCES 8.0 22-27 01/11S	3,615,540	25.000 VIDEOTRON 3.625 21-29 15/06S	3,227,316
25.000 MINERAL RESOURCES 8.5 22-30 01/05S	3,651,551	25.000 VIDEOTRON LTEE 5.125 17-27 15/04S04S	3,482,756
25.000 MINERAL RESOURCES LTD 8.125 19-27 01/05S	3,561,930		
50.000 VIRGIN AUSTRALIA 19-24 15/11S - DEFAULT	29,685	アメリカ	5,351,963,964
バミューダ	42,643,981	50.000 ABERCROMBIE 8.75 20-25 15/07S	7,182,574
25.000 NABORS INDUSTRIES INC 7.50 20-28 15/01S	3,071,731	25.000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.00 20-29 15/04S	3,405,395
25.000 VALARIS LTD 8.375 23-30 30/04S	3,612,934	25.000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.50 20-28 01/07S	3,491,320
25.000 VIKING OCEAN CR 5.6250 21-29 15/02S	3,439,271	75.000 ACRISURE LLC 0.125 19-26 01/08S	11,099,804
50.000 VOC ESCROW LTD 5.00 18-28 15/02S	6,772,000	75.000 ACRISURE LLC 4.25 21-29 15/02S	9,652,793
175.000 WEATHERFORD INT 8.6250 21-30 30/04S	25,748,045	25.000 ACRISURE LLC 7.0 17-25 15/11S	3,519,834
カナダ	265,392,784	25.000 ACUSHET COMPANY DEL 7.375 23-28 10/15S	3,686,302
200.000 1011778 BC UNLIMITED 4.0000 20-30 15/10S	25,397,653	17.000 ADAMS HOMES 7.50 20-25 15/02S	2,389,754
25.000 1011778 BC UNLIMITED 4.3750 19-28 15/01S	3,370,447	25.000 ADAMS HOMES 9.25 23-28 15/10S	3,586,724
50.000 BAFFINLAND IRON MINES 8.75 18-26 15/07A	6,631,323	40.000 ADTALEM ESCROW CORP 5.50 21-28 01/03S	5,473,481
75.000 BAUSCH & LOMB E 8.3750 23-28 01/10S	11,175,480	50.000 ADT SEC CORP 4.1250 21-29 01/08S	6,530,496
50.000 BAUSCH HEALTH 5.2500 19-30 30/01S	3,177,497	25.000 ADVANCED DRAIN 6.3750 22-30 15/06S	3,576,612
25.000 BAUSCH HEALTH 7.0000 19-28 15/01S	1,541,055	25.000 AETHON UN/AETHIN UN F 8.25 21-26 15/02S	3,555,751
74.000 BAUSCH HEALTH 9.00 17-25 15/12S	9,762,062	50.000 AFFINITY GAMING 6.8750 20-27 15/12S	6,305,091
25.000 BAUSCH HEALTH CO 7.25 19-29 30/05S	1,620,661	100.000 AG ISSUER LLC 6.25 20-28 01/03S	14,041,076
75.000 BAUSCH HEALTH COM 6.1250 22-27 01/02S	7,152,214	25.000 AHP HEALTH PARTNERS 5.75 21-29 15/07S	3,082,824
50.000 BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.25 20-31 15/02S	3,110,509	100.000 ALBERTSONS COMPANIES 4.625 19-27 15/01S	13,696,486
225.000 BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S	31,801,231	25.000 ALBERTSONS COMPANIES 4.875 20-30 15/02S	3,384,977
25.000 BOMBARDIER 8.75 23-30 15/11S	3,763,444	150.000 ALBERTSONS COMPANIES 6.5 23-28 15/02S	21,504,065
50.000 BOMBARDIER INC 6.0 21-28 15/02S	6,872,783	50.000 ALLEGHENY TECHN 4.8750 21-29 01/10S	6,617,803
50.000 BROOKFIELD RESIDEN 5.00 21-29 15/06S	6,315,682	25.000 ALLEGHENY TECHN 5.1250 21-31 01/10S	3,294,775
50.000 EMPIRE COMMUNIT 7.0000 20-25 15/12S	6,988,340	50.000 ALLEGHENY TECHNO 5.875 19-27 01/12S	6,969,161
125.000 GARDIA WORLD SECURITY 6.0 21-29 01/06S	15,866,671	25.000 ALLEGIANTRAVEL 7.25 22-27 15/08S	3,475,688
25.000 GFL ENVIRONMENTAL 6.75 23-31 15/01S	3,637,167	25.000 ALLEN MEDIA LLC 10.5 20-28 15/02S	1,883,171
25.000 GOEASY 9.25 23-28 01/12S	3,771,981	200.000 ALLIED UNIVERSAL 6.0 21-29 01/06S	23,206,373
25.000 HUSKY III HOLDING 13.0 20-25 15/02S	3,538,842	25.000 ALLIED UNIVERSAL 6.625 19-26 15/07S	3,515,471
25.000 INTELLIGENT PACKAGING 6.00 20-28 15/09S	3,302,071	125.000 ALLIED UNIVERSAL 9.75 19-27 15/07S	17,283,378
50.000 MATTAMY GROUP 4.625 20-30 01/03S	6,543,377	25.000 ALLISON TRANSMI 3.7500 20-31 30/01S	3,115,351
25.000 METHANEX CORP 5.125 20-27 15/10S7 15/10S	3,445,480	50.000 ALLY FINANCIAL INC 6.70 23-33 14/02S	7,059,628
25.000 NOVA CHEMICALS CORP 4.2500 21-29 15/05S	2,984,617	25.000 ALTA EQUIPMENT GROUP 5.625 21-26 15/04S	3,425,853
33.000 NOVA CHEMICALS CORP 5.25 17-27 01/06S6S	4,369,779	75.000 AMC NETWORKS INC 4.25 21-29 15/02S	8,179,922
75.000 OPEN TEXT CORP 3.875 21-29 01/12S	9,495,627	25.000 AMC NETWORKS INC 4.75 17-25 01/08S	3,428,256
50.000 PARKLAND CORP 4.6250 21-30 01/05S	6,533,955	50.000 AMERICAN AIRLIN 8.5000 23-29 15/05S	7,472,546
150.000 PARKLAND CORPORATION 4.5 -21-29 01/10S	19,528,592	100.000 AMERIGAS PART/FIN 5.50 16-25 20/05S	13,931,145
50.000 PRECISION DRILL 6.8750 21-29 15/01S	6,792,167	25.000 AMERITEX HOLDCO 10.2500 23-28 15/10	3,626,274
23.000 PRECISION DRILLING 7.125 17-26 15/01S	3,239,729	100.000 AMN HEALTHCARE 4.0000 20-29 15/04S	12,817,200
50.000 SUPERIOR PLUS LP SUP 4.5 21-29 15/03S	6,523,525	25.000 AMN HEALTHCARE 4.625 19-27 01/10S	3,362,126
		25.000 ANTERO MIDSTREAM 5.375 21-29 15/06S	3,396,275
		50.000 ANTERO MIDSTREAM 5.750 19-27 01/03S	7,008,881
		25.000 ANTERO MIDSTREAM 7.875 20-26 15/05S	3,621,159
		25.000 API ESCROW CORP 4.75 21-29 15/10S	3,309,778
		50.000 API GROUP DE INC 4.125 21-29 15/07S	6,471,495
		25.000 APX GROUP INC 5.7500 21-29 15/07S	3,301,058

