

## ■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	2013年10月11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／メキシコペソ買いの為替取引を行う、「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」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（メキシコペソコース）	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ） CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）	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  
（メキシコペソコース）運用報告書（全体版）  
第19作成期

第109期	（決算日	2022年11月8日）
第110期	（決算日	2022年12月8日）
第111期	（決算日	2023年1月10日）
第112期	（決算日	2023年2月8日）
第113期	（決算日	2023年3月8日）
第114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/>

&lt;2860259・2871338&gt;

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■最近5作成期の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額 (分配落)				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			
		円	円	円	%	%	%	百万円
第15作成期	85期 (2020年11月9日)	3,037		45	3.5	0.0	97.7	839
	86期 (2020年12月8日)	3,214		45	7.3	0.0	97.7	872
	87期 (2021年1月8日)	3,188		45	0.6	0.0	96.8	857
	88期 (2021年2月8日)	3,216		45	2.3	0.0	97.6	773
	89期 (2021年3月8日)	3,086		45	△2.6	0.0	97.9	738
	90期 (2021年4月8日)	3,278		45	7.7	0.0	95.6	771
第16作成期	91期 (2021年5月10日)	3,282		45	1.5	0.0	95.7	755
	92期 (2021年6月8日)	3,284		45	1.4	0.0	97.6	746
	93期 (2021年7月8日)	3,302		45	1.9	0.0	97.5	729
	94期 (2021年8月10日)	3,224		45	△1.0	0.0	97.7	694
	95期 (2021年9月8日)	3,242		45	2.0	0.0	97.5	679
	96期 (2021年10月8日)	3,131		45	△2.0	0.0	97.5	654
第17作成期	97期 (2021年11月8日)	3,206		45	3.8	0.0	97.3	677
	98期 (2021年12月8日)	3,049		45	△3.5	0.0	98.0	639
	99期 (2022年1月11日)	3,153		45	4.9	0.0	97.5	628
	100期 (2022年2月8日)	3,023		45	△2.7	0.0	97.4	604
	101期 (2022年3月8日)	2,867		45	△3.7	0.1	97.1	555
	102期 (2022年4月8日)	3,172		45	12.2	0.0	97.4	614
第18作成期	103期 (2022年5月9日)	3,181		45	1.7	0.0	92.9	614
	104期 (2022年6月8日)	3,302		45	5.2	0.0	96.8	637
	105期 (2022年7月8日)	3,066		45	△5.8	0.0	96.6	597
	106期 (2022年8月8日)	3,173		30	4.5	0.0	97.0	592
	107期 (2022年9月8日)	3,332		30	6.0	0.0	96.4	617
	108期 (2022年10月11日)	3,264		30	△1.1	0.0	97.8	599
第19作成期	109期 (2022年11月8日)	3,367		30	4.1	0.0	98.5	611
	110期 (2022年12月8日)	3,191		30	△4.3	0.1	97.7	580
	111期 (2023年1月10日)	3,204		30	1.3	0.1	97.6	576
	112期 (2023年2月8日)	3,252		30	2.4	0.1	97.0	586
	113期 (2023年3月8日)	3,495		30	8.4	0.0	96.8	630
	114期 (2023年4月10日)	3,391		30	△2.1	0.0	96.7	612

