

運用報告書 (全体版)

MHAMUSハイールドファンド (毎月決算型)

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6月30日から2024年6月7日までです。	
運用方針	米国の米国ドル建てのハイールド債に投資し、信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。	
主要投資対象	MHAMUSハイールドファンド (毎月決算型)	LA米国ドル建てハイールド債マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、債券に直接投資する場合があります。
	LA米国ドル建てハイールド債マザーファンド	主として米国の米国ドル建てのハイールド債に投資します。
運用方法	LA米国ドル建てハイールド債マザーファンド受益証券を通じて、米国の米国ドル建てのハイールド債に投資を行います。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 LA米国ドル建てハイールド債マザーファンドの運用指図に関する権限はロード・アベット・アンド・カンパニーエルエルシーに委託します。	
組入制限	MHAMUSハイールドファンド (毎月決算型)	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	LA米国ドル建てハイールド債マザーファンド	外貨建資産への投資には制限を設けません。 株式への投資は信託財産の純資産総額の20%以内とします。
分配方針	第4期以降、原則として毎月7日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、原則として安定した収益分配を継続的に行うことを目指し、委託会社が基準価額の水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

第145期	<決算日	2021年7月7日>
第146期	<決算日	2021年8月10日>
第147期	<決算日	2021年9月7日>
第148期	<決算日	2021年10月7日>
第149期	<決算日	2021年11月8日>
第150期	<決算日	2021年12月7日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAMUSハイールドファンド(毎月決算型)」は、2021年12月7日に第150期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

MHAM USハイイールドファンド（毎月決算型）

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			ICE BofA・US・キャッシュ・ペイ・ハイイールド・インデックス(円ベース)		公社債組入比率	純資産総額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
第21作成期	第121期(2019年7月8日)	円 7,614	円 65	% 2.4	ポイント 272.79	% 2.0	% 92.3	百万円 963
	第122期(2019年8月7日)	7,363	65	△2.4	265.31	△2.7	92.1	915
	第123期(2019年9月9日)	7,441	65	1.9	271.45	2.3	91.2	924
	第124期(2019年10月7日)	7,313	65	△0.8	269.90	△0.6	91.6	881
	第125期(2019年11月7日)	7,467	65	3.0	277.93	3.0	93.4	885
第22作成期	第126期(2019年12月9日)	7,428	65	0.3	278.31	0.1	91.0	842
	第127期(2020年1月7日)	7,513	45	1.8	283.33	1.8	91.8	832
	第128期(2020年2月7日)	7,632	45	2.2	288.27	1.7	91.1	817
	第129期(2020年3月9日)	6,865	45	△9.5	260.49	△9.6	92.9	711
	第130期(2020年4月7日)	6,152	45	△9.7	242.05	△7.1	91.1	634
第23作成期	第131期(2020年5月7日)	6,406	45	4.9	250.56	3.5	92.1	662
	第132期(2020年6月8日)	7,066	45	11.0	278.06	11.0	92.6	720
	第133期(2020年7月7日)	6,847	45	△2.5	269.87	△2.9	92.8	690
	第134期(2020年8月7日)	6,990	45	2.7	276.10	2.3	92.1	687
	第135期(2020年9月7日)	7,050	45	1.5	278.85	1.0	93.3	684
第24作成期	第136期(2020年10月7日)	6,974	45	△0.4	277.25	△0.6	92.7	670
	第137期(2020年11月9日)	6,906	45	△0.3	275.61	△0.6	93.4	650
	第138期(2020年12月7日)	7,084	45	3.2	284.94	3.4	91.2	623
	第139期(2021年1月7日)	7,057	45	0.3	285.22	0.1	90.9	605
	第140期(2021年2月8日)	7,270	45	3.7	295.05	3.4	91.8	628
第25作成期	第141期(2021年3月8日)	7,330	45	1.4	301.18	2.1	93.6	637
	第142期(2021年4月7日)	7,435	45	2.0	308.01	2.3	93.9	624
	第143期(2021年5月7日)	7,392	45	0.0	308.33	0.1	92.7	619
	第144期(2021年6月7日)	7,419	45	1.0	310.75	0.8	94.1	599
	第145期(2021年7月7日)	7,527	45	2.1	317.63	2.2	92.4	583
第25作成期	第146期(2021年8月10日)	7,439	45	△0.6	316.63	△0.3	93.3	584
	第147期(2021年9月7日)	7,443	45	0.7	318.24	0.5	91.2	582
	第148期(2021年10月7日)	7,461	25	0.6	321.02	0.9	91.4	567
	第149期(2021年11月8日)	7,662	25	3.0	330.05	2.8	90.8	562
	第150期(2021年12月7日)	7,504	25	△1.7	326.69	△1.0	93.1	521

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「公社債組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) ICE BofA・US・キャッシュ・ペイ・ハイイールド・インデックス(円ベース)は、同米ドルベース(出所:ICE Data Indices, LLC(使用許諾済))をもとに当社が独自に円換算したものです。なお、指数算出にあたっては基準価額への反映を考慮して前営業日の米ドルベースの指数値を当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算し、設定日(2009年6月30日)を100として指数化しています(以下同)。

(注4) ICE Data Indices, LLC(ICE Data)、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、明示又は黙示のいずれかを問わず、インデックス、インデックス・データ、及びそれらに含まれ、関連し、又は派生する一切のデータを含めて、商品性又は特定の目的若しくは使用への適合性の保証を含む一切の表明及び保証を否認します。ICE Data、その関係会社又はそれらの第三者サプライヤーは、インデックス、インデックス・データ若しくはそれらの構成要素の適切性、正確性、適時性又は完全性について、なんら損害賠償又は責任を負わず、インデックス、インデックス・データ及びそれらの全ての構成要素は、現状有姿において提供されるものであり、自らの責任において使用いただくものです。ICE Data、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、アセットマネジメントOne(株)又はその製品若しくはサービスを後援、推薦又は推奨するものではありません(以下同)。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同)。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

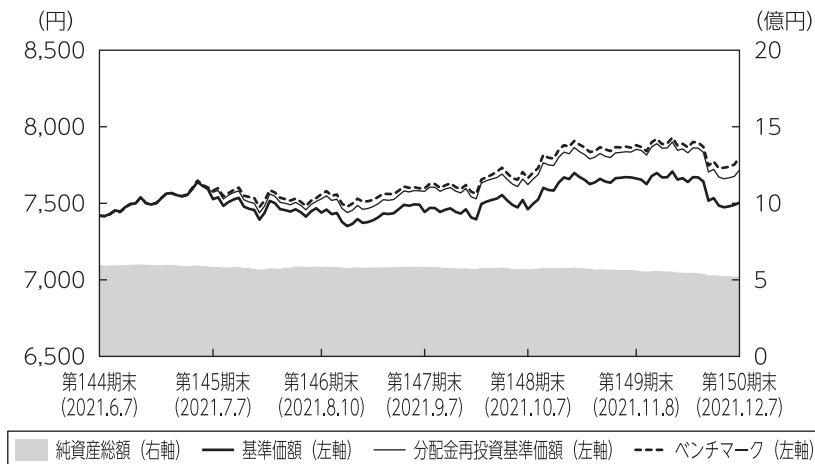
決算期	年 月 日	基 準 価 額		ICE BofA・US・キャッシュ・ ペイ・ハイイールド・ インデックス(円ベース)		公 社 債 組入比率
			騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
第145期	(期首)	円	%	ポイント	%	%
	2021年6月7日	7,419	-	310.75	-	94.1
	6月末	7,554	1.8	316.56	1.9	92.4
第146期	(期末)					
	2021年7月7日	7,572	2.1	317.63	2.2	92.4
	(期首)					
第147期	2021年7月7日	7,527	-	317.63	-	92.4
	7月末	7,446	△1.1	314.87	△0.9	92.5
	(期末)					
第148期	2021年8月10日	7,484	△0.6	316.63	△0.3	93.3
	(期首)					
	2021年8月10日	7,439	-	316.63	-	93.3
第149期	8月末	7,462	0.3	317.61	0.3	92.9
	(期末)					
	2021年9月7日	7,488	0.7	318.24	0.5	91.2
第150期	(期首)					
	2021年9月7日	7,443	-	318.24	-	91.2
	9月末	7,554	1.5	323.88	1.8	91.7
第151期	(期末)					
	2021年10月7日	7,486	0.6	321.02	0.9	91.4
	(期首)					
第152期	2021年10月7日	7,461	-	321.02	-	91.4
	10月末	7,634	2.3	328.41	2.3	92.1
	(期末)					
第153期	2021年11月8日	7,687	3.0	330.05	2.8	90.8
	(期首)					
	2021年11月8日	7,662	-	330.05	-	90.8
第154期	11月末	7,534	△1.7	325.57	△1.4	92.0
	(期末)					
	2021年12月7日	7,529	△1.7	326.69	△1.0	93.1

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「公社債組入比率」は実質比率を記載しております。

■第145期～第150期の運用経過 (2021年6月8日から2021年12月7日まで)

基準価額等の推移



第145期首：7,419円
第150期末：7,504円
(既払分配金210円)
騰落率：4.0%
(分配金再投資ベース)

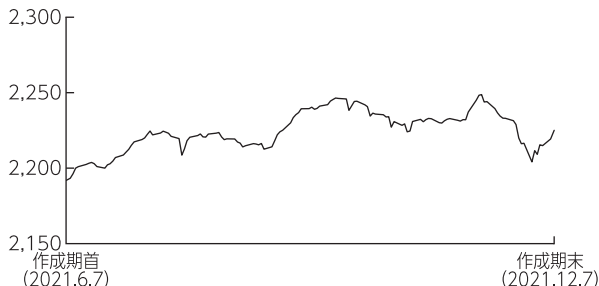
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

「LA米国ドル建てハイイールド債マザーファンド」受益証券への投資を通じて米国ハイイールド債に投資した結果、米ドルが対円で上昇したことなどから、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