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
50.000 ARCHES BUYER 4.250 20-28 01/06S	6.399.859	25.000 CAESARS ENTERTAINMENT 6.25 20-25 01/07S	3.528.477
25.000 ARCHROCK PARTNE 6.2500 19-28 01/04S	3.481.161	25.000 CALPINE CORP 4.625 20-29 01/02S	3.280.032
50.000 ARCHROCK PARTNE 6.8750 19-27 01/04S	7.090.361	25.000 CALPINE CORP 5.00 20-31 01/02S	3.236.801
25.000 ARKO CORP 5.125 21-29 15/11S	3.064.295	125.000 CALPINE CORP 5.125 19-28 15/03S	16.899.949
100.000 ARSENAL AIC PAR 8.0000 23-30 01/10S	14.847.161	50.000 CARGO AIRCRAFT MANAG 4.750 20-28 01/02S	6.452.500
25.000 ASBURY AUTOMOTIVE 4.6250 21-29 15/11S	3.272.395	475.000 CARNIVAL CORP 5.75 21-27 01/03S	65.384.727
25.000 ASBURY AUTOMOTIVE 4.75 20-30 01/03S	3.296.995	200.000 CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S	28.715.177
75.000 ASGN INCORPORAT 4.6250 19-28 15/05S	10.093.236	25.000 CARNIVAL CORPORATION 10.5 22-30 01/06S	3.859.470
50.000 ASHTON WOODS US 4.6250 21-30 01/04S	6.378.502	50.000 CARNIVAL CORPORATION 6.65 98-28 15/01S	6.792.504
50.000 ASHTON WOODS USA LLC 6.625 20-28 15/01S	6.905.671	75.000 CARNIVAL CORPORATION 6 21-29 01/05S	10.174.035
25.000 ASSUREDPARTNERS 5.6250 20-29 15/01S	3.300.863	25.000 CARNIVAL CORPORATION 7.00 23-29 15/08S	3.680.705
25.000 ATI 7.25 23-30 15/08S	3.677.989	50.000 CARPENTER TECHNOLOGY 6.375 20-28 15/07SS	7.084.039
50.000 AUSTIN BIDCO INC 7.125 20-28 15/12S	6.078.731	25.000 CARRIAGE SERVIC 4.2500 21-29 15/05S	3.133.606
125.000 AVANTOR FUNDING INC 3.8750 21-29 01/11S	16.053.264	50.000 CARROLS RESTAURANT GR 5.875 21-29 01/07S	6.223.158
50.000 AVANTOR FUNDING INC 4.6250 20-28 15/07S	6.788.978	75.000 CASTLE US HOLDING CORP 9.5 20-28 15/02S	5.494.836
50.000 AVIENT CORP 7.125 22-30 01/08S	7.320.518	75.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.25 20-31 01/02S	9.248.508
25.000 AVIS BUDGET CAR 5.375 21-29 01/03S	3.266.489	200.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.50 21-33 01/06S	23.851.614
25.000 AVIS BUDGET CAR 5.750 19-27 15/07S	3.425.712	325.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S	39.348.000
50.000 AVIS BUDGET CAR RENT 4.75 21-28 23/03S	6.539.411	75.000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.75 19-30 01/03S	9.678.216
25.000 B&G FOODS INC 8.0 23-28 15/09S	3.712.844	300.000 CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S	37.336.534
50.000 BALL CORP 6.0000 23-29 15/06S	7.203.398	50.000 CCO HOLDINGS 5 17-28 01/02S 17-28 01/02S	6.756.436
150.000 BALL CORP 6.875 22-28 15/03S	21.961.391	100.000 CCO HOLDINGS LLC / CCO 4.25 21-34 15/01S	11.477.113
25.000 BANK OF AMERICA CORP FLR 18-XX 2803S	3.382.537	75.000 CCO HOLDLLCCCO HOLD C 6.375 22-29 01/09S	10.445.415
50.000 BASIC EN SE ES 10.75 GTD SNR SEC PERP USD	35.245	75.000 CDI ESCROW ISSU 5.7500 22-30 01/04S	10.308.323
125.000 BATH&BODY WORKS INC 6.75 16-36 01/07S	17.806.356	50.000 CDR FR/CND WNDR 6.5 21-28 01/10S	7.058.020
50.000 BCPE EMPIRE HOLDINGS 7.625 21-27 01/05S	6.825.017	25.000 CDW LLC CDW FINANCE 3.25 20-29 15/02S	3.226.571
50.000 BCPE ULYSSES INTERMED 7.75 21-27 01/04S	6.624.687	25.000 CDW LLC CDW FINANCE 4.1250 20-25 01/05S	3.458.482
50.000 BEACON ROOFING 4.125 21-29 15/05S	6.435.994	25.000 CEC ENTERTAINMENT 6.75 21-26 01/05S	3.455.096
25.000 BEACON ROOFING 4.5000 19-26 15/11S	3.428.622	50.000 CEDAR FAIR LP CANADA 5.25 20-29 15/07S	6.660.622
25.000 BEACON ROOFING SUPPL 6.5 23-30 01/08S	3.620.604	100.000 CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S	13.626.454
50.000 BEAZER HOMES USA INC 7.25 19-29 15/10S	7.137.336	25.000 CENTENE CORP 4.625 20-29 15/12S	3.391.568
50.000 BELLRING BRANDS 7.0000 22-30 15/03S	7.338.696	50.000 CENTERFIELD MEDIA PAR 6.625 21-26 01/08S	5.012.673
25.000 BERRY GLOBAL ESCROW 5.625 19-27 15/07S	3.501.774	25.000 CENTRAL GARDEN & PET 4.125 20-30 15/10S	3.211.365
50.000 BERRY GLOBAL INC 4.50 18-26 15/02S	6.892.138	50.000 CENTRAL GARDEN & PET 4.125 21-31 30/04S	6.257.355
40.000 BIG RIVER STEEL 6.6250 20-29 31/01S	5.756.555	25.000 CENTRAL PARENT 8.0 23-29 15/06S	3.681.218
75.000 BLACKSTONE MORTGAGE 3.750 21-27 15/01S	9.474.915	25.000 CENTURY COMMUNI 6.7500 20-27 01/06S	3.570.470
50.000 BLUE RACER MIDSTREAM 7.625 20-25 15/12S	7.149.858	25.000 CENTURY COMMUNITIES I 3.875 21-29 15/08S	3.194.095
125.000 BOYD GAMING COR 4.75 20-27 01/12S	17.024.504	25.000 CHARLES RIVER L 4.0 21-31 15/03S	3.203.467
75.000 BOYD GAMING COR 4.75 21-31 15/06S	9.730.544	25.000 CHENIERE ENERGY 3.2500 22-32 30/01S	3.005.981
25.000 BOYNE USA INC 4.7500 21-29 15/05S	3.327.279	50.000 CHENIERE ENERGY PARTNER 4.0 21-31 01/03S	6.417.628
25.000 BRAND ENERGY INFRAS 10.375 23-30 01/08S	3.741.885	100.000 CHS/COMMUNITY H 5.2500 22-30 15/05S	11.797.482
25.000 BREAD FINANCIAL 9.7500 23-29 15/03S	3.655.650	125.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 4.75 21-31 15/02S	13.904.930
50.000 BRIGHTSTAR ESCROW COR 9.75 20-25 15/10S	7.160.411	75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 5.625 20-27 15/03S	9.839.091
50.000 BRISTOW GROUP I 6.8750 21-28 01/03S	6.824.682	25.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.00 20-29 15/01S	3.175.511
25.000 BTH & BDY WRKS 6.6250 20-30 01/10S	3.611.623	75.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.125 21-30 01/04S	6.830.530
15.000 BTH & BDY WRKS 9.375 20-25 01/07S	2.231.483	50.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 6.875 21-29 15/04S	4.608.580
175.000 BUILDERS FIRSTS 4.2500 21-32 01/02S	22.283.161	79.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 8.00 19-27 15/12S	10.844.727
25.000 BUILDERS FIRSTS 5.0000 20-30 01/03S	3.407.779	50.000 CHS/COMMUNITY HEALTH 8.0 19-26 15/03S	7.041.140
50.000 BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375 22-32 15/06S	7.256.225	100.000 CHS COMMUNITY HEALTH 10.875 23-32 15/01S	14.811.269
200.000 CAESARS ENTERTAINMEN 4.625 21-29 15/10S	25.516.526	20.000 CHS COMMUNITY HEALTH 6.875 19-28 01/04S	1.747.103
150.000 CAESARS ENTERTAINMENT 4.625 21-29 15/10S	19.137.396	50.000 CHURCHILL DOWNS INC 5.50 19-27 01/04S	6.980.326
25.000 CAESARS ENTERTAINMENT 5.75 20-25 01/07SS	3.523.937	75.000 CINEMARK USA 5.25 21-28 15/07S	9.717.300