(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（メキシコペソコース）

## ■ 当作成期中の基準価額等の推移

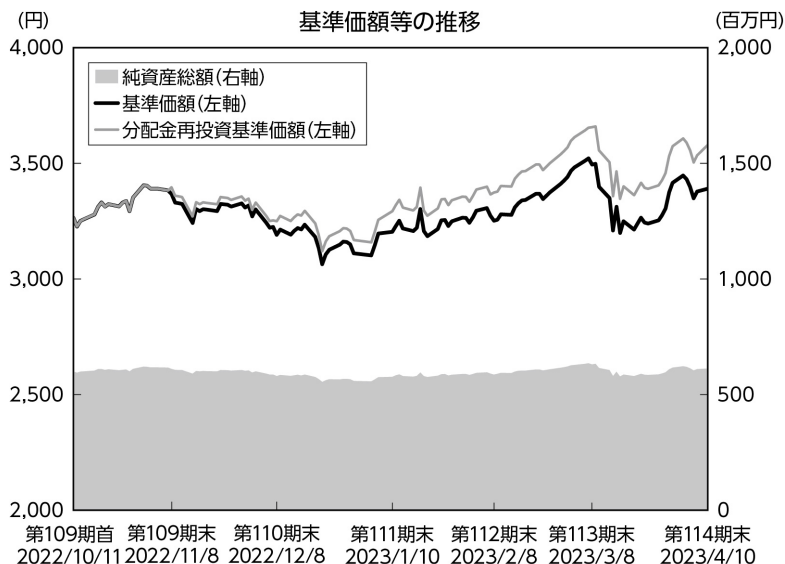
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
			%		
第109期	(期 首)2022年10月11日	円 3,264	%	%	%
	10月末	3,405	-	0.0	97.8
	(期 末)2022年11月8日	3,397	4.3	0.0	98.7
第110期	(期 首)2022年11月8日	3,367	4.1	0.0	98.5
	11月末	3,318	-	0.0	98.5
	(期 末)2022年12月8日	3,221	△1.5	0.1	98.2
第111期	(期 首)2022年12月8日	3,191	△4.3	0.1	97.7
	12月末	3,111	-	0.1	97.7
	(期 末)2023年1月10日	3,234	△2.5	0.1	98.2
第112期	(期 首)2023年1月10日	3,204	1.3	0.1	97.6
	1月末	3,264	-	0.1	97.6
	(期 末)2023年2月8日	3,282	1.9	0.1	97.5
第113期	(期 首)2023年2月8日	3,252	2.4	0.1	97.0
	2月末	3,425	-	0.0	97.0
	(期 末)2023年3月8日	3,525	5.3	0.0	97.1
第114期	(期 首)2023年3月8日	3,495	8.4	0.0	96.8
	3月末	3,416	-	0.0	96.8
	(期 末)2023年4月10日	3,421	△2.3	0.0	97.2
			△2.1	0.0	96.7

(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（メキシコペソコース）

## 【基準価額等の推移】

第109期首	3,264円
第114期末	3,391円
既払分配金 (税込み)	180円
騰落率	9.7% (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、メキシコペソ高・円安傾向となったこと
- ③米ドル売り／メキシコペソ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月頃にかけて、メキシコペソ安・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

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

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、メキシコペソ／円相場は7円台前半で始まり、メキシコ銀行（中央銀行）は米国の利上げに追随するなか、やや上昇して始まりました。その後、米国のインフレの鈍化などを背景にメキシコペソは下落しました。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、メキシコペソは下落する動きが継続しました。年が明け、メキシコ銀行への利上げ継続期待が高まるとメキシコペソは上昇し、その後の市場予想を上回る利上げや、強い米雇用統計などを材料に堅調に推移しました。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、メキシコペソは下落した後、7円台前半で当作成期末を迎えました。

## <日本の短期国債市場>

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

## 【ポートフォリオ】

### <当ファンド>

当ファンドは、米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする外国籍投資信託「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」に投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」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）

### <ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）>

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（メキシコペソコース）

米ドル建資産に対し、米ドル売り／メキシコペソ買いの為替取引を行い、当作成期を通じてメキシコペソ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「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」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)

### <ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）>

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／メキシコペソ買いの為替取引を継続いたします。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

## <CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第109期～第114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 )	16円 ( 6 ) ( 9 )  ( 1 )	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	16	0.485	