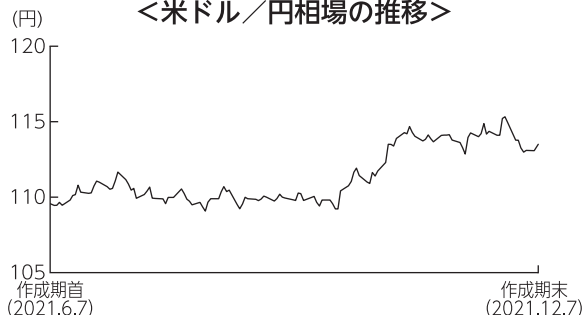
投資環境

<米国ハイイールド債（米ドルベース）の推移>



(注) 米国ハイイールド債（米ドルベース）は、ICE BofA・US・キャッシュ・ペイ・ハイイールド・インデックス（米ドルベース）です。

<米ドル／円相場の推移>



米国ハイイールド債市場は、上昇しました。

2021年8月にかけては、米国で金融緩和が当面続くとの見方などから上昇しました。8月下旬以降も、原油価格の上昇を受け上昇基調が継続しました。11月に入り、米金融政策の早期正常化観測が広がったことや新型コロナウイルスの新たな変異株の出現などから下落に転じましたが、作成期末にかけては、一部値を戻しました。

対米国国債スプレッドは、当作成期を通じて拡大しました。

米ドルは対円で上昇しました。2021年9月中旬にかけては、米金融政策に対する思惑や新型コロナウイルスの感染拡大状況等をにらみ一進一退で推移しましたが、その後は米金融政策の早期正常化観測に伴う米国金利の上昇の動きにつれ上昇しました。作成期末にかけては新型コロナウイルスの新たな変異株の出現などから反落し、上昇幅を一部縮小しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

「L A米国ドル建てハイイールド債マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。なお、組入外貨建資産に対しては、為替ヘッジを行いませんでした。

●L A米国ドル建てハイイールド債マザーファンド

格付別構成比率では、B B格やB格を中心に保有しました。ベンチマーク対比（決算日時点）では、B B格やB格をアンダーウェイト、C C C格をオーバーウェイトとしました。

業種別構成比率では、エネルギーや素材などの比率を高めとしました。ベンチマーク対比では、素材やエネルギーなどをオーバーウェイトにした一方、通信をアンダーウェイトとしました。

債券の組入比率は高位を維持しました。

組入外貨資産に対して為替ヘッジは行いませんでした。

作成期末

【組入上位10銘柄】

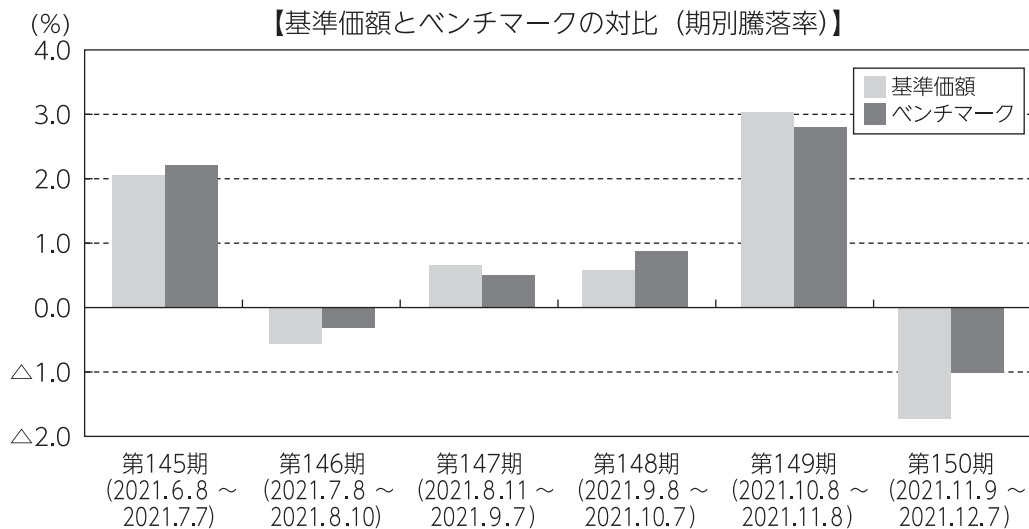
No.	銘柄	クーポン (%)	償還日	格付け	組入比率 (%)
1	SPRINT CAPITAL CORP 6.875 11/15/28	6.875	2028/11/15	BB	0.8
2	HCA INC 7.5 12/15/23	7.500	2023/12/15	BB-	0.7
3	OCCIDENTAL PETROLEUM COR 3.5 08/15/29	3.500	2029/08/15	BB	0.6
4	MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN 6.0 08/01/26	6.000	2026/08/01	B	0.5
5	OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	6.125	2031/01/01	BB	0.5
6	FORD MOTOR COMPANY 4.75 01/15/43	4.750	2043/01/15	BB	0.5
7	FORD MOTOR COMPANY 3.25 02/12/32	3.250	2032/02/12	BB	0.4
8	MATADOR RESOURCES CO 5.875 09/15/26	5.875	2026/09/15	B	0.4
9	PEABODY ENERGY CORP 6.375 03/31/25	6.375	2025/03/31	D	0.4
10	MEG ENERGY CORP 7.125 02/01/27	7.125	2027/02/01	B-	0.4

(注1) 組入比率は、マザーファンドの公社債現物に対する比率を表しています。

(注2) 格付けはS & P、Moody'sのうち、低いほうの格付けを採用しています。(表記法はS & Pに準拠)

ベンチマークとの差異について

「L A米国ドル建てハイイールド債マザーファンド」受益証券への投資を通じて米国ハイイールド債市場に投資した結果、基準価額の騰落率（分配金再投資ベース）は、ベンチマークを1.1%下回る結果となりました。主に銘柄選択などがマイナスに影響しました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当作成期の収益分配金は、安定した収益分配を継続的に行うことを目指し、基準価額の水準および市場動向等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期	第150期
	2021年6月8日 ～2021年7月7日	2021年7月8日 ～2021年8月10日	2021年8月11日 ～2021年9月7日	2021年9月8日 ～2021年10月7日	2021年10月8日 ～2021年11月8日	2021年11月9日 ～2021年12月7日
当期分配金（税引前）	45円	45円	45円	25円	25円	25円
対基準価額比率	0.59%	0.60%	0.60%	0.33%	0.33%	0.33%
当期の収益	31円	25円	25円	25円	25円	25円
当期の収益以外	13円	19円	19円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	459円	440円	421円	422円	431円	433円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

「L A米国ドル建てハイイールド債マザーファンド」の組入れを高位に維持する方針です。また、組入外貨建資産に対して、為替ヘッジを行いません。

●L A米国ドル建てハイイールド債マザーファンド

米国ハイイールド債を主要投資対象とし、信託財産の成長と安定した収益の確保を目指します。

引き続き定性分析・定量分析に市場環境分析を加え、良質な資産と優良な経営陣を持つ企業を重点的に抽出し、的確な銘柄選択に努めることによりリターンを追求して参ります。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第145期～第150期 (2021年6月8日 ～2021年12月7日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	58円	
(投信会社)	(33)	(0.444)	
(販売会社)	(23)	(0.305)	
(受託会社)	(2)	(0.027)	
(b) 有価証券取引税	0	0.000	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	2	0.023	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(2)	(0.020)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	60	0.800	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって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。なお、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

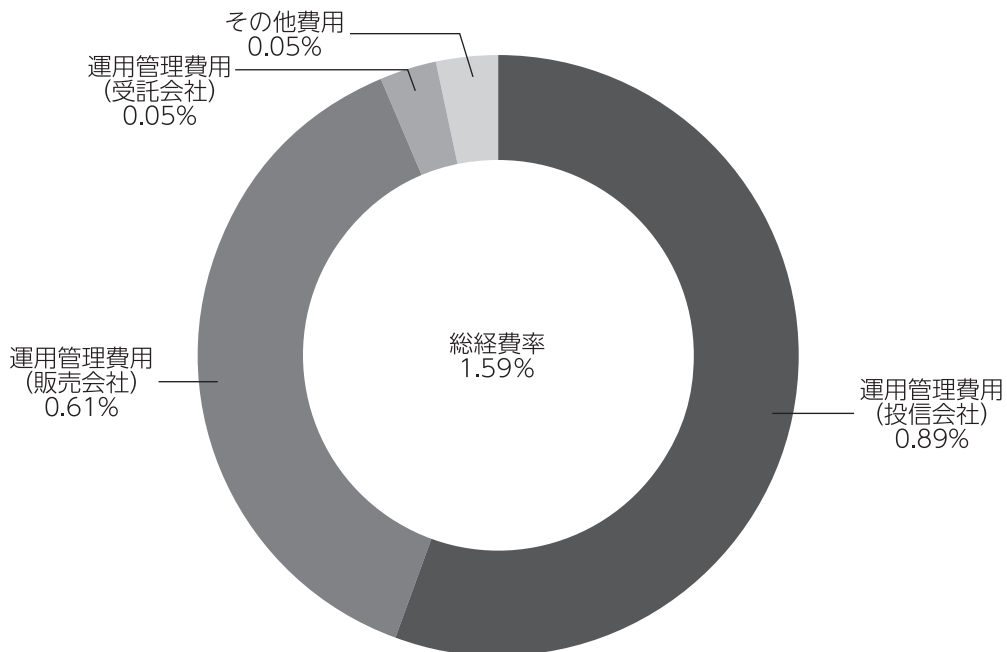
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.59%です。



(注1) 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) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年6月8日から2021年12月7日まで）

	第 145 期 ~ 第 150 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
LA米国ドル建てハイイールド債マザーファンド	千口 1,609	千円 6,000	千口 29,658	千円 113,000

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 145 期 ~ 第 150 期
	LA米国ドル建てハイイールド債マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	427,285千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	317,261千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	1.34

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年6月8日から2021年12月7日まで）

期中の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

親投資信託残高

	第24作成期末	第25作成期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
LA米国ドル建てハイイールド債マザーファンド	千口 162,250	千口 134,201	千円 517,506

■投資信託財産の構成

2021年12月7日現在

項 目	第25作成期末	
	評 価 額	比 率
L A 米国ドル建てハイイールド債マザーファンド	千円 517,506	% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,738	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	528,245	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末のL A米国ドル建てハイイールド債マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、108,669,099千円、98.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年12月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年7月7日)、 (2021年8月10日)、 (2021年9月7日)、 (2021年10月7日)、 (2021年11月8日)、 (2021年12月7日)現在