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 CINEMARK USA INC 5.875 21-26 16/03S	3,469.891	100.000 DISH DBS CORPORATION 5.25 21-26 01/12S2S	12,128.509
25.000 CITGO PETROLEUM 6.3750 21-26 15/06S	3,518.418	25.000 DISH DBS CORPORATION 5.75 21-28 01/12S	2,859.793
100.000 CITGO PETROLEUM 7.0 20-25 15/06S	14,079.571	50.000 DISH DBS CORPORATION 7.375 20-28 01/07S	4,255.791
50.000 CITGO PETROLEUM CORP 8.375 23-29 15/01S	7,264.270	125.000 DISH NETWORK CORP 11.75 22-27 15/11S	18,404.288
100.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 5.125 19-27 15/08S	13,467.898	25.000 DIVERSIFIED HEALTH 9.75 20-25 15/06S	3,470.392
75.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.500 21-29 01/06S	8,783.887	42.000 DOMTAR CORP 6.75 21-28 01/10S1-28 01/10S	5,355.671
50.000 CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.750 21-28 15/04S	6,100.727	100.000 DORNOCH DEBT ME 6.6250 21-29 15/10S	12,719.825
25.000 CLEARWAY ENERGY 3.7500 21-32 15/01S	3,066.213	25.000 DREAM FINDERS H 8.2500 23-28 15/08S	3,737.249
25.000 CLEARWAY ENERGY 4.7500 19-28 15/03S	3,402.945	25.000 DT MIDSTREAM INCORPOR 4.375 21-31 15/06S	3,188.835
75.000 CLEVELAND CLIFFS 5.875 20-27 01/06S	10,553.379	25.000 DTZ US BORROWER LLC 8.875 23-31 01/09S	3,733.242
25.000 CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875 21-31 01/03S	3,201.090	75.000 EDGEWELL PERSONAL CAR 4.125 21-29 01/04S	9,670.879
200.000 CLOUD SOFTWARE 6.5000 22-29 31/03S	26,899.478	25.000 ENACT HOLDINGS INC 6.5000 20-25 15/08S	3,519.877
175.000 CLOUD SOFTWARE 9.0000 23-29 30/09S	23,464.944	75.000 ENCOMPASS HEALTH 4.75 19-30 01/02S	9,969.883
50.000 COEUR MINING IN 5.1250 21-29 15/02S	6,492.794	25.000 ENDURANCE ACQ M 6.0000 21-29 15/02S	2,670.790
50.000 COGENT COMMUNIC 7.0000 22-27 15/06S	7,135.351	25.000 ENERGIZER 6.5 22-27 31/12S	3,533.085
75.000 COHERENT CORP 5.0000 21-29 15/12S	10,053.283	75.000 ENLINK MIDSTREAM 4.85 16-26 15/07S5/07S	10,418.430
125.000 COINBASE GLOBAL 3.6250 21-31 01/10S	13,530.421	75.000 ENLINK MIDSTREAM 5.45 17-47 01/06S1/06S	9,339.520
125.000 COINBASE GLOBAL INC 3.375 21-28 01/10S	14,734.091	50.000 ENLINK MIDSTREAM 6.5 22-30 01/09S	7,200.415
50.000 COLT MERGER SUB INC 8.1250 20-27 01/07S	7,232.224	50.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.05 14-45 01/04S	5,859.055
25.000 COMMERCIAL META 4.1250 22-30 15/01S	3,244.745	50.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.375 19-29 01/06S	6,909.234
25.000 COMMERCIAL METALS CO 4.375 22-32 15/03S	3,190.254	25.000 ENLINK MIDSTREAM PART 5.625 20-28 15/01S	3,481.490
25.000 COMMSCOPE FINANCE 8.25 19-27 19/02S	1,862.585	50.000 EQM MIDSTREAM 4.50 21-29 15/01S	6,681.635
25.000 COMMSCOPE FINANCE LLC 6 19-26 01/03S	3,141.936	25.000 EQM MIDSTREAM PART 4.75 21-31 15/01S1S	3,293.333
50.000 COMMSCOPE INC 7.125 20-29 15/01S	3,397.626	25.000 EQM MIDSTREAM PART 5.50 18-28 15/07S	3,510.655
25.000 COMMSCOPE TECH 144A 6.00 15-25 15/06S	2,878.036	175.000 EQM MIDSTREAM PART 6.50 18-48 15/07S	25,509.298
25.000 COMPASS GROUP 5.0000 21-32 15/01S	3,193.689	25.000 EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-27 01/06S06S	3,642.879
50.000 COMPASS GROUP D 5.2500 21-29 15/04S	6,595.074	25.000 EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-30 01/06S	3,802.848
25.000 COMPASS MINERALS 6.75 19-27 01/12S	3,505.897	50.000 EVERI HOLDINGS 5.0000 21-29 15/07S	6,440.526
25.000 CONSENSUS CLOUD 6.5000 21-28 15/10S	3,224.211	25.000 FAIR ISAAC CORP 4.0000 19-28 15/06S	3,340.622
25.000 CONSOLIDATED COMM INC 6.5 20-28 01/10S	3,053.128	100.000 FERRELL GAS 5.375 21-26 01/04S	13,824.851
25.000 CORNERSTONE BUI 6.1250 20-29 15/01S	2,934.252	50.000 FERRELL GAS 5.875 21-29 01/04S	6,674.094
25.000 COTY/HFC PRESTI 6.6250 23-30 15/07S	3,634.691	25.000 FERTITTA ENTERT 6.7500 22-30 15/01S	3,101.605
25.000 COVANTA HOLDING 5.00 20-30 01/09S	3,026.174	25.000 FERTITTA ENTERTMT FIN 4.625 22-29 15/01S	3,207.200
25.000 CREDIT ACCEPTANCE 9.2500 23-28 15/12S	3,767.579	25.000 FIRSTCASH HOLDINGS 4.625 20-28 01/09S09S	3,293.115
50.000 CRESTWOOD MIDSTREAM 6.00 21-29 01/02S	7,110.085	25.000 FIRSTCASH INC 5.6250 21-30 01/01S	3,376.844
25.000 CROCS INC 4.125 21-31 15/08S	2,998.962	25.000 FIRST STUDENT BIDCO 4 21-29 31/07S	3,074.008
50.000 CROCS INC 4.25 21-29 15/03S	6,336.373	25.000 FORD MOTOR CO 3.25 21-32 12/02S32 12/02S	2,934.442
25.000 CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S	3,500.098	175.000 FORD MOTOR CO 4.75 13-43 15/01S3 15/01S	20,419.806
25.000 CROWN HOLDINGS INC 7.375 96-26 15/12S	3,723.183	25.000 FORD MOTOR CO 5.291 16-46 08/12S 08/12S	3,122.655
200.000 CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S	21,350.577	125.000 FORD MOTOR COMPANY 6.10 22-32 19/08S	17,798.324
200.000 CSC HOLDINGS LLC 5.0 21-31 15/11S	17,307.607	200.000 FORD MOTOR CREDIT CO 4.000 20-30 13/11S	25,304.586
200.000 CSC HOLDINGS LLC 6.5 19-29 01/02S	25,134.249	50.000 FORESTAR GROUP INC 3.85 21-26 15/05S	6,743.086
50.000 CS GROUP 5.00 20-28 15/12S	5,745.841	50.000 FORESTAR GROUP INC 5.00 20-28 01/03S	6,767.660
25.000 DANA INC 4.5000 21-32 15/02S	3,089.499	25.000 FORTRESS TRANSPORT 5.50 21-28 01/05S	3,396.311
75.000 DARLING INGREDI 6.0000 22-30 15/06S	10,580.973	7.000 FORTRESS TRANSPORT 6.50 18-25 01/10S	985.925
75.000 DAVITA INC 4.6250 20-30 01/06S	9,277.668	25.000 FORTRESS TRANSPORT 9.75 20-27 01/08S	3,669.287
25.000 DEALER TIRE LLC/DT 8.0 20-28 01/02S	3,500.383	50.000 FOUNDATION BUIL 6.0000 21-29 01/03S	6,385.868
25.000 DELEK 6.75 18-25 15/05S	3,493.074	21.000 FOXTROT ESCROW ISSUER 12.25 19-26 15/11S	2,656.850
50.000 DELEK LOGISTICS PARTN 7.125 21-28 01/06S	6,690.102	50.000 FREEDOM MORTGAG 12.0000 23-28 01/10	7,700.210
25.000 DELTA AIR LINES INC 7.375 20-26 12/06S	3,663.427	75.000 FREEDOM MORTGAGE 6.625 23-27 15/01S	10,090.276
150.000 DIRECTV FINANCING LLC 5.875 21-27 15/08S	19,870.555	75.000 FREEDOM MORTGAGE 7.625 23-26 01/05S	10,457.287
75.000 DISH DBS CORPORATION 5.125 21-29 01/06S	5,462.524	50.000 FREEDOM MORTGAGE CO 12.25 23-30 01/10S	7,750.208