期中の平均基準価額は3,323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。

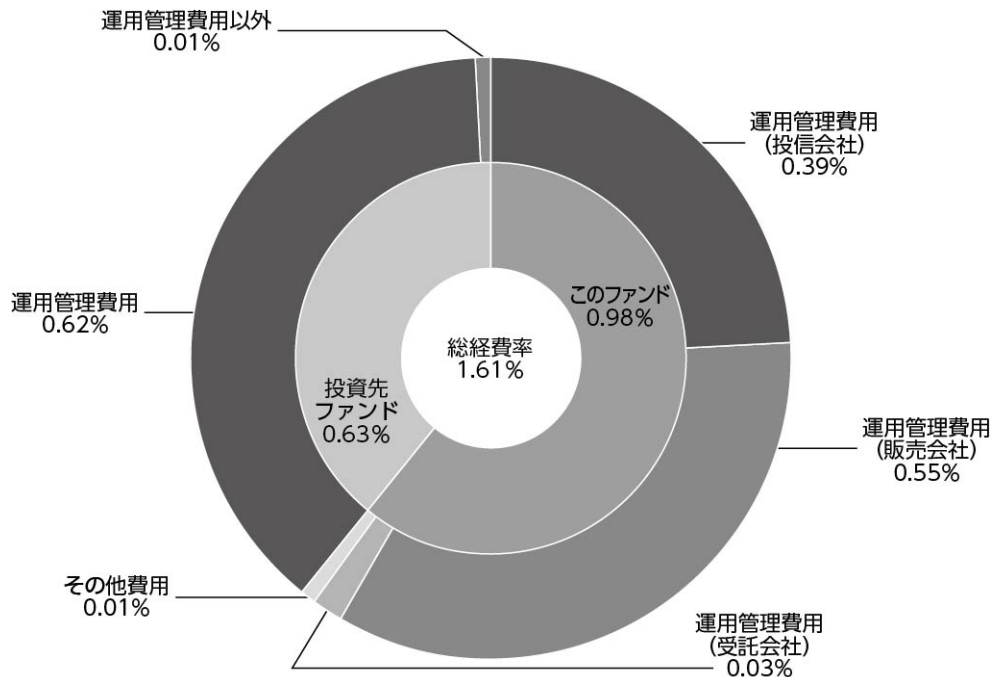
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## （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（メキシコペソコース）

## ■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 109 期 ～ 第 114 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク) ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (IH13シェアクラス、メキシコペソ)	1,500	千メキシコペソ 502	2,000	千メキシコペソ 680

(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18作成期末 (第108期末)	第19作成期末（第114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）		294,275	294,275	千円 295
合 計	口 数 ・ 金 額	294,275	294,275	295
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	<0.0%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

### (2) 外国（外貨建）投資証券

銘 柄		第18作成期末 (第108期末)	第19作成期末（第114期末）		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ルクセンブルク) ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド (IH13シェアクラス、メキシコペソ)		240,886	240,386	千メキシコペソ 80,902	千円 592,332
合 計	口 数 ・ 金 額	240,886	240,386	80,902	592,332
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<96.7%>

(注) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■投資信託財産の構成（2023年4月10日現在）

項 目	第 19 作 成 期 末 (第 114 期 末)	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 295	% 0.0
投 資 証 券	592,332	95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	25,999	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	618,626	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（592,332千円）の投資信託財産総額（618,626千円）に対する比率は95.7%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年4月10日現在における邦貨換算レートは、1メキシコペソ=7.3216円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第 109 期 末 (2022年11月8日)	第 110 期 末 (2022年12月8日)	第 111 期 末 (2023年1月10日)	第 112 期 末 (2023年2月8日)	第 113 期 末 (2023年3月8日)	第 114 期 末 (2023年4月10日)
(A) 資 産	620,609,766円	586,974,356円	582,874,774円	592,722,379円	636,436,566円	618,626,005円
コール・ローン等	17,873,359	19,036,829	19,302,042	22,927,908	25,738,532	25,998,187
投資信託受益証券(評価額)	295,187	295,128	294,981	295,069	295,098	295,069
投資証券(評価額)	602,441,220	567,642,399	563,277,751	569,499,402	610,402,936	592,332,749
(B) 負 債	9,084,501	6,217,640	5,917,924	5,884,409	5,890,714	5,976,411
未払収益分配金	5,448,593	5,460,296	5,401,732	5,413,735	5,412,799	5,420,243
未払解約金	3,178,482	268,405	—	—	—	—
未払信託報酬	452,489	478,879	500,670	450,348	452,627	525,284
未払利息	48	—	55	—	76	—
その他未払費用	4,889	10,060	15,467	20,326	25,212	30,884
(C) 純資産総額(A-B)	611,525,265	580,756,716	576,956,850	586,837,970	630,545,852	612,649,594
元 本	1,816,197,785	1,820,098,955	1,800,577,338	1,804,578,391	1,804,266,398	1,806,747,825
次期繰越損益金	△1,204,672,520	△1,239,342,239	△1,223,620,488	△1,217,740,421	△1,173,720,546	△1,194,098,231
(D) 受 益 権 総 口 数	1,816,197,785口	1,820,098,955口	1,800,577,338口	1,804,578,391口	1,804,266,398口	1,806,747,825口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,367円	3,191円	3,204円	3,252円	3,495円	3,391円