項 目	第145期末	第146期末	第147期末	第148期末	第149期末	第150期末
(A) 資 産	589,917,736円	590,339,038円	586,386,420円	570,341,542円	566,922,100円	528,245,026円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,518,428	12,379,907	3,923,380	828,068	3,603,957	10,738,328
L A 米国ドル建てハイイールド債マザーファンド(評価額)	574,399,308	577,959,131	573,463,040	557,513,474	553,318,143	517,506,698
未 収 入 金	8,000,000	-	9,000,000	12,000,000	10,000,000	-
(B) 負 債	6,707,399	6,011,860	4,210,700	2,634,451	3,942,924	7,042,893
未 払 収 益 分 配 金	3,486,870	3,534,648	3,519,734	1,902,255	1,836,951	1,736,493
未 払 解 約 金	2,465,154	1,645,066	1,040	5	1,332,926	4,639,906
未 払 信 託 報 酬	753,619	830,211	688,323	730,487	771,251	664,947
そ の 他 未 払 費 用	1,756	1,935	1,603	1,704	1,796	1,547
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	583,210,337	584,327,178	582,175,720	567,707,091	562,979,176	521,202,133
元 本	774,860,019	785,477,334	782,163,272	760,902,345	734,780,458	694,597,238
次 期 繰 越 損 益 金	△191,649,682	△201,150,156	△199,987,552	△193,195,254	△171,801,282	△173,395,105
(D) 受 益 権 総 口 数	774,860,019口	785,477,334口	782,163,272口	760,902,345口	734,780,458口	694,597,238口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,527円	7,439円	7,443円	7,461円	7,662円	7,504円

(注) 第144期末における元本額は807,471,392円、当作成期間(第145期~第150期)中における追加設定元本額は40,178,693円、同解約元本額は153,052,847円です。

■損益の状況

[自 2021年6月8日 至 2021年7月7日] [自 2021年7月8日 至 2021年8月10日] [自 2021年8月11日 至 2021年9月7日] [自 2021年9月8日 至 2021年10月7日] [自 2021年10月8日 至 2021年11月8日] [自 2021年11月9日 至 2021年12月7日]

項 目	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期	第150期
(A)配 当 等 収 益	△126円	△321円	△145円	△36円	△138円	△156円
受 取 利 息	1	8	3	1	2	2
支 払 利 息	△127	△329	△148	△37	△140	△158
(B)有価証券売買損益	12,581,541	△2,321,017	4,523,994	3,991,700	17,336,063	△8,588,355
売 買 益	12,853,315	89,879	4,514,505	4,084,420	17,804,669	193,432
売 買 損	△271,774	△2,410,896	9,489	△92,720	△468,606	△8,781,787
(C)信 託 報 酬 等	△755,375	△832,146	△689,926	△732,191	△773,047	△666,494
(D)当期損益金(A + B + C)	11,826,040	△3,153,484	3,833,923	3,259,473	16,562,878	△9,255,005
(E)前期繰越損益金	△40,641,351	△30,589,807	△35,480,994	△32,604,532	△30,073,758	△14,445,212
(F)追加信託差損益金	△159,347,501	△163,872,217	△164,820,747	△161,947,940	△156,453,451	△147,958,395
(配当等相当額)	(36,669,448)	(36,124,046)	(34,491,456)	(32,052,202)	(30,957,719)	(29,271,561)
(売買損益相当額)	(△196,016,949)	(△199,996,263)	(△199,312,203)	(△194,000,142)	(△187,411,170)	(△177,229,956)
(G)合 計(D + E + F)	△188,162,812	△197,615,508	△196,467,818	△191,292,999	△169,964,331	△171,658,612
(H)収 益 分 配 金	△3,486,870	△3,534,648	△3,519,734	△1,902,255	△1,836,951	△1,736,493
次期繰越損益金(G + H)	△191,649,682	△201,150,156	△199,987,552	△193,195,254	△171,801,282	△173,395,105
追加信託差損益金	△160,386,294	△165,409,234	△166,369,589	△161,947,940	△156,453,451	△147,958,395
(配当等相当額)	(35,635,749)	(34,637,600)	(32,947,834)	(32,057,877)	(30,961,834)	(29,280,494)
(売買損益相当額)	(△196,022,043)	(△200,046,834)	(△199,317,423)	(△194,005,817)	(△187,415,285)	(△177,238,889)
分配準備積立金	-	-	-	122,518	709,997	839,704
繰 越 損 益 金	△31,263,388	△35,740,922	△33,617,963	△31,369,832	△16,057,828	△26,276,414

(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。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用は、第145期から第150期まではL A米国ドル建てハイイールド債マザーファンド1,080,016円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期	第150期
(a)経費控除後の配当等収益	2,448,077円	1,997,631円	1,970,892円	2,024,773円	2,429,032円	1,907,957円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c)収 益 調 整 金	36,674,542	36,174,617	34,496,676	32,057,877	30,961,834	29,280,494
(d)分 配 準 備 積 立 金	0	0	0	0	117,916	668,240
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	39,122,619	38,172,248	36,467,568	34,082,650	33,508,782	31,856,691
(f)1万口当たり当期分配対象額	504.90	485.98	466.24	447.92	456.04	458.64
(g)分 配 金	3,486,870	3,534,648	3,519,734	1,902,255	1,836,951	1,736,493
(h)1万口当たり分配金	45	45	45	25	25	25

■分配金のお知らせ

決算期	第145期	第146期	第147期	第148期	第149期	第150期
1万口当たり分配金	45円	45円	45円	25円	25円	25円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

LA米国ドル建てハイイールド債マザーファンド

運用報告書

第35期（決算日 2021年12月7日）

（計算期間 2021年6月8日～2021年12月7日）

LA米国ドル建てハイイールド債マザーファンドの第35期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2004年6月30日から無期限です。
運用方針	主として米国の米国ドル建てのハイイールド債に投資し、信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要投資対象	米国の米国ドル建ての高利回り債（ハイイールド債）を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には制限を設けません。 株式への投資は信託財産の純資産総額の20%以内とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ICE BofA・US・キャッシュ・ペイ・ハイイールド・インデックス(円ベース)		公社債組入比率	純資産総額
		期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
	円	%	ポイント	%	%	百万円
第31期 (2019年12月9日)	32,025	5.1	300.31	4.1	92.4	122,251
第32期 (2020年6月8日)	31,936	△0.3	300.04	△0.1	93.5	109,301
第33期 (2020年12月7日)	33,545	5.0	307.46	2.5	92.6	104,224
第34期 (2021年6月7日)	36,767	9.6	335.31	9.1	94.5	107,121
第35期 (2021年12月7日)	38,562	4.9	352.51	5.1	93.8	109,347

(注1) ICE BofA・US・キャッシュ・ペイ・ハイイールド・インデックス(円ベース)は、同米ドルベース(出所:ICE Data Indices, LLC(使用許諾済))をもとに当社が独自に円換算したものです。なお、指数算出にあたっては基準価額への反映を考慮して前営業日の米ドルベースの指数値を当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算し、設定日の前営業日(2004年6月29日)を100として指数化しています(以下同じ)。

(注2) ICE Data Indices, LLC(「ICE Data」)、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、明示又は黙示のいずれかを問わず、インデックス、インデックス・データ、及びそれらに含まれ、関連し、又は派生する一切のデータを含めて、商品性又は特定の目的若しくは使用への適合性の保証を含む一切の表明及び保証を否認します。ICE Data、その関係会社又はそれらの第三者サプライヤーは、インデックス、インデックス・データ若しくはそれらの構成要素の適切性、正確性、適時性又は完全性について、なんら損害賠償又は責任を負わず、インデックス、インデックス・データ及びそれらの全ての構成要素は、現状有姿において提供されるものであり、自らの責任において使用いただくものです。ICE Data、その関係会社及びそれらの第三者サプライヤーは、アセットマネジメントOne(株)又はその製品若しくはサービスを後援、推薦又は推奨するものではありません(以下同じ)。

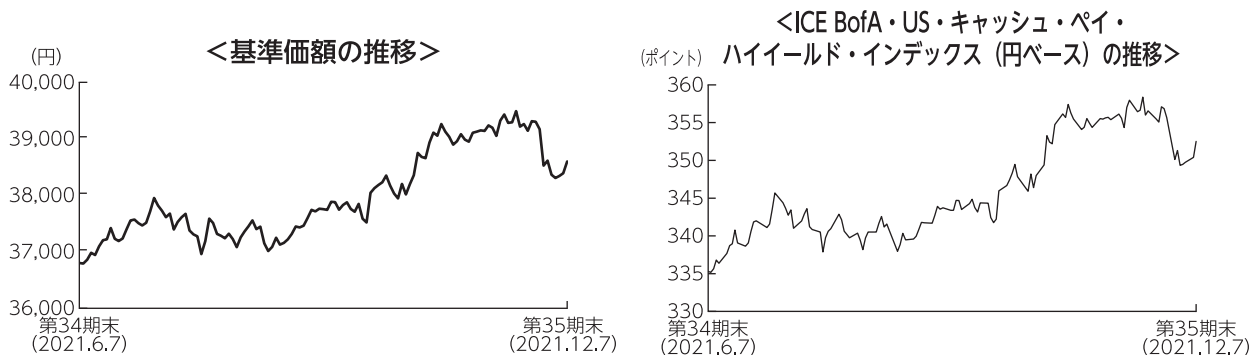
(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ICE BofA・US・キャッシュ・ ペイ・ハイイールド・ インデックス(円ベース)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
(期 首)	円	%	ポイント	%	%
2021年 6 月 7 日	36,767	－	335.31	－	94.5
6 月 末	37,478	1.9	341.58	1.9	93.6
7 月 末	37,203	1.2	339.76	1.3	94.0
8 月 末	37,562	2.2	342.71	2.2	93.5
9 月 末	38,314	4.2	349.48	4.2	92.6
10 月 末	38,913	5.8	354.37	5.7	93.1
11 月 末	38,578	4.9	351.30	4.8	92.3
(期 末)					
2021年12月 7 日	38,562	4.9	352.51	5.1	93.8