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
50.000	FREEPORT MCMORAN 4.375 20-28 01/08S	6.791.616	65.000	HUGHES SAT SYS CORP 6.625 17-26 01/08S	7.233.346
75.000	FRONTIER COM CORP 5.875 20-27 15/10S5/10	10.218.269	25.000	ICAHN ENTER 4.375 21-29 01/02S	2.947.220
50.000	FRONTIER COMMUN 6.0000 21-30 15/01S	6.014.407	25.000	ICAHN ENTERPRIS 9.7500 23-29 15/01S	3.605.177
25.000	FRONTIER COMMUNICATI 5.875 21-29 30/04S	2.990.946	150.000	ICAHN ENTERPRISES LP 5.25 19-27 15/05S	19.182.563
175.000	FRONTIER COMMUNICATION 5.00 20-28 01/05S	22.815.058	50.000	ICAHN ENTERPRISES LP 6.25 19-26 15/05S	6.739.966
100.000	FRONTIER COMMUNICATION 6.75 20-29 01/05S	12.619.416	25.000	ICAHN ENTERPRISES LP 6.375 17-25 15/12S	3.466.061
25.000	FULL HOUSE RESORTS INC 8.25 21-28 15/02S	3.332.567	25.000	IHEARTCOMMUNI 6.375 19-26 01/05S	3.008.645
23.000	FXI 12.25 23-26 01/05S	2.912.764	50.000	IHEARTCOMMUNICATIONS 05.00 19-27 15/08S	5.603.830
25.000	GAP INC 3.625 21-29 01/10S	3.014.936	25.000	IHEARTCOMMUNICATIONS 4.750 19-28 15/01S	2.715.239
25.000	GCI LLC 4.75 20-28 15/10S	3.256.350	50.000	IHEARTCOMMUNICATIONS 8.375 19-27 01/05S	4.587.218
25.000	GENESIS ENERGY 8.8750 23-30 15/04S	3.652.981	25.000	ILLUMINATE BUYER LLC 9.0 20-28 01/07S	3.408.696
25.000	GENESIS ENERGY LP 8.25 23-29 15/01S	3.632.297	250.000	IMOLA MERGER CO 4.7500 21-29 15/05S	33.472.527
25.000	GLATFELTER CORP 4.75 21-29 15/11S 15/11S	2.468.850	50.000	INGLES MARKETS 4.0000 21-31 15/06S	6.244.389
75.000	GO DADDY OPCO/GD FIN CO 3.5 21-29 01/03S	9.587.752	25.000	INNOFOS HOLDINGS INC 9.375 20-28 15/02S	3.214.964
100.000	GOLDEN ENTERTAI 7.6250 19-26 15/04S	14.205.078	50.000	INSTALLED BUILDING 5.75 19-28 01/02S	6.908.956
25.000	GOODYEAR T & RUBBER 5.25 21-31 30/04S	3.231.284	25.000	IQVIA INC 6.25 23-29 01/02S	3.682.617
75.000	GOODYEAR TIRE 9.5 20-25 31/05S25 31/05S	10.773.747	75.000	IRON MOUNTAIN INC 4.5000 20-31 15/02S	9.633.948
25.000	GOODYEAR TIRE AND RUBB 5.00 22-29 15/07S	3.333.180	75.000	IRON MOUNTAIN INC 5.2500 20-30 15/07S	10.066.527
75.000	GOODYEAR TIRE RUBBER 5.25 22-31 15/07S	9.638.899	150.000	IRON MOUNTAIN INC 5.25 20-30 15/07S	20.133.052
100.000	GPS HOSPITALITY HOLDING 7 21-28 15/08S	10.429.136	25.000	IRON MOUNTAIN INC 5.625 20-32 15/07S	3.353.480
25.000	GRAPHIC PACKAGING 4.75 19-27 15/07S	3.438.523	100.000	IRON MOUNTAIN INFORMATI 5.0 21-32 15/07S	12.932.566
100.000	GRAY ESCROW II 5.3750 21-31 15/11S	10.645.542	75.000	ITT HOLDINGS LLC 6.5 21-29 01/08S	9.364.331
100.000	GRAY TELEVISION INC 4.75 20-30 15/10S	10.689.157	75.000	JACOBS ENTERTAI 6.7500 22-29 15/02S	10.021.605
25.000	GREYSTAR REAL E 7.7500 23-30 01/09S	3.731.609	50.000	JANE STREET GRP 4.5000 21-29 15/11S	6.587.301
100.000	GRIFFON 5.75 20-28 01/03S	13.882.159	75.000	JEFFERSON CAPITAL HOLDING 6 21-26 15/08S	10.121.442
75.000	HARVEST MIDSTREAM 7.5 20-28 01/09S	10.587.342	23.000	JELD-WEN INC 4.625 17-25 15/12S	3.151.735
25.000	HAT HLDG I LLC HAT II 8.00 23-27 15/06S	3.670.690	25.000	JP POINDEXT 8.7500 23-31 15/12S	3.603.897
50.000	HAT HOLDINGS I LLC 3.375 21-26 15/06S	6.654.086	50.000	KAISER ALUMINUM 4.6250 19-28 01/03S	6.536.768
50.000	HELIX ENERGY Solutio 9.75 23-29 01/03S	7.418.686	50.000	KB HOME 4.000 21-31 15/06S	6.360.379
100.000	HERTZ CORP 5.0 21-29 01/12S	11.586.421	50.000	KB HOME 6.875 19-27 15/06S	7.339.536
50.000	HESS MIDSTREAM PART 5.125 19-28 15/06S	6.822.955	25.000	KB HOME 7.25 22-30 15/07S	3.677.948
50.000	HESS MIDSTREAM PART 5.625 19-26 15/02S	7.006.234	25.000	KEN GARFF AUTOM 4.8750 20-28 15/09S	3.355.079
50.000	HILCORP ENERGY 6.0000 21-31 01/02S	6.796.156	25.000	KENNEDY WILSON INC 4.75 21-30 01/02S	2.841.995
50.000	HILCORP ENERGY 6.0000 22-30 15/04S	6.844.360	50.000	KINETIK HOLDING 5.8750 22-30 15/06S	6.924.538
50.000	HILCORP ENERGY 8.3750 23-33 01/11S	7.512.623	25.000	KONTOOR BRANDS 4.1250 21-29 15/11S	3.204.440
50.000	HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S	6.146.012	25.000	KRONOS ACQUISITION7.0 20-27 31/12S	3.370.884
75.000	HILTON DOMESTIC 4.0 20-31 01/05S	9.694.018	25.000	LABL INC 5.8750 21-28 01/11S	3.199.894
225.000	HILTON DOMESTIC 4.875 19-30 15/01S	30.772.267	50.000	LABL INC 8.2500 21-29 01/11S	6.031.502
25.000	HILTON DOMESTIC 5.75 20-28 01/05S	3.533.389	25.000	LADDER CAP FIN 4.25 20-27 01/02S	3.325.552
75.000	HILTON GRAND VACATION 4.875 21-31 01/07S	9.352.924	25.000	LADDER CAP FIN 4.7500 21-29 15/06S	3.180.430
75.000	HILTON GRAND VACATIONS BO 5 21-29 01/06S	9.768.881	50.000	LAMAR MEDIA CORPORAT 4.00 20-30 15/02S	6.524.824
75.000	HLF FIN SARL LLCHERB 4.875 21-29 01/06S	8.307.759	50.000	LAMB WESTON HOLDINGS 4.125 21-30 31/01S	6.510.642
50.000	HOLLYFRONTIER CORP 5.00 23-28 01/02S	6.832.475	50.000	LAMB WESTON HOLDINGS 4.375 21-32 31/01S	6.440.750
25.000	HOLLYFRONTIER CORP 6.375 23-27 15/04S	3.558.390	50.000	LBM ACQUISITION 6.2500 20-29 15/01S	6.285.281
75.000	HOWARD HUGUES CORP 4.125 21-29 01/02S	9.542.370	25.000	LCM INVESTMENTS 8.2500 23-31 01/08S	3.692.912
25.000	HOWARD HUGUES CORP 4.375 21-31 01/02S	3.097.207	75.000	LCM INVESTM Hlds II 4.875 21-29 01/05S	9.862.383
25.000	HOWARD HUGUES CORP 5.375 20-28 01/08S	3.402.319	25.000	LEEWARD RENEWAB 4.2500 21-29 01/07S	3.067.857
25.000	HOWARD MIDSTREAM ENE 6.75 21-27 15/01S	3.505.689	25.000	LEVEL 3 FINANCING INC 3.625 20-29 15/01S	1.494.044
19.000	HOWMET AEROSPACE INC 5.90 07-27 01/02S	2.750.508	75.000	LEVEL 3 FINANCING INC 3.75 21-29 15/07S	4.468.920
50.000	HOWMET AEROSPACE INC 5.95 07-37 01/02S	7.382.660	125.000	LEVEL 3 FINANCING INC 4.25 20-28 01/07S	8.778.304
16.000	HOWNET AEROSPACE INC 5.125 14-24 01/10S	2.253.131	25.000	LEVEL 3 FINANCING INC 4.625 19-27 15/09	2.137.062
25.000	HUB INTERNATIONAL 5.6250 21-29 01/12S	3.379.425	25.000	LGI HOMES INC 8.7500 23-28 15/12S	3.752.344