(注記事項)

作成期首元本額 1,836,988,605円

作成期中追加設定元本額 58,103,282円

作成期中一部解約元本額 88,344,062円

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■損益の状況

項 目	第109期 自2022年10月12日 至2022年11月8日	第110期 自2022年11月9日 至2022年12月8日	第111期 自2022年12月9日 至2023年1月10日	第112期 自2023年1月11日 至2023年2月8日	第113期 自2023年2月9日 至2023年3月8日	第114期 自2023年3月9日 至2023年4月10日
(A) 配 当 等 收 益	9,030,231円	8,353,776円	8,228,805円	8,282,050円	9,045,140円	8,799,117円
受 取 配 当 金	9,030,867	8,354,390	8,229,761	8,283,108	9,056,706	8,800,518
支 払 利 息	△ 636	△ 614	△ 956	△ 1,058	△ 11,566	△ 1,401
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,475,388	△ 34,489,418	105,730	6,121,527	40,622,563	△ 21,605,425
売 買 益	18,126,355	13,299,289	4,070,432	6,144,963	53,274,340	17,022
売 買 損	△ 2,650,967	△ 47,788,707	△ 3,964,702	△ 23,436	△ 12,651,777	△ 21,622,447
(C) 信 託 報 酬 等	△ 457,497	△ 484,315	△ 506,199	△ 455,714	△ 457,831	△ 531,251
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	24,048,122	△ 26,619,957	7,828,336	13,947,863	49,209,872	△ 13,337,559
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 10,903,251	7,681,372	△ 23,983,831	△ 21,437,987	△ 12,839,596	30,873,402
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,212,368,798	△ 1,214,943,358	△ 1,202,063,261	△ 1,204,836,562	△ 1,204,678,023	△ 1,206,213,831
(配当等相当額)	( 219,409,036)	( 221,596,027)	( 221,642,266)	( 225,206,276)	( 227,031,981)	( 229,021,667)
(売買損益相当額)	(△1,431,777,834)	(△1,436,539,385)	(△1,423,705,527)	(△1,430,042,838)	(△1,431,710,004)	(△1,435,235,498)
(G) 計 (D+E+F)	△ 1,199,223,927	△ 1,233,881,943	△ 1,218,218,756	△ 1,212,326,686	△ 1,168,307,747	△ 1,188,677,988
(H) 収 益 分 配 金	△ 5,448,593	△ 5,460,296	△ 5,401,732	△ 5,413,735	△ 5,412,799	△ 5,420,243
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 1,204,672,520	△ 1,239,342,239	△ 1,223,620,488	△ 1,217,740,421	△ 1,173,720,546	△ 1,194,098,231
追加信託差損益金	(△ 1,212,368,798)	(△ 1,214,943,358)	(△ 1,202,063,261)	(△ 1,204,836,562)	(△ 1,204,678,023)	(△ 1,206,213,831)
(配当等相当額)	( 219,409,036)	( 221,596,027)	( 221,642,266)	( 225,206,276)	( 227,031,981)	( 229,021,667)
(売買損益相当額)	(△1,431,777,834)	(△1,436,539,385)	(△1,423,705,527)	(△1,430,042,838)	(△1,431,710,004)	(△1,435,235,498)
分配準備積立金	405,980,339	407,546,977	403,100,969	403,534,015	405,151,107	406,880,294
繰 越 損 益 金	△ 398,284,061	△ 431,945,858	△ 424,658,196	△ 416,437,874	△ 374,193,630	△ 394,764,694