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過 (2021年6月8日から2021年12月7日まで)



基準価額の推移

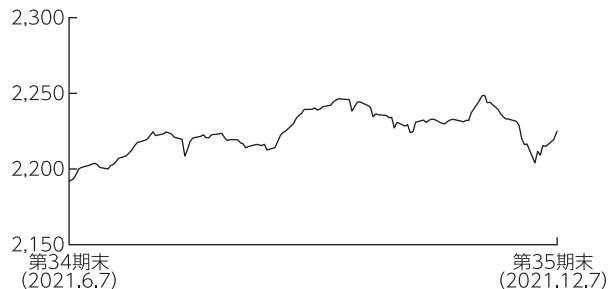
当ファンドの基準価額は、前期末比で4.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として米国の米ドル建てのハイイールド債に投資を行った結果、米ドルが対円で上昇したことから上昇しました。

投資環境

<米国ハイイールド債（米ドルベース）の推移>



(注) 米国ハイイールド債（米ドルベース）は、ICE BofA・US・キャッシュ・ペイ・ハイイールド・インデックス（米ドルベース）です。

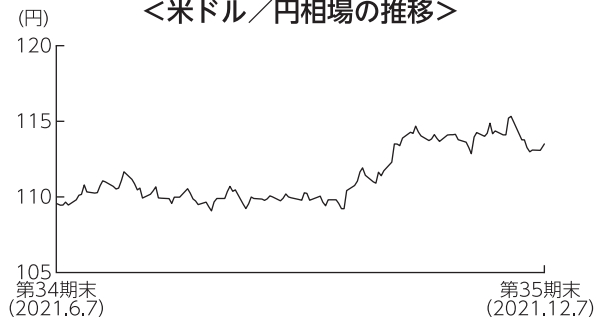
米国ハイイールド債市場は、上昇しました。

2021年8月にかけては、米国で金融緩和が当面続くとの見方などから上昇しました。8月下旬以降も、原油価格の上昇を受け上昇基調が継続しました。11月に入り、米金融政策の早期正常化観測が広がったことや新型コロナウイルスの新たな変異株の出現などから下落に転じましたが、作成期末にかけては、一部値を戻しました。

対米国国債スプレッドは、当作成期を通じて拡大しました。

米ドルは対円で上昇しました。2021年9月中旬にかけては、米金融政策に対する思惑や新型コロナウイルスの感染拡大状況等をにらみ一進一退で推移しましたが、その後は米金融政策の早期正常化観測に伴う米国金利の上昇の動きにつれ上昇しました。作成期末にかけては新型コロナウイルスの新たな変異株の出現などから反落し、上昇幅を一部縮小しました。

<米ドル／円相場の推移>



ポートフォリオについて

格付別構成比率では、B B格やB格を中心に保有しました。ベンチマーク対比（決算日時点）では、B B格やB格をアンダーウェイト、C C C格をオーバーウェイトとしました。
業種別構成比率では、エネルギーや素材などの比率を高めとしました。ベンチマーク対比では、素材やエネルギーなどをオーバーウェイトにした一方、通信をアンダーウェイトとしました。
債券の組入比率は高位を維持しました。
組入外貨資産に対して為替ヘッジは行いませんでした。

期末

【組入上位10銘柄】

No.	銘柄	クーポン (%)	償還日	格付け	組入比率 (%)
1	SPRINT CAPITAL CORP 6.875 11/15/28	6.875	2028/11/15	BB	0.8
2	HCA INC 7.5 12/15/23	7.500	2023/12/15	BB-	0.7
3	OCCIDENTAL PETROLEUM COR 3.5 08/15/29	3.500	2029/08/15	BB	0.6
4	MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN 6.0 08/01/26	6.000	2026/08/01	B	0.5
5	OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	6.125	2031/01/01	BB	0.5
6	FORD MOTOR COMPANY 4.75 01/15/43	4.750	2043/01/15	BB	0.5
7	FORD MOTOR COMPANY 3.25 02/12/32	3.250	2032/02/12	BB	0.4
8	MATADOR RESOURCES CO 5.875 09/15/26	5.875	2026/09/15	B	0.4
9	PEABODY ENERGY CORP 6.375 03/31/25	6.375	2025/03/31	D	0.4
10	MEG ENERGY CORP 7.125 02/01/27	7.125	2027/02/01	B-	0.4

(注1) 組入比率は、マザーファンドの公社債現物に対する比率を表しています。

(注2) 格付けはS & P、Moody'sのうち、低いほうの格付けを採用しています。(表記法はS & Pに準拠)

ベンチマークとの差異について

米国ハイイールド債市場に投資した結果、基準価額の騰落率は、ベンチマークを0.2%下回る結果となりました。主に銘柄選択などがマイナスに影響しました。

今後の運用方針

米国ハイイールド債を主要投資対象とし、信託財産の成長と安定した収益の確保を目指します。
引き続き定性分析・定量分析に市場環境分析を加え、良質な資産と優良な経営陣を持つ企業を重点的に抽出し、的確な銘柄選択に努めることによりリターンを追求して参ります。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 有価証券取引税 (株式)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	8 (8) (0)	0.021 (0.020) (0.001)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	8	0.021	
期中の平均基準価額は37,959円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月8日から2021年12月7日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 457.5 (-)	千アメリカ・ドル 2,976 (-)	百株 101,502.74	千アメリカ・ドル 878

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 新株予約権付社債（転換社債）

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外 国	ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 51,983	千アメリカ・ドル 80,543	千アメリカ・ドル 47,211 (-)	千アメリカ・ドル 72,354 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は予約権行使による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 212	千アメリカ・ドル 317 (-)
		特殊債券	200	2,169 (4,393)
		社債券	346,487	322,115 (23,875)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	426,380千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	317,261千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	1.34

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等(2021年6月8日から2021年12月7日まで)

期中の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

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
UC HOLDINGS INC	399.41	399.41	409	46,466	自動車部品	
PENSON TECHNOLOGIES LLC CLASS A	101,419.74	-	-	-	各種金融サービス	
99 CENTS ONLY STORES COMMON UNITS	241,108.66	241,108.66	241	27,365	専門小売り	
99 CENTS ONLY STORES A PFD	24,593.08	24,593.08	24	2,791	専門小売り	
99 CENTS ONLY STORES B PFD	98,372.33	98,372.33	98	11,165	専門小売り	
NEXTERA ENERGY INC PFD 6.219	-	374.5	2,076	235,690	電力	
合計	株数・金額 465,893.22	株数・金額 364,847.98	2,850	323,478		
	銘柄数<比率> 5銘柄	銘柄数<比率> 5銘柄	-	<0.3%>		

(注1) PFDは優先証券です。

(注2) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注3) < >内は、期末の純資産総額に対する株式評価額の比率です。

(注4) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(2) 外国新株予約権付社債（転換社債）

銘 柄	当 期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円
BENTLEY SYSTEMS INC 0.125 01/15/	822	842	95,629
IH MERGER SUB LLC 3.5 01/15/22	610	1,132	128,562
LIBERTY MEDIA CORP 1.0 01/30/23	718	1,215	137,981
IIP OPERATING PARTNER 3.75 02/21	278	1,086	123,353
FORD MOTOR COMPANY 03/15/26	1,435	1,869	212,141
WINNEBAGO INDUSTRIES 1.5 04/01/2	1,430	1,926	218,705
BILL.COM HOLDINGS INC 04/01/27	888	869	98,711
DICK'S SPORTING GOODS 3.25 04/15	280	920	104,456
ON SEMICONDUCTOR CORP 05/01/27	1,037	1,426	161,907
JOHN BEAN TECHNOLOGIES C 0.25 05	879	997	113,185
TESLA INC 2.0 05/15/24	204	3,315	376,282
NEW RELIC INC 0.5 05/01/23	1,605	1,842	209,146
ATLAS AIR WORLDWIDE HLDG 1.875 0	1,012	1,560	177,170
LIVENT CORP 4.125 07/15/25	398	1,290	146,428
UPSTART HOLDINGS INC 0.25 08/15/	1,017	1,037	117,788
CLOUDFLARE INC 08/15/26	1,687	1,834	208,270
SOLAR EDGE TECHNOLOGIES 09/15/25	714	939	106,687
MIDDLEBY CORP 1.0 09/01/25	815	1,186	134,671
ANTERO RESOURCES CORP 4.25 09/01	419	1,631	185,139
SHOPIFY INC 0.125 11/01/25	1,073	1,322	150,082
UNITY SOFTWARE INC 11/15/26	1,463	1,341	152,246
CHART INDUSTRIES INC 1.0 11/15/2	724	2,086	236,838
GRANITE CONSTRUCTION INC 2.75 11	1,404	1,950	221,341
CRYOPORT INC 0.75 12/01/26	1,489	1,430	162,349
合 計	額 面 ・ 金 額	22,401	35,057
	銘 柄 数<比率>	24銘柄	-
			3,979,078
			<3.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨ててあります。

(3) 公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 885,394	千アメリカ・ドル 903,793	千円 102,580,590	% 93.8	% 88.8	% 68.0	% 24.5	% 1.3
合 計	-	-	千円 102,580,590	93.8	88.8	68.0	24.5	1.3