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
50.000 LIFEPOINT HEALTH INC 11 23-30 15/10S	7.446.698	50.000 MPT OPER PARTNERSHIP 3.500 20-31 15/03S	4.423.153
25.000 LIFEPOINT HEALTH INC 5.375 20-29 15/01S	2.611.488	25.000 MPT OPER PARTNERSHIP 4.625 19-29 01/08S	2.562.798
25.000 LIFEPOINT HEALTH INC 9.875 23-30 15/08S	3.584.287	75.000 MSCI INC 3.6250 21-31 01/11S	9.330.404
100.000 LIFE TIME INC 5.7500 21-26 15/01S	13.997.992	50.000 MSCI INC 4.0000 19-29 15/11S	6.633.777
175.000 LIFE TIME INC 8.00 21-26 15/04S	25.015.479	50.000 MURPHY OIL USA INC 3.75 21-31 15/02S	6.185.693
25.000 LIGHT & WONDER 7.5000 23-31 01/09S	3.687.519	25.000 NABORS INDUSTRIES 9.125 23-30 31/01S	3.561.742
25.000 LINDBLAD EXPEDITIO LLC 6.75 22-27 15/02S	3.532.442	50.000 NABORS INDUSTRIES INC 5.75 18-24 03/01S	7.070.049
75.000 LITHIA MOTORS INC 3.875 21-29 01/06S	9.604.977	9.000 NATHAN'S FAMOUS IN 6.625 17-25 01/11S	1.265.652
75.000 LITHIA MOTORS INC 4.625 19-27 15/12S	10.200.868	25.000 NATIONSTAR MORTGAGE HO 5.75 21-31 15/11S	3.296.973
125.000 LIVE NATION ENT 6.5000 20-27 15/05S	17.954.546	25.000 NATIONSTAR MTG 5.125 20-30 15/12S	3.217.362
75.000 LIVE NATION ENTERT 5.625 18-26 15/03U	10.489.082	75.000 NATIONSTAR MTG 5.5 20-28 15/08S	10.197.232
100.000 LOGAN MERGER SUB INC 5.5 20-27 01/09S	6.816.701	25.000 NATIONSTAR MTG 6.0000 20-27 15/01S	3.503.867
25.000 LSB INDUSTRIES 6.2500 21-28 15/10S	3.355.434	25.000 NATL FI 7.5 22-30 01/10S	3.775.666
75.000 LSF9 ATL HLDG/V 7.7500 21-26 15/02S	10.153.693	25.000 NAVIENT 11.5 23-31 15/03S	3.886.369
100.000 LUCENT TECHNOLOGIES 6.45 99-29 15/03S	13.978.430	50.000 NAVIENT 9.375 23-30 25/07S	7.440.406
50.000 LUMEN TECHNOLOGIES 7.995 06-36 01/06S06S	4.363.503	25.000 NAVIENT CORP 5.00 20-27 15/03S	3.408.971
75.000 MACYS RETAIL HLDG 5.875 21-29 01/04S	10.192.120	150.000 NAVIENT CORP 5.5 21-29 15/03S	19.537.585
25.000 MACYS RET HLDG INC 4.50 14-34 15/12S	2.903.025	200.000 NAVIENT CORP 6.75 17-25 25/06S	28.579.091
75.000 MACYS RET HLDG INC 5.125 12-42 15/01SS	8.304.991	25.000 NCL 7.75 22-29 15/02S	3.541.337
25.000 MACYS RET HLDG INC 6.375 07-37 15/03SS	3.132.432	125.000 NCL CORP LTD 5.875 20-26 15/03S	17.242.112
25.000 MADISON IAQ LLC 5.875 21-29 30/06S	3.119.030	25.000 NCL CORPORATION 8.1250 23-29 15/01S	3.704.479
25.000 MAGIC MERGERCO INC 5.250 21-28 01/05S	2.814.330	25.000 NCL FINANCE LTD6.125 21-28 15/03S	3.378.397
75.000 MAJORDRIVE HOLDING IV 6.375 21-29 01/06S	9.204.268	75.000 NCR ATLEOS ESCROW 9.50 23-29 01/04S	11.279.334
50.000 MATCH GROUP HLD 3.6250 21-31 01/10S	6.096.041	125.000 NCR VOYIX 5.125 21-29 15/04S	16.791.243
25.000 MATCH GROUP HLD 5.625 19-29 15/02S	3.449.182	200.000 NEPTUNE BIDCO US CO 9.29 22-29 15/04S	26.433.871
50.000 MATTEL INC 3.375 21-26 19/03S	6.716.915	50.000 NESCO HOLDINGS II INC 5.5 21-29 15/04S	6.537.396
25.000 MATTEL INC 5.45 11-41 01/11S	3.164.341	125.000 NEWELL BRANDS INC 4.70 16-26 01/04S	17.370.879
25.000 MATTHEWS INTERNATIONAL 5.25 17-25 01/12S	3.460.177	50.000 NEWELL BRANDS INC 5.375 16-36 01/04S	6.464.627
50.000 MAV ACQUISITION CORP 8.21-29 01/08S	6.604.039	50.000 NEWELL BRANDS INC 5.5 16-46 01/04S01/04S	5.837.366
25.000 MERCER INTERNATIONAL 5.125 21-29 01/02S	3.033.201	25.000 NEWELL BRANDS INC 6.375 22-27 15/09S/09S	3.519.292
43.000 MERITAGE HOME CORP 6.15-25 01/06S/06S	6.081.560	25.000 NEWELL BRANDS INC 6.6250 22-29 15/09S	3.516.657
125.000 METIS MERGER SUB LLC 6.5 21-29 15/05S	15.969.601	50.000 NEW ENTERPRISE 5.2500 21-28 15/07S	6.761.879
75.000 MGIC INVESTMENT CORP 5.25 20-28 15/08S8S	10.321.315	50.000 NEW ENTERPRISE 9.7500 20-28 15/07S	7.058.983
25.000 MGM RESORTS INTL 4.7500 20-28 15/10S	3.360.336	150.000 NEWS 5.125 22-32 15/02S	20.193.282
55.000 MGM RESORTS INTL 5.5 19-27 15/04S	7.700.286	75.000 NEWS CORP 3.875 21-29 15/05S	9.781.173
75.000 MGM RESORTS INTL 5.75 18-25 18/06S	10.568.731	3.000 NEXTERA ENERGY 144A 4.25 17-24 15/09S	412.934
50.000 MIDCONTINENT CO 5.3750 19-27 15/08S	6.875.286	100.000 NEXSTAR BROADCA 4.7500 20-28 01/11S	13.010.401
25.000 MIDWEST GAMING BORRO 4.875 21-29 01/05S	3.288.603	25.000 NEXTERA ENERGY OPER 3.875 19-26 15/10S0S	3.365.053
50.000 MINERALS TECHNOLOGIE 5.00 20-28 01/07S	6.763.488	25.000 NFP CORP 4.8750 21-28 15/08S	3.512.632
100.000 MINERVA MERGER 6.5000 22-30 15/02S	12.809.290	50.000 NFP CORP 6.875 20-28 15/08S	7.212.348
25.000 MIWD HOLDCO II 5.5 22-30 01/02S	3.131.248	25.000 NFP CORP 8.5000 23-31 01/10S	3.835.343
25.000 MODIVCARE 5.00 21-29 01/10S	2.886.920	100.000 NGL ENERGY 7.50 21-26 01/02S	14.258.381
50.000 MOHEGAN TRIBAL GAM 8.00 21-26 01/02S	6.656.629	25.000 NGL ENRGY PART 6.1250 17-25 01/03S	3.512.205
125.000 MOLINA HEALTHCARE 3.8750 21-32 15/05S	15.458.033	75.000 NMI HOLDINGS 7.3750 20-25 01/06S	10.643.701
50.000 MOLINA HEALTHCARE INC 0.875 20-30 15/11S	6.335.911	25.000 NORDSTROM INC 4.3750 19-30 01/04S	3.074.594
25.000 MOLINA HEALTHCARE INC 4.35 20-28 15/06S	3.349.314	25.000 NORTHWEST FIBER 4.7500 21-27 30/04S	3.390.222
51.000 MOSS CREEK RESOU HLD 7.5 18-26 15/01S	7.177.766	50.000 NORTONLIFELOCK INC 6.75 27 30/09S	7.179.534
25.000 MOSS CREEK RESOURCES 10.5 19-27 15/05S	3.620.866	50.000 NORTONLIFELOCK INC 7.125 30 30/09	7.379.444
125.000 MOZART DEBT MERGER 3.875 21-29 01/04S	15.951.907	100.000 NOVELIS CORP 4.7500 20-30 30/01S	13.296.743
150.000 MOZART DEBT MERGER 5.25 21-29 01/10S	20.019.571	25.000 NRG ENERGY INC 3.375 20-29 15/02S	3.119.763
25.000 MPH ACQUISITION 144A 5.75 29-28 01/11S	2.911.616	25.000 NRG ENERGY INC 3.625 20-31 15/02S	3.034.801
175.000 MPT OPER PARTNER 5.00 17-27 15/10S	20.292.732	15.000 NRG ENERGY INC 6.625 17-27 15/01S	2.128.409