(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109期計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,861,643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（219,409,036円）および分配準備積立金（402,567,289円）より分配対象収益は630,837,968円（10,000口当たり3,473円）であり、うち5,448,593円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第110期計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,869,461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（221,596,027円）および分配準備積立金（405,137,812円）より分配対象収益は634,603,300円（10,000口当たり3,486円）であり、うち5,460,296円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第111期計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,729,035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（221,642,266円）および分配準備積立金（400,773,666円）より分配対象収益は630,144,967円（10,000口当たり3,499円）であり、うち5,401,732円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第112期計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,020,014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（225,206,276円）および分配準備積立金（400,927,736円）より分配対象収益は634,154,026円（10,000口当たり3,514円）であり、うち5,413,735円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第113期計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,961,769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（227,031,981円）および分配準備積立金（401,602,137円）より分配対象収益は637,595,887円（10,000口当たり3,533円）であり、うち5,412,799円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第114期計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,267,866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（229,021,667円）および分配準備積立金（404,032,671円）より分配対象収益は641,322,204円（10,000口当たり3,549円）であり、うち5,420,243円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
1万口当たりの分配金（税込み）	30円	30円	30円	30円	30円	30円

### ◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しております。

### ◇分配金を再投資する場合

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

## 【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
	(2022年10月12日 ～2022年11月8日)	(2022年11月9日 ～2022年12月8日)	(2022年12月9日 ～2023年1月10日)	(2023年1月11日 ～2023年2月8日)	(2023年2月9日 ～2023年3月8日)	(2023年3月9日 ～2023年4月10日)
当期分配金	30	30	30	30	30	30
（対基準価額比率）	(0.883%)	(0.931%)	(0.928%)	(0.914%)	(0.851%)	(0.877%)
当期の収益	30	30	30	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,443	3,456	3,469	3,484	3,503	3,519

（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」の決算日（毎年12月末日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2023年4月6日現在の情報を掲載しています。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2023年4月6日現在）

債券

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

（注）通貨欄の表記は以下の通りです。

USD（米ドル）

■外国為替先物契約（IH13シェアクラス、メキシコペソ）（2023年4月6日現在）

買 建	契約額	売 建	契約額	満 期 日	評 価 損 益 米ドル
メキシコペソ	81,700,000.00	米ドル	4,386,374.88	2023/6/2	45,898.77
				合計	45,898.77

## < 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。

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

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

■費用の明細 (2022年1月1日～2022年12月31日)

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

■純資産計算書 (2022年12月31日現在)

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

■有価証券明細 (2022年12月31日現在)

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



ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

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

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

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

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

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

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

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



ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド

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

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

■外国為替先物契約（IH13シェアクラス、メキシコペソ）（2022年12月31日現在）

買 建	契約額	売 建	契約額	満 期 日	評 価 損 益 米ドル
メキシコペソ	81,700,000.00	米ドル	4,142,128.02	2023/2/2	25,645.78
				合計	25,645.78

## 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 総
		税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率		
12期（2019年2月15日）	円	円	%	%	百万円
12期（2019年2月15日）	10,055	0	△0.1	59.0	763
13期（2020年2月17日）	10,048	0	△0.1	61.1	788
14期（2021年2月15日）	10,042	0	△0.1	64.6	773
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473

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



## ■ 当期中の基準価額等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

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

期中の平均基準価額は10,031円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ■売買及び取引の状況（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

## 公社債

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

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■主要な売買銘柄（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

## 公社債

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

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれておりません。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

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

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細（2023年2月15日現在）

## 公社債

## (A) 債券種類別開示

## 国内（邦貨建）公社債

区分	当			期				末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			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
1万口当たり基準価額(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。