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の中値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注3) 無格付銘柄については、BB格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末						
	種 類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
REPUBLIC OF SRI LANKA 5.875 07/25/22	国 債 証 券	5.8750	1,344	944	107,162	2022/07/25	
COMMONWEALTH OF BAHAMAS 8.95 10/15/32	国 債 証 券	8.9500	1,273	1,202	136,540	2032/10/15	
NOVA CHEMICALS CORP 4.25 05/15/29	特 殊 債 券	4.2500	999	987	112,118	2029/05/15	
CITGO HOLDING INC 9.25 08/01/24	特 殊 債 券	9.2500	938	922	104,739	2024/08/01	
BUCKEYE PARTNERS LP 01/22/78	社 債 券	6.3750	2,340	2,054	233,132	2078/01/22	
TRANSOCEAN GUARDIAN LTD 5.875 01/15/24	社 債 券	5.8750	1,203	1,135	128,879	2024/01/15	
UNITED RENTALS NORTH AM 4.875 01/15/28	社 債 券	4.8750	581	609	69,141	2028/01/15	
FORD MOTOR COMPANY 4.75 01/15/43	社 債 券	4.7500	4,268	4,662	529,212	2043/01/15	
TERRAFORM POWER OPERATIN 5.0 01/31/28	社 債 券	5.0000	441	461	52,369	2028/01/31	
CENTENNIAL RESOURCE PROD 5.375 01/15/26	社 債 券	5.3750	3,793	3,724	422,721	2026/01/15	
CHURCHILL DOWNS INC 4.75 01/15/28	社 債 券	4.7500	2,326	2,397	272,078	2028/01/15	
SM ENERGY CO 6.625 01/15/27	社 債 券	6.6250	962	978	111,045	2027/01/15	
CHENIERE ENERGY PARTNERS 3.25 01/31/32	社 債 券	3.2500	1,091	1,088	123,504	2032/01/31	
REDE D'OR FINANCE SARL 4.95 01/17/28	社 債 券	4.9500	1,103	1,103	125,224	2028/01/17	
INTERNATIONAL GAME TECH 5.25 01/15/29	社 債 券	5.2500	1,334	1,400	158,963	2029/01/15	
TERRAFORM POWER OPERATIN 4.75 01/15/30	社 債 券	4.7500	931	945	107,286	2030/01/15	
COMPASS GROUP DIVERSIFIE 5.0 01/15/32	社 債 券	5.0000	1,171	1,177	133,701	2032/01/15	
UNITED RENTALS NORTH AM 3.75 01/15/32	社 債 券	3.7500	952	952	108,052	2032/01/15	
LAMAR MEDIA CORP 4.875 01/15/29	社 債 券	4.8750	938	977	110,975	2029/01/15	
TEXAS CAPITAL BANK NA 5.25 01/31/26	社 債 券	5.2500	1,611	1,750	198,628	2026/01/31	
EQT CORP 5.0 01/15/29	社 債 券	5.0000	974	1,073	121,866	2029/01/15	
SOUTHWESTERN ENERGY CO 01/23/25	社 債 券	6.4500	1,029	1,127	127,919	2025/01/23	
CNX RESOURCES CORP 6.0 01/15/29	社 債 券	6.0000	987	1,015	115,222	2029/01/15	
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE 5.75 01/30/28	社 債 券	5.7500	2,221	2,323	263,699	2028/01/30	
LBM ACQUISITION LLC 6.25 01/15/29	社 債 券	6.2500	3,847	3,747	425,354	2029/01/15	
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C 4.25 01/15/29	社 債 券	4.2500	998	969	110,093	2029/01/15	
RANGE RESOURCES CORP 8.25 01/15/29	社 債 券	8.2500	932	1,028	116,733	2029/01/15	
PRECISION DRILLING CORP 6.875 01/15/29	社 債 券	6.8750	955	939	106,677	2029/01/15	
LAREDO PETROLEUM INC 10.125 01/15/28	社 債 券	10.1250	3,135	3,219	365,401	2028/01/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.125 01/01/31	社 債 券	6.1250	4,021	4,730	536,869	2031/01/01	
TRANSDIGM INC 4.625 01/15/29	社 債 券	4.6250	1,492	1,452	164,904	2029/01/15	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
ENVIVA PARTNERS LP/FIN C 6.5 01/15/26	社 債 券	6.5000	2,674	2,767	314,065	2026/01/15	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY 4.625 01/15/27	社 債 券	4.6250	608	635	72,096	2027/01/15	
UBER TECHNOLOGIES INC 6.25 01/15/28	社 債 券	6.2500	1,176	1,258	142,846	2028/01/15	
NABORS INDUSTRIES LTD 7.25 01/15/26	社 債 券	7.2500	2,638	2,313	262,594	2026/01/15	
ARDONAGH MIDCO 2 PLC 11.5 01/15/27	社 債 券	11.5000	1,502	1,643	186,511	2027/01/15	
COMSTOCK RESOURCES INC 5.875 01/15/30	社 債 券	5.8750	1,582	1,592	180,728	2030/01/15	
FRONTIER COMMUNICATIONS 6.0 01/15/30	社 債 券	6.0000	967	968	109,884	2030/01/15	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 4.75 01/15/28	社 債 券	4.7500	998	995	112,991	2028/01/15	
BLACKSTONE MORTGAGE TR 3.75 01/15/27	社 債 券	3.7500	1,983	1,953	221,673	2027/01/15	
MEDCO BELL PTE LTD 6.375 01/30/27	社 債 券	6.3750	716	685	77,758	2027/01/30	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LT 5.2 01/16/27	社 債 券	5.2000	1,283	881	100,084	2027/01/16	
LIVE NATION ENTERTAINMEN 3.75 01/15/28	社 債 券	3.7500	1,954	1,932	219,283	2028/01/15	
LAREDO PETROLEUM INC 9.5 01/15/25	社 債 券	9.5000	417	422	47,983	2025/01/15	
PRECISION DRILLING CORP 7.125 01/15/26	社 債 券	7.1250	2,747	2,777	315,204	2026/01/15	
GUITAR CENTER ESCROW ISS 8.5 01/15/26	社 債 券	8.5000	1,395	1,481	168,152	2026/01/15	
MERCADOLIBRE INC 2.375 01/14/26	社 債 券	2.3750	1,528	1,472	167,150	2026/01/14	
LIFE TIME INC 5.75 01/15/26	社 債 券	5.7500	2,781	2,866	325,336	2026/01/15	
HAWAIIAN BRAND INTELLECT 5.75 01/20/26	社 債 券	5.7500	1,674	1,720	195,284	2026/01/20	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 4.1 02/15/47	社 債 券	4.1000	1,411	1,374	156,007	2047/02/15	
TOLL BROS FINANCE CORP 4.35 02/15/28	社 債 券	4.3500	3,244	3,535	401,327	2028/02/15	
CALPINE CORP 5.0 02/01/31	社 債 券	5.0000	977	964	109,426	2031/02/01	
DAVITA INC 3.75 02/15/31	社 債 券	3.7500	1,500	1,425	161,786	2031/02/15	
TARGA RESOURCES PARTNERS 4.875 02/01/31	社 債 券	4.8750	831	895	101,687	2031/02/01	
MSCI INC 3.875 02/15/31	社 債 券	3.8750	1,783	1,843	209,219	2031/02/15	
HILCORP ENERGY I/HILCORP 6.0 02/01/31	社 債 券	6.0000	952	962	109,267	2031/02/01	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS 4.75 02/15/31	社 債 券	4.7500	3,438	3,443	390,856	2031/02/15	
HOWARD HUGHES CORP 4.375 02/01/31	社 債 券	4.3750	645	649	73,699	2031/02/01	
MURPHY OIL USA INC 3.75 02/15/31	社 債 券	3.7500	1,268	1,223	138,913	2031/02/15	
WMG ACQUISITION CORP 3.0 02/15/31	社 債 券	3.0000	1,207	1,148	130,349	2031/02/15	
TEAM HEALTH HOLDINGS INC 6.375 02/01/25	社 債 券	6.3750	1,111	986	111,955	2025/02/01	
BERRY PETROLEUM CO LLC 7.0 02/15/26	社 債 券	7.0000	1,035	998	113,299	2026/02/15	
SYNOVUS FINANCIAL CORP 02/07/29	社 債 券	5.9000	3,348	3,564	404,572	2029/02/07	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.25 02/01/32	社 債 券	4.2500	2,656	2,731	310,070	2032/02/01	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 02/01/50	社 債 券	6.5000	755	875	99,403	2050/02/01	
OCEANEERING INTL INC 6.0 02/01/28	社 債 券	6.0000	2,490	2,453	278,437	2028/02/01	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 5.0 02/15/32	社 債 券	5.0000	739	751	85,345	2032/02/15	
FORD MOTOR COMPANY 3.25 02/12/32	社 債 券	3.2500	4,044	4,083	463,519	2032/02/12	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP 4.25 02/01/27	社 債 券	4.2500	1,984	1,966	223,235	2027/02/01	
JBS USA LUX/JBS USA FIN 6.75 02/15/28	社 債 券	6.7500	871	939	106,619	2028/02/15	
PRESIDIO HOLDING INC 4.875 02/01/27	社 債 券	4.8750	977	991	112,571	2027/02/01	
CALPINE CORP 4.625 02/01/29	社 債 券	4.6250	2,942	2,843	322,682	2029/02/01	
INSTALLED BUILDING PRODU 5.75 02/01/28	社 債 券	5.7500	1,453	1,513	171,820	2028/02/01	
MEG ENERGY CORP 7.125 02/01/27	社 債 券	7.1250	3,843	4,046	459,234	2027/02/01	
PATTERSON-UTI ENERGY INC 3.95 02/01/28	社 債 券	3.9500	1,502	1,484	168,520	2028/02/01	
HILCORP ENERGY I/HILCORP 5.75 02/01/29	社 債 券	5.7500	1,017	1,020	115,833	2029/02/01	
ANTERO RESOURCES CORP 7.625 02/01/29	社 債 券	7.6250	845	928	105,370	2029/02/01	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT 4.05 02/01/30	社 債 券	5.3000	2,218	2,397	272,146	2030/02/01	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.0 02/15/29	社 債 券	3.0000	2,910	2,822	320,384	2029/02/15	
ORTHO-CLINICAL INC/SA 7.25 02/01/28	社 債 券	7.2500	981	1,045	118,694	2028/02/01	
RADIOLOGY PARTNERS INC 9.25 02/01/28	社 債 券	9.2500	2,578	2,641	299,774	2028/02/01	
PARK RIVER HOLDINGS INC 5.625 02/01/29	社 債 券	5.6250	1,583	1,514	171,908	2029/02/01	
MEG ENERGY CORP 5.875 02/01/29	社 債 券	5.8750	1,625	1,654	187,809	2029/02/01	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
LIFEPOINT HEALTH INC 4.375 02/15/27	社 債 券	4.3750	1,401	1,392	158,025	2027/02/15	
REAL HERO MERGER SUB 2 6.25 02/01/29	社 債 券	6.2500	1,870	1,877	213,151	2029/02/01	
CASTLE US HOLDING CORP 9.5 02/15/28	社 債 券	9.5000	1,263	1,324	150,302	2028/02/15	
ARCONIC ROLLED PRODUCTS 6.125 02/15/28	社 債 券	6.1250	2,140	2,247	255,104	2028/02/15	
PETSMART INC/PETSMART FI 7.75 02/15/29	社 債 券	7.7500	1,033	1,123	127,475	2029/02/15	
RENT-A-CENTER INC 6.375 02/15/29	社 債 券	6.3750	1,117	1,150	130,575	2029/02/15	
BROOKFIELD RESID PROPERT 4.875 02/15/30	社 債 券	4.8750	993	995	113,013	2030/02/15	
DOWNSTREAM DEVELOPMENT 10.5 02/15/23	社 債 券	10.5000	1,923	2,002	227,261	2023/02/15	
SHEA HOMES LP/FNDG CP 4.75 02/15/28	社 債 券	4.7500	1,071	1,084	123,070	2028/02/15	
STL HOLDING CO LLC 7.5 02/15/26	社 債 券	7.5000	2,178	2,290	260,000	2026/02/15	
HECLA MINING CO 7.25 02/15/28	社 債 券	7.2500	1,740	1,856	210,676	2028/02/15	
COEUR MINING INC 5.125 02/15/29	社 債 券	5.1250	1,998	1,857	210,837	2029/02/15	
AMC NETWORKS INC 4.25 02/15/29	社 債 券	4.2500	958	943	107,090	2029/02/15	
NORTHRIVER MIDSTREAM FIN 5.625 02/15/26	社 債 券	5.6250	2,533	2,611	296,443	2026/02/15	
EQT CORP 02/01/25	社 債 券	6.6250	2,407	2,675	303,666	2025/02/01	
ZI TECH LLC/ZI FIN CORP 3.875 02/01/29	社 債 券	3.8750	1,018	1,000	113,514	2029/02/01	
SILGAN HOLDINGS INC 4.125 02/01/28	社 債 券	4.1250	916	937	106,422	2028/02/01	
HOWARD HUGHES CORP 4.125 02/01/29	社 債 券	4.1250	658	655	74,399	2029/02/01	
VALVOLINE INC 4.25 02/15/30	社 債 券	4.2500	967	971	110,273	2030/02/15	
LEGENDS HOSPITALITY HOLD 5.0 02/01/26	社 債 券	5.0000	948	958	108,844	2026/02/01	
CALIFORNIA RESOURCES CRP 7.125 02/01/26	社 債 券	7.1250	1,810	1,874	212,775	2026/02/01	
SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.375 02/01/29	社 債 券	5.3750	1,301	1,348	153,067	2029/02/01	
CENTENE CORP 3.375 02/15/30	社 債 券	3.3750	2,035	2,059	233,808	2030/02/15	
MOHEGAN GAMING & ENT 8.0 02/01/26	社 債 券	8.0000	2,775	2,798	317,587	2026/02/01	
ROCKET SOFTWARE INC 6.5 02/15/29	社 債 券	6.5000	320	304	34,565	2029/02/15	
URBAN ONE INC 7.375 02/01/28	社 債 券	7.3750	909	927	105,244	2028/02/01	
BRUNDAGE-BONE CONCRETE 6.0 02/01/26	社 債 券	6.0000	915	952	108,119	2026/02/01	
PENNYMAC FIN SVCS INC 4.25 02/15/29	社 債 券	4.2500	61	57	6,535	2029/02/15	
MERCER INTL INC 5.125 02/01/29	社 債 券	5.1250	116	115	13,107	2029/02/01	
EQT CORP 02/01/30	社 債 券	7.5000	1,175	1,495	169,703	2030/02/01	
TECHNIPFMC PLC 6.5 02/01/26	社 債 券	6.5000	651	696	79,082	2026/02/01	
GENTING NY LLC/GENNY CAP 3.3 02/15/26	社 債 券	3.3000	1,590	1,569	178,163	2026/02/15	
AETHON UN/AETHIN UN FIN 8.25 02/15/26	社 債 券	8.2500	1,776	1,878	213,184	2026/02/15	