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
50.000 NUSTAR LOGISTICS LP 6.00 19-26 01/06S	7,038.677	50.000 PROVIDENT FDG ASSO LP 6.375 17-25 15/06S	6,468.206
25.000 OCEANEERING INTL 6.0 23-28 01/02S	3,447.731	25.000 QUICKEN LNS LLC 3.875 20-31 01/03S	3,114.014
50.000 OLIN CORP 5.625 19-29 01/08S	6,964.028	50.000 QVC INC 4.45 14-25 15/02S	6,628.108
200.000 OLYMPUS WTR US 9.7500 23-28 15/11S	30,095.927	25.000 QVC INC 4.7500 20-27 15/02S	2,792.744
75.000 ONEMAIN FINANCE 4.0000 20-30 15/09S	9,056.809	25.000 RAISING CANES 9.3750 23-29 01/05S	3,763.176
25.000 ONEMAIN FINANCE 9.0000 23-29 15/01S	3,732.984	25.000 RAPTOR ACQUISITION CO 4.875 21-26 01/11S	3,371.213
25.000 ONEX USI ACQUISITION 7.5 23-32 15/01S	3,610.795	51.000 REALOGY GROUP LLC RE 7.0 23-30 15/04S	6,647.627
14.000 OPENLANE INC 5.125 17-25 01/06S	1,942.799	25.000 RESIDEO FUNDING	3,102.207
75.000 OPEN TEXT/OPEN 4.1250 21-31 01/12S	9,352.865	50.000 RHP HOTEL PROPERTIES 4.5 21-29 15/02S	6,586.646
100.000 OPEN TEXT HOLDINGS IN 4.125 20-30 15/02S	12,814.644	50.000 RITCHIE BROS HOL 7.75 23-31 15/03S	7,526.532
200.000 ORGANON COMPANY 5.125 21-31 30/04S30/04S	24,092.171	100.000 RLJ LODGING TRUST 3.75 21-26 17/06S	13,452.102
50.000 OSCAR ACQUISITI 9.5000 22-30 15/04S	6,880.784	50.000 RLJ LODGING TRUST 4.00 21-29 15/09S	6,368.696
25.000 OUTFRONT MEDIA 4.2500 21-29 15/01S	3,185.307	25.000 ROCKET MORTGAGE LLC 2.875 21-26 15/10S0S	3,270.822
75.000 OUTFRONT MEDIA 4.6250 19-30 15/03S	9,509.257	100.000 ROCKETMTGE CO-I 4.0000 21-33 15/10S	12,080.078
100.000 OUTFRONT MEDIA 5.0000 19-27 15/08S	13,762.449	50.000 ROCKIES EXP PIPELINE 3.6 20-25 15/05S0S	6,833.425
50.000 OWENS & MINOR I 4.5000 21-29 31/03S	6,225.371	50.000 ROCKIES EXP PIPELINE 6.875 10-40 15/04S	6,944.580
25.000 OWENS & MINOR I 6.6250 22-30 01/04S	3,374.772	25.000 ROLLER BEARING COMP 4.375 21-29 15/10S	3,284.303
125.000 OWENS-BROCKWAY 6.6250 20-27 13/05S	17,690.334	275.000 ROYAL CARIBBEAN 3.7 17-28 15/03S	35,833.272
25.000 PANTHER BF AGGREGATOR 8.5 19-27 15/05S	3,552.277	100.000 ROYAL CARIBBEAN 5.5 21-28 01/04S	13,927.823
50.000 PARK INTERMED HOLD 4.875 21-29 15/05S	6,580.953	50.000 ROYAL CARIBBEAN 7.5000 97-27 15/10S	7,455.123
50.000 PARK INTERMEDIATE 7.5 20-25 01/06S06S	7,118.493	25.000 ROYAL CARIBBEAN CRUISES 5.5 21-26 31/08S	3,500.694
75.000 PARK-OHIO INDUSTRIES 6.625 17-27 15/04S	9,871.939	25.000 ROYAL CARIB CRUISES 4.25 21-26 01/07S	3,410.235
50.000 PARK RIVER 5.625 21-29 01/02S	5,662.635	100.000 ROYAL CARIB CRUISES 5.375 22-27 15/07S	13,915.886
75.000 PATRICK INDUSTRIES 4.750 21-29 01/05S	9,695.386	50.000 RP ESCROW ISSUER LLC 5.25 20-25 15/12S	5,689.354
50.000 PAYSAFE FIN PLC 4.0000 21-29 15/06S	6,247.472	25.000 RYAN SPECIALTY 4.3750 22-30 01/02S	3,303.625
50.000 PBF HOLDING CO LLC 6.0 20-28 15/02S	6,895.291	25.000 SBA COMMUNICATIONS CO 3.125 21-29 01/02S	3,176.870
50.000 PBF HOLDING COMPANY 7.875 23-30 15/09S	7,199.805	50.000 SCIENCE APPLICA 4.8750 20-28 01/04S	6,769.348
50.000 PECF USS INTERM 8.0000 21-29 15/11S	3,222.464	75.000 SCIENTIFIC GAMES 7.000 19-28 15/05S	10,696.508
75.000 PENN NATIONAL G 4.1250 21-29 01/07S	9,090.518	50.000 SCIENTIFIC GAMES 7.2500 19-29 15/11S	7,246.098
50.000 PENNYMAC FI 7.875 23-29 15/12U	7,273.171	25.000 SCI GAMES 6.625 22-30 01/03S	3,300.412
75.000 PENNYMAC FINANCIAL 4.25 21-29 15/02S	9,535.236	75.000 SCIH SALT HOLDING 4.8750 21-28 01/05S	9,973.280
25.000 PENNYMAC FINANCIAL SER 5.75 21-31 15/09S	3,274.960	50.000 SCIH SALT HOLDING 6.625 21-29 01/05S	6,614.852
25.000 PERFORMANCE FOOD 5.50 19-27 15/10S	3,477.963	25.000 SCRIPPS ESCROW II INC 5.375 20-31 15/01S	2,589.368
50.000 PERFORMANCE FOOD GR 4.25 21-29 01/08S	6,474.452	25.000 SCRIPPS ESCROW INC 19-27 15/07S	3,130.448
50.000 PGT INC 4.375 21-29 01/10S	7,049.504	25.000 SEALED AIR/SEAL 7.2500 23-31 15/02S	3,748.484
25.000 PIKE 8.625 23-31 15/01S	3,709.994	75.000 SEALED AIR 5.0 22-29 15/04S	10,322.381
25.000 PILGRIMS PRIDE 6.25 23-33 01/07S	3,631.247	50.000 SEAWORLD PARKS 5.2500 21-29 15/08S	6,633.362
25.000 P L DEVELOPMENT LLC 7.75 20-25 15/11S	2,868.300	100.000 SEG HLD LLC/SEG 5.6250 20-28 15/10S	14,211.952
25.000 PM GENERAL PURCHASER 9.5 20-28 01/10S	3,594.400	75.000 SELECT MEDICAL CORP 6.25 19-26 15/08S S	10,643.771
25.000 POLAR US BOR LLC 6.75 21-26 15/05S	1,150.527	100.000 SENSATA TECHNOLOGIES 20-31 20-31 15/02S	12,444.606
125.000 POST HOLDINGS INC 4.625 20-30 15/04S	16,298.427	125.000 SERVICE CORPORATION 4 21-31 15/05S	15,817.903
50.000 POST HOLDINGS INC 5.50 19-29 15/12S	6,818.089	50.000 SERVICE PROPERTIES 4.95 17-27 15/02S/02S	6,418.411
50.000 PRA GROUP INC 7.375 20-25 01/09S	7,018.721	25.000 SERVICE PROPERTIES 4.95 19-29 01/10S10S	2,915.883
50.000 PREM ENTMT SUB LLC PR 5.625 21-29 01/09S	5,593.040	50.000 SERVICE PROPERTIES 5.25 16-26 15/02S	6,849.008
50.000 PREM ENTMT SUB LLC PR 5.875 21-31 01/09S	5,459.611	25.000 SERVICE PROPERTIES 7.50 20-25 15/09S	3,572.372
75.000 PRESIDIO HOLDINGS INC 8.25 20-28 01/02S	10,671.855	25.000 SERVICE PROPERTIES T 8.625 23-31 15/11S	3,700.445
50.000 PRESTIGE BRANDS 3.7500 21-31 01/04S	6,193.081	25.000 SHEA HOMES 4.7500 20-28 15/02U	3,349.036
75.000 PRIME HEALTHCARE SERV 7.25 20-25 01/11S	10,353.464	50.000 SHEA HOMES 4.7500 20-29 01/04U	6,529.788
19.000 PRIME SECURITY SERV 5.25 19-24 15/04S4S	2,673.246	75.000 SIMMONS FOODS INC 4.625 21-29 01/03S	9,178.614
25.000 PRIME SECURITY SERVIC 3.375 20-27 31/08S	3,273.964	25.000 SINCLAIR TELEVISION 4.125 20-30 01/12S	2,488.833
25.000 PRIME SECURITY SERVIC 6.25 20-28 15/01S	3,500.511	50.000 SINCLAIR TELEVISION 5.15 16-27 15/02S	6,378.558
50.000 PRIMO WATER HOLD INC 21-29 30/04S	6,516.424	25.000 SINCLAIR TELEVISION 5.5 19-30 27/11S	2,641.427