TASEKO MINES LTD 7.0 02/15/26	社 債 券	7.0000	1,017	1,049	119,123	2026/02/15	
PETSMART INC/PETSMART FI 4.75 02/15/28	社 債 券	4.7500	1,214	1,244	141,233	2028/02/15	
FULL HOUSE RESORTS INC 8.25 02/15/28	社 債 券	8.2500	2,191	2,287	259,676	2028/02/15	
NORTHWEST FIBER LLC/NORT 6.0 02/15/28	社 債 券	6.0000	1,023	970	110,151	2028/02/15	
NABORS INDUSTRIES INC 5.75 02/01/25	社 債 券	5.7500	1,500	1,282	145,510	2025/02/01	
TURNING POINT BRANDS INC 5.625 02/15/26	社 債 券	5.6250	928	939	106,607	2026/02/15	
BOMBARDIER INC 6.0 02/15/28	社 債 券	6.0000	2,447	2,437	276,706	2028/02/15	
PARTY CITY HOLDINGS INC 8.75 02/15/26	社 債 券	8.7500	2,544	2,626	298,128	2026/02/15	
COLGATE ENERGY PARTNERS 7.75 02/15/26	社 債 券	7.7500	2,339	2,507	284,620	2026/02/15	
TOLL BROS FINANCE CORP 4.875 03/15/27	社 債 券	4.8750	1,708	1,893	214,938	2027/03/15	
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.45 03/15/43	社 債 券	5.4500	1,982	2,480	281,520	2043/03/15	
MACQUARIE BANK LONDON 03/08/27	社 債 券	6.1250	1,923	2,054	233,175	2027/03/08	
PEABODY ENERGY CORP 6.375 03/31/25	社 債 券	6.3750	4,473	4,072	462,201	2025/03/31	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 3.7 03/15/28	社 債 券	3.7000	2,873	2,603	295,498	2028/03/15	
TERRAFORM GLOBAL OPERATI 6.125 03/01/26	社 債 券	6.1250	1,801	1,842	209,153	2026/03/01	
LEVI STRAUSS & CO 3.5 03/01/31	社 債 券	3.5000	1,463	1,483	168,347	2031/03/01	
SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.125 03/15/24	社 債 券	6.1250	1,769	1,868	212,031	2024/03/15	
CIT GROUP INC 6.125 03/09/28	社 債 券	6.1250	2,054	2,426	275,409	2028/03/09	
CENTENE CORP 2.5 03/01/31	社 債 券	2.5000	2,019	1,963	222,895	2031/03/01	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.25 03/01/30	社 債 券	4.2500	1,477	1,552	176,253	2030/03/01	
WILLIAM CARTER 5.625 03/15/27	社 債 券	5.6250	929	957	108,710	2027/03/15	
TWILIO INC 3.875 03/15/31	社 債 券	3.8750	1,941	1,948	221,159	2031/03/15	
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP 5.5 03/01/25	社 債 券	5.5000	102	103	11,742	2025/03/01	
CLEARWAY ENERGY OP LLC 4.75 03/15/28	社 債 券	4.7500	816	863	98,029	2028/03/15	
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN 3.625 03/01/29	社 債 券	3.6250	962	954	108,378	2029/03/01	
AG ISSUER LLC 6.25 03/01/28	社 債 券	6.2500	1,086	1,117	126,882	2028/03/01	
NAVIENT CORP 5.0 03/15/27	社 債 券	5.0000	41	41	4,735	2027/03/15	
CHARLES RIVER LABORATORI 4.0 03/15/31	社 債 券	4.0000	1,027	1,045	118,613	2031/03/15	
KENNEDY-WILSON INC 4.75 03/01/29	社 債 券	4.7500	1,429	1,438	163,220	2029/03/01	
BLOCK COMMUNICATIONS INC 4.875 03/01/28	社 債 券	4.8750	1,389	1,399	158,846	2028/03/01	
FOUNDATION BUILDING M 6.0 03/01/29	社 債 券	6.0000	1,159	1,123	127,536	2029/03/01	
FORESTAR GROUP INC 5.0 03/01/28	社 債 券	5.0000	1,830	1,864	211,677	2028/03/01	
UNITED STATES STEEL CORP 6.875 03/01/29	社 債 券	6.8750	1,869	1,955	221,963	2029/03/01	
VISTA OUTDOOR INC 4.5 03/15/29	社 債 券	4.5000	1,239	1,240	140,795	2029/03/15	
COMSTOCK RESOURCES INC 6.75 03/01/29	社 債 券	6.7500	984	1,029	116,853	2029/03/01	
BANIYAJ ENTERTAINMENT 5.375 03/01/25	社 債 券	5.3750	1,080	1,110	126,091	2025/03/01	
TTM TECHNOLOGIES INC 4.0 03/01/29	社 債 券	4.0000	980	964	109,428	2029/03/01	
RESOLUTE FOREST PRODUCTS 4.875 03/01/26	社 債 券	4.8750	990	994	112,837	2026/03/01	
WHITE CAP PARENT LLC 03/15/26	社 債 券	8.2500	919	938	106,502	2026/03/15	
KAISER ALUMINUM CORP 4.625 03/01/28	社 債 券	4.6250	1,008	1,000	113,563	2028/03/01	
OWENS & MINOR INC 4.5 03/31/29	社 債 券	4.5000	1,081	1,105	125,439	2029/03/31	
GOODYEAR TIRE & RUBBER 4.875 03/15/27	社 債 券	4.8750	1,458	1,528	173,527	2027/03/15	
TWILIO INC 3.625 03/15/29	社 債 券	3.6250	2,419	2,446	277,642	2029/03/15	
AMERICAN AIRLINES GROUP 3.75 03/01/25	社 債 券	3.7500	2,440	2,239	254,210	2025/03/01	
PLAYTIKA HOLDING CORP 4.25 03/15/29	社 債 券	4.2500	1,449	1,400	158,930	2029/03/15	
US ACUTE CARE SOLUTIONS 6.375 03/01/26	社 債 券	6.3750	977	1,011	114,852	2026/03/01	
ALCOA NEDERLAND HOLDING 4.125 03/31/29	社 債 券	4.1250	2,047	2,108	239,267	2029/03/31	
CARNIVAL CORP 5.75 03/01/27	社 債 券	5.7500	983	964	109,454	2027/03/01	
CROCS INC 4.25 03/15/29	社 債 券	4.2500	1,953	1,976	224,291	2029/03/15	
PHH MORTGAGE CORP 7.875 03/15/26	社 債 券	7.8750	1,846	1,900	215,716	2026/03/15	
CPI CG INC 8.625 03/15/26	社 債 券	8.6250	217	229	26,088	2026/03/15	
BRISTOW GROUP INC 6.875 03/01/28	社 債 券	6.8750	1,445	1,459	165,696	2028/03/01	
AVIS BUDGET CAR/FINANCE 5.375 03/01/29	社 債 券	5.3750	560	579	65,782	2029/03/01	
ALBERTSONS COS/SAFeway 3.5 03/15/29	社 債 券	3.5000	3,697	3,667	416,216	2029/03/15	
SPCM SA 3.375 03/15/30	社 債 券	3.3750	1,083	1,040	118,149	2030/03/15	
KOSMOS ENERGY LTD 7.5 03/01/28	社 債 券	7.5000	1,772	1,635	185,657	2028/03/01	
NCL FINANCE LTD 6.125 03/15/28	社 債 券	6.1250	692	670	76,120	2028/03/15	
NAVIENT CORP 4.875 03/15/28	社 債 券	4.8750	365	361	41,074	2028/03/15	
VEDANTA RESOURCES 8.95 03/11/25	社 債 券	8.9500	1,988	1,932	219,348	2025/03/11	
RANGE RESOURCES CORP 5.0 03/15/23	社 債 券	5.0000	1,058	1,073	121,893	2023/03/15	
APACHE CORP 4.75 04/15/43	社 債 券	4.7500	3,143	3,414	387,600	2043/04/15	
NEWELL BRANDS INC 04/01/36	社 債 券	5.8750	1,878	2,301	261,232	2036/04/01	
NETFLIX INC 4.875 04/15/28	社 債 券	4.8750	2,951	3,375	383,100	2028/04/15	
COTY INC 6.5 04/15/26	社 債 券	6.5000	1,087	1,115	126,613	2026/04/15	
CHOBANI LLC/FINANCE CORP 7.5 04/15/25	社 債 券	7.5000	2,233	2,299	261,001	2025/04/15	
BUENA VISTA GAMING AUTH 13.0 04/01/23	社 債 券	13.0000	2,393	2,580	292,926	2023/04/01	
ORGANON FINANCE 1 LLC 5.125 04/30/31	社 債 券	5.1250	940	967	109,757	2031/04/30	
FMG RESOURCES AUG 2006 4.375 04/01/31	社 債 券	4.3750	910	927	105,254	2031/04/01	
HUDBAY MINERALS INC 6.125 04/01/29	社 債 券	6.1250	1,180	1,241	140,861	2029/04/01	
SHEA HOMES LP/FNDG CP 4.75 04/01/29	社 債 券	4.7500	1,049	1,059	120,269	2029/04/01	
ACADIA HEALTHCARE CO INC 5.0 04/15/29	社 債 券	5.0000	1,845	1,883	213,829	2029/04/15	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
SCIENCE APPLICATIONS INT 4.875 04/01/28	社 債 券	4.8750	1,143	1,174	133,325	2028/04/01	
MACY'S RETAIL HLDGS LLC 5.875 04/01/29	社 債 券	5.8750	1,771	1,892	214,777	2029/04/01	
TENNECO INC 5.125 04/15/29	社 債 券	5.1250	972	937	106,417	2029/04/15	
COMPASS GROUP DIVERSIFIE 5.25 04/15/29	社 債 券	5.2500	1,456	1,492	169,384	2029/04/15	
CENTENNIAL RESOURCE PROD 6.875 04/01/27	社 債 券	6.8750	3,153	3,174	360,298	2027/04/01	
CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO 7.75 04/15/28	社 債 券	7.7500	1,723	1,816	206,161	2028/04/15	
TRITON WATER HOLDINGS IN 6.25 04/01/29	社 債 券	6.2500	1,928	1,866	211,897	2029/04/01	
NESCO HOLDINGS II INC 5.5 04/15/29	社 債 券	5.5000	955	980	111,336	2029/04/15	
CENTURY ALUMINUM COMPANY 7.5 04/01/28	社 債 券	7.5000	842	890	101,040	2028/04/01	
TRINSEO OP / TRINSEO FIN 5.125 04/01/29	社 債 券	5.1250	1,281	1,289	146,319	2029/04/01	
NATIONAL CINEMEDIA LLC 5.875 04/15/28	社 債 券	5.8750	2,167	1,946	220,913	2028/04/15	
LIONS GATE CAPITAL HOLD 5.5 04/15/29	社 債 券	5.5000	1,142	1,167	132,526	2029/04/15	
OASIS MIDSTREAM PARTNERS 8.0 04/01/29	社 債 券	8.0000	1,130	1,204	136,719	2029/04/01	
DYCOM INDUSTRIES INC 4.5 04/15/29	社 債 券	4.5000	2,570	2,601	295,312	2029/04/15	
AVIS BUDGET CAR/FINANCE 4.75 04/01/28	社 債 券	4.7500	502	511	58,111	2028/04/01	
ARCOSA INC 4.375 04/15/29	社 債 券	4.3750	1,629	1,649	187,188	2029/04/15	
HUNT COS INC 5.25 04/15/29	社 債 券	5.2500	1,430	1,405	159,513	2029/04/15	
JPMORGAN CHASE & CO 04/01/25	社 債 券	4.0000	1,873	1,855	210,592	2025/04/01	
TMS INTERNATIONAL CORP 6.25 04/15/29	社 債 券	6.2500	935	941	106,831	2029/04/15	
INVEST ENERGY RES LTD 6.25 04/26/29	社 債 券	6.2500	955	1,005	114,137	2029/04/26	
BCPE ULYSSES INTERMEDIAT 04/01/27	社 債 券	7.7500	1,243	1,201	136,377	2027/04/01	
HIGHTOWER HOLDING LLC 6.75 04/15/29	社 債 券	6.7500	945	968	109,945	2029/04/15	
HUDBAY MINERALS INC 4.5 04/01/26	社 債 券	4.5000	1,194	1,177	133,694	2026/04/01	
NMG HLDGO/NEIMAN MARCUS 7.125 04/01/26	社 債 券	7.1250	1,532	1,612	183,010	2026/04/01	
CARVANA CO 5.5 04/15/27	社 債 券	5.5000	1,012	1,014	115,201	2027/04/15	
AMN HEALTHCARE INC 4.0 04/15/29	社 債 券	4.0000	920	930	105,576	2029/04/15	
ALTA EQUIPMENT GROUP 5.625 04/15/26	社 債 券	5.6250	1,391	1,421	161,341	2026/04/15	
MOZART DEBT MERGER SUB 3.875 04/01/29	社 債 券	3.8750	1,263	1,258	142,820	2029/04/01	
SOLARIS MIDSTREAM HOLDIN 7.625 04/01/26	社 債 券	7.6250	930	981	111,362	2026/04/01	
STAPLES INC 10.75 04/15/27	社 債 券	10.7500	1,455	1,341	152,241	2027/04/15	
WASH MULTIFAM ACQ INC 5.75 04/15/26	社 債 券	5.7500	996	1,032	117,179	2026/04/15	
SABRE GLBL INC 9.25 04/15/25	社 債 券	9.2500	872	978	111,086	2025/04/15	
COTY INC 5.0 04/15/26	社 債 券	5.0000	914	936	106,332	2026/04/15	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS 6.125 04/01/30	社 債 券	6.1250	3,865	3,779	428,943	2030/04/01	
STAPLES INC 7.5 04/15/26	社 債 券	7.5000	1,012	1,013	115,051	2026/04/15	
CNX MIDSTREAM PART LP 4.75 04/15/30	社 債 券	4.7500	964	957	108,634	2030/04/15	
LIFE TIME INC 8.0 04/15/26	社 債 券	8.0000	948	980	111,314	2026/04/15	
CATALENT PHARMA SOLUTION 3.5 04/01/30	社 債 券	3.5000	1,689	1,649	187,165	2030/04/01	
WEATHERFORD INTERNATIONA 8.625 04/30/30	社 債 券	8.6250	1,655	1,650	187,342	2030/04/30	
CALLON PETROLEUM CO 9.0 04/01/25	社 債 券	9.0000	2,020	2,163	245,595	2025/04/01	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 7.5 05/01/31	社 債 券	7.5000	401	510	57,922	2031/05/01	
TEXAS CAPITAL BANCSHARES 05/06/31	社 債 券	4.0000	1,578	1,644	186,602	2031/05/06	
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125 05/18/31	社 債 券	4.1250	933	921	104,613	2031/05/18	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/27	社 債 券	5.1250	2,894	2,996	340,047	2027/05/01	
MONG DUONG FIN HLDGS BV 5.125 05/07/29	社 債 券	5.1250	1,488	1,444	163,956	2029/05/07	
XPO CNW INC 6.7 05/01/34	社 債 券	6.7000	2,411	2,935	333,214	2034/05/01	
ASP AMC MERGER SUB 8.0 05/15/25	社 債 券	8.0000	3,725	3,052	346,514	2025/05/15	
SUGAR HSP GMNG PROP/FIN 5.875 05/15/25	社 債 券	5.8750	475	473	53,701	2025/05/15	
CHEMOURS CO 5.375 05/15/27	社 債 券	5.3750	876	912	103,578	2027/05/15	
AMSTED INDUSTRIES 4.625 05/15/30	社 債 券	4.6250	918	935	106,231	2030/05/15	
FAIR ISAAC CORP 5.25 05/15/26	社 債 券	5.2500	848	924	104,910	2026/05/15	
GRAY TELEVISION INC 7.0 05/15/27	社 債 券	7.0000	1,262	1,345	152,690	2027/05/15	