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
50.000 SIRIUS SATELLITE 3.125 21-26 16/08S	6.667.316	100.000 TENET HEALTHCARE CORP 5.125 19-27 01/11S	13.818.996
75.000 SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S	9.811.475	150.000 TENET HEALTHCARE CORP 6.125 22-30 15/06S	21.393.550
50.000 SIRIUS XM RADIO 5.00 17-27 01/08S	6.839.624	50.000 TEREX CORP 5.0000 21-29 15/05S	6.704.143
50.000 SIRIUS XM RADIO 5.50 19-29 01/07S	6.836.825	75.000 TERRAFORM POWER 4.7500 19-30 15/01S	9.913.282
125.000 SIRIUS XM RADIO INC 3.875 21-31 01/09S	15.063.110	25.000 THE ADT CORPORATION 4.875 16-32 15/07S	3.276.421
75.000 SIZZLING PLATTER LLC 8.5 20-25 28/11S	10.617.875	125.000 THE CHEMOURS CO 5.375 17-27 15/05S	17.249.618
33.288 SKYMILES IP LIMITED 4.50 20-25 20/10Q	4.634.060	75.000 THE SCOTTS MIRACLE-GRO 4.00 22-31 01/04S	9.123.082
200.000 SLM CORP 3.125 21-26 02/11S	26.438.703	25.000 THOR INDUSTRIES 4.0000 21-29 15/10S	3.149.434
50.000 SOLARIS MIDSTREAM HOL 7.625 21-26 01/04S	7.174.448	50.000 TKC HOLDINGS INC 10.5 21-29 15/05S	6.432.549
25.000 SONIC AUTOMOTIV 4.6250 21-29 15/11S	3.213.094	50.000 T-MOBILE USA INC 2.625 21-26 23/03S	6.710.885
50.000 SONIC AUTOMOTIVE 4.875 21-31 15/11S	6.286.973	25.000 TMS INTERNATIONAL CORP 6.25 21-29 15/04S	2.952.864
75.000 SPECIALTY BUILDING 6.37520-2630/09S	10.481.769	25.000 TOLL BROS FINANCE 4.875 17-27 15/03S	3.514.598
25.000 SPECTRUM BRANDS 3.875 21-31 15/03S	3.203.442	25.000 TOPBUILD CORP 4.1250 21-32 15/02S	3.153.692
25.000 SPECTRUM BRANDS 5.5 20-30 15/07B	3.438.762	250.000 TRANSOCEAN 6.80 07-38 15/03S	28.306.312
165.000 SPIRIT AEROSYSTEMS 4.6 18-28 15/06S	20.596.688	50.000 TRANSOCEAN 7.00 98-28 01/06S	6.180.767
25.000 SPIRIT AEROSYSTEMS 9.75 23-30 15/11S	3.798.209	16.000 TRANSOCEAN INC 11.5 20-27 30/01S	2.363.717
25.000 SPRINGLEAF FINANCE 5.3750 19-29 15/11S	3.306.423	100.000 TRANSOCEAN INC 7.25 18-25 01/11S	14.044.516
75.000 SPRINGLEAF FINANCE 6.625 19-28 15/01S	10.701.732	25.000 TRANSOCEAN INC 7.35 11-41 15/12S	3.153.108
75.000 SPRINGLEAF FINANCE 7.1250 18-26 15/03S	10.786.241	50.000 TRANSOCEAN INC 7.50 01-31 15/04S	6.220.928
75.000 SPRINGLEAF FINANCE 7.875 23-30 15/03S	10.908.458	25.000 TRANSOCEAN INC 7.50 17-26 15/01S	3.478.678
100.000 SRM ESCROW ISSUER 6.00 20-28 01/11S	13.952.370	50.000 TRAVEL + LEISURE CO 4.6250 19-30 01/03S	6.313.595
50.000 SRS DISTRIBUTION INC 4.625 21-28 01/07S	6.723.703	25.000 TRAVEL + LEISURE CO 6.625 20-26 31/07S	3.574.782
100.000 SSC TECHNOLOGIES 5.5 19-27 28/03S	13.953.260	75.000 TRIMAS CORP 4.125 21-29 15/04S	9.548.692
125.000 STANDARD INDUSTRIES 4.3750 20-30 15/07S	16.201.915	75.000 TRINSEO OP 5.125 21-29 01/04S	4.267.397
100.000 STAPLES INC 10.75 19-27 15/04S	10.318.536	14.000 TRINSEO OP 5.375 17-25 01/09S	1.690.092
100.000 STAPLES INC 7.5 19-26 15/04S	13.174.667	25.000 TRI POINTE HOMES 5.25 17-27 01/06S	3.490.738
25.000 STAR PARENT INC9.00 23-30 01/10S	3.723.444	50.000 TRITON WATER HOLDINGS 6.25 21-29 01/04S	6.195.720
25.000 STATION CASINOS 4.6250 21-31 01/12S	3.195.898	75.000 TRONOX INC 4.625 21-29 15/03S	9.371.210
50.000 STL HOLDING CO LLC 7.5 20-26 15/02S	6.904.944	75.000 TTM TECHNOLOGIES INC 4.21-29 10/03S	9.618.236
50.000 SUBURBAN PROPANE PARTN 5.0 21-31 01/06S	6.455.653	50.000 TWILIO INC3.875 21-31 15/03S	6.294.667
25.000 SUMMIT MATERIAL 7.2500 23-31 15/01S	3.719.933	25.000 UBER TECHNOLOGIES 6.25 20-28 15/01S	3.550.912
50.000 SUMMIT MATERIALS LLC 5.2500 20-29 15/01S	6.848.984	50.000 UBER TECHNOLOGIES 7.5 19-27 15/09S	7.303.662
25.000 SUMMIT MATERIALS LLC 6.50 19-27 15/03S	3.539.660	75.000 UBER TECHNOLOGIES 8.0 18-26 01/11S	10.777.533
25.000 SUNOCO LP/FINAN 7.0000 23-28 15/09S	3.641.318	16.175 UNITED AIRLINES 2020 5.875 20-27 28/10Q	2.306.941
75.000 SUNOCO LP/SUNOCO FIN 4.50 22-30 30/04S	9.802.762	25.000 UNITED AIRLINES 4.375 21-26 21/04S	3.441.028
50.000 SUNOCO LP 6 15-27/04S	7.085.050	50.000 UNITED AIRLINES 4.6250 21-29 15/04S	6.579.244
50.000 SWF ESCROW ISSUER 6.5 21-29 01/10S	5.075.752	25.000 UNITED NATURAL FOODS 6.75 20-28 15/10S	2.856.583
50.000 SYNAPTICS INC 4.21-29 15/06S21-29 15/06S	6.376.520	125.000 UNITED RENTALS 4.0000 20-30 15/07S	16.253.845
50.000 SYNCHRONY FINANCIAL 7.25 23-33 02/02S	7.016.223	25.000 UNITED RENTALS INC 3.875 20-31 15/02S	3.206.271
50.000 TALLGRASS ENERGY 6.00 20-30 31/12S	6.618.927	125.000 UNITED RENTALS NORTH 5.25 19-30 15/01S	17.427.800
50.000 TALLGRASS ENERGY 7.5 20-25 01/10S	7.136.223	75.000 UNITED SHORE FIN SERV 5.5 21-29 15/04S	10.025.538
25.000 TALLGRASS ENERGY PARTN 6.0 21-31 01/09S	3.272.757	25.000 UNITED WHOLESAL 5.7500 21-27 15/06S	3.460.179
25.000 TALOS PRODUCTION LLC 12 21-26 15/01S	3.636.843	50.000 UNITI GROUP/CSL 4.7500 21-28 15/04S	6.088.275
50.000 TEGNA INC 4.625 20-28 15/03S	6.593.358	25.000 UNITI GROUP/CSL 6.5000 21-29 15/02S	2.558.274
25.000 TEGNA INC 5 20-29 15/09S	3.236.694	6.000 UNIVISION COMMUNICA 5.125 15-25 15/02S	845.128
50.000 TEMPUR SEALY INTL INC 4.0 21-29 15/04S	6.399.315	125.000 UNIVISION COMMUNICA 6.625 20-27 01/06S	17.590.404
50.000 TENET HEALTHCARE 4.25 21-29 01/06S	6.569.679	25.000 UNIVISION COMMUNICA 8.0 23-28 15/08S	3.647.028
25.000 TENET HEALTHCARE 4.625 20-28 15/06S	3.361.731	25.000 UNIVISION COMMUNICAT 7.375 22-30 30/06S	3.527.361
100.000 TENET HEALTHCARE 6.125 20-28 01/10S	14.047.062	100.000 UNIVISION COMMUNICATI 4.5 21-29 01/05S	12.585.520
25.000 TENET HEALTHCARE 6.25 19-27 01/02S	3.538.354	25.000 USA COMPRESSION PART 6.875 18-26 01/04S	3.519.242
25.000 TENET HEALTHCARE 4.375 21-30 15/01S	3.274.285	50.000 USA COMPRESSION PART 6.875 19-27 17/12S	7.002.943
100.000 TENET HEALTHCARE CORP 4.875 19-26 01/01S	13.952.927	125.000 US FOODS INC 4.75 21-29 15/02S	16.777.009

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 US FOODS INC 6.875 23-28 15/09S	3.639.183	25.000 TRANSOCEAN AQUILA LT 8.00 23-28 30/09S	3.602.421
25.000 US FOODS INC 7.25 23-32 15/01S	3.691.955	イスラエル	6.185.332
100.000 VALEANT PHARMA 8.5 18-27 01/06S	7.831.260	50.000 PLAYTIKA HOLDIN 4.2500 21-29 15/03S	6.185.332
175.000 VENTURE GLOBAL 8.1250 23-28 01/06S	24.936.341	ルクセンブルク	40.814.504
25.000 VENTURE GLOBAL 9.5000 23-29 01/02S	3.730.811	200.000 ALTICE FRANCE HOLDIN 6 20-28 06/02S	13.433.084
150.000 VENTURE GLOBAL 9.8750 23-32 01/02S	22.035.686	50.000 CAMELOT FINANCE SA 4.5 19-26 01/11S1/11S	6.891.256
50.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-29 15/08S	6.368.221	25.000 TELECOM ITALIA CAP 6.375 04-33 15/11S	3.461.942
75.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-33 01/11S	8.979.065	100.000 TELECOM ITALIA CAP 6 05-34 30/09S 30/09S	13.471.233
25.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 4.125 21-31 15/08S	3.118.253	25.000 TELECOM ITALIA CAPITAL7.20 06-36 18/07S	3.556.989
26.000 VERICAST MERGER SUB 11.00 21-26 15/09S	3.891.972	マルタ	11.039.803
25.000 VERSCEND 9.75 18-26 27/08S	3.551.854	50.000 VISTAJET MAL FIN 7.875 22-27 01/05S	6.108.915
50.000 VICI PROPERTIES LP 3.75 20-27 15/02S	6.668.915	50.000 VISTAJET MALT 6.375 22-30 01/02S	4.930.888
150.000 VICI PROPERTIES LP 4.25 19-26 01/12S/12S	20.385.490	オランダ	16.416.654
25.000 VICTORIA'S SECR 4.6250 21-29 15/07S	2.953.865	50.000 ELASTIC NV 4.1250 21-29 15/07S	6.485.789
125.000 VIKING CRUISES -31 15/07S	18.891.955	75.000 OI EUROPEAN GROUP BV 4.75 21-30 15/02S	9.930.865
100.000 VIKING CRUISES LTD 5.875 17-27 15/09S	13.763.269	イギリス	67.234.179
75.000 VIKING CRUISES LTD 6.25 15-25 15/05S	10.562.510	75.000 CARNIVAL PLC 7.875 01-27 01/06S	11.074.072
25.000 VISTRA OPERATIONS CO 4.375 21-29 01/05S	3.279.480	200.000 JAGUAR LAND ROVER 5.875 20-28 15/01S	27.733.049
100.000 VISTRA OPERATIONS CO 5 19-27 31/07S	13.735.231	25.000 MACQUARIE AIRFINANCE 8.125 23-29 30/03S	3.688.189
75.000 VISTRA OPERATIONS CO 7.750 23-31 15/10S	10.991.483	200.000 VMED O2 UK FINANCING 4.25 20-31 31/01S	24.738.869
25.000 W.R. GRACE HOLDINGS 4.875 21-27 15/06S	3.399.825	変動利付債	24.913.897
50.000 WASH MULTIFAMILY ACQ 5.75 21-26 15/04S	6.852.646	カナダ	3.012.789
75.000 WEEKLEY HOMES LLC 4.875 20-28 15/09S	9.980.061	25.000 INTELLIGENT PACKAGING FL.R 20-26 15/01S	3.012.789
50.000 WHEEL PROS ESCROW ISS 6.500 21-29 15/05S	2.250.183	アメリカ	21.901.108
50.000 WHITE CAP BUYER 6.875 20-28 15/10S	6.849.495	88.155 AMC ENTERTAINMENT HO FL.R 20-26 15/06S	10.812.439
75.000 WILLIAMS SCOTSMAN 4.6250 20-28 15/08S	10.029.654	62.604 EXELA INTERMEDIATE FL.R 23-26 15/04S	1.549.786
75.000 WINNEBAGO INDUS 6.2500 20-28 15/07S	10.510.767	50.862 WERNER FINCO LP WERNE FL.R 23-28 15/10S	6.005.452
25.000 WORLD ACCEPTANCE CORP 7.00 21-26 01/11S	3.197.976	25.000 WHITE CAPITAL PARENT FL.R 21-26 15/03S	3.533.431
25.000 WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625 21-29 15/08S	3.117.790	合計	5.990.960.574
32.000 WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	4.493.771		
75.000 WYNN RESORTS FINANCE 5.125 19-29 01/10S	9.992.266		
50.000 XEROX HOLDINGS CORP 5.00 20-25 15/08S	6.916.690		
25.000 XEROX HOLDINGS CORP 5.50 20-28 15/08S	3.184.284		
25.000 XHR LP 4.875 21-29 01/06S	3.247.979		
25.000 XHR LP 6.375 20-25 15/08S	3.527.594		
50.000 XPO INC 6.2500 23-28 01/06S	7.175.426		
25.000 XPO INC 7.125 23-32 01/02S	3.637.917		
75.000 YUM BRANDS 5.375 22-32 01/04S	10.429.995		
22.000 ZIFF DAVIS INC 4.625 20-30 15/10S	2.840.862		
フランス	47.964.723		
200.000 ALTICE FRANCE SA 5.125 21-29 15/07S	21.984.422		
200.000 ALTICE FRANCE SA 8.1250 18-27 01/02S	25.980.301		
ケイマン諸島	74.605.637		
41.667 AMERICAN AIRLINES 5.5 21-26 24/03Q	5.831.308		
100.000 AMERICAN AIRLINES 5.75 21-29 20/04Q	13.788.116		
131.343 GLOBAL AIRCRAFT 6.50 19-24 15/09S	17.493.170		
50.000 HAWAIIAN BRAND 5.75 21-26 20/01Q 04/02Q	6.668.107		
25.000 SEAGATE HDD CAYMAN 4.091 21-29 01/06S	3.270.829		
64.000 SEAGATE HDD CAYMAN 4.125 20-31 15/01S	8.103.784		
88.800 SEAGATE HDD CAYMAN 9.625 22-32 01/12S	14.328.329		
14.960 SPIRIT LOYALTY 8.0000 20-25 20/09Q	1.519.573		

■外国為替取引〔N D F〕（2023年12月31日現在）

					評 価 損 益
買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	円
ブラジルリアル	209,888,630.00	米ドル	42,500,000.00	2024／2／2	89,274,911
ブラジルリアル	4,967,353.00	米ドル	1,000,000.00	2024／2／2	2,934,897
合計					92,209,808

C A 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17期 》

決算日：2024年 2 月15日

（計算期間：2023年 2 月16日～2024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 比 率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
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
17期（2024年 2 月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495

（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		債券組入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2023年 2 月15日	円 10,027	% —	% 74.3
2 月末	10,027	0.0	74.3
3 月末	10,027	0.0	71.0
4 月末	10,027	0.0	72.1
5 月末	10,027	0.0	73.6
6 月末	10,027	0.0	73.9
7 月末	10,026	△0.0	75.4
8 月末	10,026	△0.0	65.4
9 月末	10,025	△0.0	67.0
10月末	10,024	△0.0	65.9
11月末	10,020	△0.1	69.2
12月末	10,020	△0.1	71.6
2024年 1 月末	10,020	△0.1	74.6
(期 末) 2024年 2 月15日	10,020	△0.1	70.8

(注) 騰落率は期首比です。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	第 17 期 (2023年 2 月16日 ～2024年 2 月15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)	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	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 (そ の 他)	1 (1)	0.012 (0.012)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	0.023	

期中の平均基準価額は10,024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（2023年 2 月16日から2024年 2 月15日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	地 方 債 証 券	千円 351,475	千円 — (350,000)

- (注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。
(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（2023年 2 月16日から2024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139回共同発行市場公募地方債	150,810		
第134回共同発行市場公募地方債	100,353		
第137回共同発行市場公募地方債	50,289		
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	50,023		

- (注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。
(注2) 単位未満は切捨てです。
(注3) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月16日から2024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（2024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	2024 年 2 月 15 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
地 方 債 証 券	千円 350,000	千円 350,832	% 70.8	% —	% —	% —	% 70.8
合 計	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8

(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) ー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	2024 年 2 月 15 日 現 在			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
地 方 債 証 券		%	千円	千円	
	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,178	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,143	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,511	2024/10/25
	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	0.001	50,000	50,000	2024/8/28
合 計			350,000	350,832	

(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 (2024年 2 月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	350,832	70.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	144,454	29.2
投 資 信 託 財 産 総 額	495,286	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

2024年 2 月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	495,286,649円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	143,608,953
公 社 債(評価額)	350,832,500
未 収 利 息	452,737
前 払 費 用	392,459
(B) 負 債	59,852
未 払 信 託 報 酬	53,488
未 払 利 息	424
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	495,226,797
元 本	494,224,101
次 期 繰 越 損 益 金	1,002,696
(D) 受 益 権 総 口 数	494,224,101口
1 万口当たり基準価額(C／D)	10,020円

(注記事項)
期首元本額 472,090,843円
期中追加設定元本額 134,248,238円
期中一部解約元本額 112,114,980円

■損益の状況

当期 自2023年 2 月16日 至2024年 2 月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,811,835円
受 取 利 息	1,905,211
支 払 利 息	△ 93,376
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,019,533
売 買 益	146,041
売 買 損	△ 2,165,574
(C) 信 託 報 酬 等	△ 113,341
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 321,039
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 683,574
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	(17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
(G) 計 (D＋E＋F)	1,002,696
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G＋H)	1,002,696
追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	(17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
分 配 準 備 積 立 金	6,793,356
繰 越 損 益 金	△ 7,797,969

(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。