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
APERGY CORP 6.375 05/01/26	社 債 券	6.3750	833	869	98,661	2026/05/01
VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.5 05/15/29	社 債 券	5.5000	2,706	2,830	321,259	2029/05/15
INTERCOM MEDIA CORP 6.5 05/01/27	社 債 券	6.5000	1,023	1,000	113,576	2027/05/01
AHERN RENTALS INC 7.375 05/15/23	社 債 券	7.3750	1,971	1,872	212,523	2023/05/15
FRONTIER COMMUNICATIONS 6.75 05/01/29	社 債 券	6.7500	901	934	106,025	2029/05/01
MAGIC MERGERCO INC 7.875 05/01/29	社 債 券	7.8750	2,348	2,371	269,116	2029/05/01
CHARLES RIVER LABORATORI 4.25 05/01/28	社 債 券	4.2500	931	950	107,900	2028/05/01
MIDWEST GAMING BORROWER 4.875 05/01/29	社 債 券	4.8750	961	962	109,274	2029/05/01
CROWNROCK LP/CROWNROCK F 5.0 05/01/29	社 債 券	5.0000	937	948	107,675	2029/05/01
RANGE RESOURCES CORP 4.875 05/15/25	社 債 券	4.8750	1,740	1,773	201,283	2025/05/15
BOYNE USA INC 4.75 05/15/29	社 債 券	4.7500	649	656	74,471	2029/05/15
NCL CORPORATION LTD 12.25 05/15/24	社 債 券	12.2500	528	622	70,701	2024/05/15
ENTEGRIS INC 3.625 05/01/29	社 債 券	3.6250	1,560	1,581	179,552	2029/05/01
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP 5.25 05/15/27	社 債 券	5.2500	2,681	2,665	302,590	2027/05/15
FORTRISS TRANS & INFRAST 5.5 05/01/28	社 債 券	5.5000	1,937	1,905	216,306	2028/05/01
MIDCAP FINANCIAL ISSR TR 6.5 05/01/28	社 債 券	6.5000	1,887	1,936	219,813	2028/05/01
LCM INVESTMENTS HOLDINGS 4.875 05/01/29	社 債 券	4.8750	1,359	1,360	154,425	2029/05/01
AHEAD DB HOLDINGS LLC 6.625 05/01/28	社 債 券	6.6250	958	959	108,906	2028/05/01
ENCINO ACQUISITION PARTN 8.5 05/01/28	社 債 券	8.5000	1,818	1,843	209,286	2028/05/01
PDC ENERGY INC 5.75 05/15/26	社 債 券	5.7500	1,529	1,556	176,676	2026/05/15
METIS MERGER SUB LLC 6.5 05/15/29	社 債 券	6.5000	1,322	1,299	147,454	2029/05/15
BCPE EMPIRE HOLDINGS INC 7.625 05/01/27	社 債 券	7.6250	1,076	1,084	123,134	2027/05/01
VICTORS MERGER CORP 6.375 05/15/29	社 債 券	6.3750	2,388	2,228	252,965	2029/05/15
SCIH SALT HOLDINGS INC 6.625 05/01/29	社 債 券	6.6250	1,949	1,818	206,372	2029/05/01
NABORS INDUSTRIES INC 7.375 05/15/27	社 債 券	7.3750	930	928	105,366	2027/05/15
CUSHMAN & WAKEFIELD US 6.75 05/15/28	社 債 券	6.7500	907	978	111,050	2028/05/15
CCM MERGER INC 6.375 05/01/26	社 債 券	6.3750	1,024	1,070	121,550	2026/05/01
ANTERO MIDSTREAM PART/FI 7.875 05/15/26	社 債 券	7.8750	1,631	1,755	199,245	2026/05/15
IMOLA MERGER CORP 4.75 05/15/29	社 債 券	4.7500	339	344	39,151	2029/05/15
FORESTAR GROUP INC 3.85 05/15/26	社 債 券	3.8500	774	771	87,523	2026/05/15
CEC ENTERTAINMENT CO LLC 6.75 05/01/26	社 債 券	6.7500	1,067	1,044	118,601	2026/05/01
ALLY FINANCIAL INC 05/15/26	社 債 券	4.7000	1,473	1,517	172,200	2026/05/15
INDEPENDENCE ENERGY FIN 7.25 05/01/26	社 債 券	7.2500	1,402	1,449	164,548	2026/05/01
CORONADO FINANCE PTY LTD 10.75 05/15/26	社 債 券	10.7500	1,724	1,857	210,770	2026/05/15
TULLOW OIL PLC 10.25 05/15/26	社 債 券	10.2500	1,392	1,399	158,826	2026/05/15
GULFPORT ENERGY OP CORP 8.0 05/17/26	社 債 券	8.0000	1,822	1,985	225,389	2026/05/17
IIP OPERATING PARTNER 05/25/26	社 債 券	5.5000	1,242	1,308	148,458	2026/05/25
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375 05/14/26	社 債 券	7.3750	400	404	45,966	2026/05/14
PBF HOLDING CO LLC 9.25 05/15/25	社 債 券	9.2500	2,382	2,256	256,092	2025/05/15
ROBLOX CORP 3.875 05/01/30	社 債 券	3.8750	1,770	1,794	203,686	2030/05/01
KRAFT HEINZ FOODS CO 4.375 06/01/46	社 債 券	4.3750	1,752	2,048	232,457	2046/06/01
KRAFT HEINZ FOODS CO 5.0 06/04/42	社 債 券	5.0000	2,426	2,973	337,545	2042/06/04
UNITED STATES STEEL CORP 6.65 06/01/37	社 債 券	6.6500	1,816	1,939	220,077	2037/06/01
NAVIENT CORP 6.75 06/25/25	社 債 券	6.7500	3,411	3,705	420,526	2025/06/25
MERLIN ENTERTAINMENTS PL 5.75 06/15/26	社 債 券	5.7500	1,011	1,050	119,263	2026/06/15
TRI POINTE GROUP INC 5.25 06/01/27	社 債 券	5.2500	3,339	3,581	406,452	2027/06/01
ATKORE INC 4.25 06/01/31	社 債 券	4.2500	2,804	2,834	321,770	2031/06/01
BOYD GAMING CORP 4.75 06/15/31	社 債 券	4.7500	1,024	1,045	118,677	2031/06/15
CSN RESOURCES SA 4.625 06/10/31	社 債 券	4.6250	1,198	1,121	127,259	2031/06/10
SM ENERGY CO 5.625 06/01/25	社 債 券	5.6250	1,721	1,712	194,377	2025/06/01
FAIR ISAAC CORP 4.0 06/15/28	社 債 券	4.0000	1,980	1,988	225,679	2028/06/15
NORTHWEST FIBER LLC/NORT 10.75 06/01/28	社 債 券	10.7500	1,352	1,484	168,453	2028/06/01

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
TRI POINTE GROUP INC 5.7 06/15/28	社 債 券	5.7000	982	1,071	121,595	2028/06/15	
CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN 5.5 06/15/31	社 債 券	5.5000	2,778	2,889	327,915	2031/06/15	
DANA INC 5.625 06/15/28	社 債 券	5.6250	1,326	1,403	159,305	2028/06/15	
SQUARE INC 3.5 06/01/31	社 債 券	3.5000	1,445	1,479	167,943	2031/06/01	
MC BRAZIL DWNSTRM 7.25 06/30/31	社 債 券	7.2500	1,409	1,383	156,973	2031/06/30	
SYNAPTICS INC 4.0 06/15/29	社 債 券	4.0000	1,416	1,435	162,900	2029/06/15	
RENEWABLE ENERGY GROUP I 5.875 06/01/28	社 債 券	5.8750	945	972	110,417	2028/06/01	
INGLES MARKETS INC 4.0 06/15/31	社 債 券	4.0000	1,427	1,436	162,990	2031/06/15	
GREAT LAKES DREDGE&DOCK 5.25 06/01/29	社 債 券	5.2500	1,229	1,258	142,823	2029/06/01	
DELEK LOG PART/FINANCE 7.125 06/01/28	社 債 券	7.1250	881	917	104,092	2028/06/01	
INTERTAPE POLYMER GROUP 4.375 06/15/29	社 債 券	4.3750	1,480	1,474	167,353	2029/06/15	
NAVIENT CORP 6.75 06/15/26	社 債 券	6.7500	2,672	2,929	332,537	2026/06/15	
WATCO COS LLC/FINANCE CO 6.5 06/15/27	社 債 券	6.5000	1,415	1,491	169,328	2027/06/15	
MUELLER WATER PRODUCTS 4.0 06/15/29	社 債 券	4.0000	1,681	1,694	192,360	2029/06/15	
VALVOLINE INC 3.625 06/15/31	社 債 券	3.6250	444	429	48,752	2031/06/15	
LITHIA MOTORS INC 3.875 06/01/29	社 債 券	3.8750	933	954	108,384	2029/06/01	
HILTON GRAND VAC BOR ESC 5.0 06/01/29	社 債 券	5.0000	968	964	109,433	2029/06/01	
XHR LP 4.875 06/01/29	社 債 券	4.8750	1,418	1,427	162,061	2029/06/01	
CVR PARTNERS/CVR NITROGE 6.125 06/15/28	社 債 券	6.1250	1,877	1,950	221,374	2028/06/15	
ANTERO RESOURCES MIDSTRE 5.375 06/15/29	社 債 券	5.3750	929	941	106,857	2029/06/15	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES 9.125 06/15/23	社 債 券	9.1250	1,448	1,534	174,205	2023/06/15	
SIERRACOL ENRGY ANDINA 6.0 06/15/28	社 債 券	6.0000	1,450	1,340	152,107	2028/06/15	
SUNCOKE ENERGY INC 4.875 06/30/29	社 債 券	4.8750	990	968	109,958	2029/06/30	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP 4.75 06/15/29	社 債 券	4.7500	976	978	111,010	2029/06/15	
APOLLO CMMRL REAL EST FI 4.625 06/15/29	社 債 券	4.6250	1,959	1,899	215,558	2029/06/15	
AIR LEASE CORP 06/15/26	社 債 券	4.6500	1,474	1,510	171,481	2026/06/15	
MADISON IAQ LLC 5.875 06/30/29	社 債 券	5.8750	1,932	1,875	212,865	2029/06/30	
AMC ENTERTAINMENT HLDGS 06/15/26	社 債 券	12.0000	1,935	1,921	218,141	2026/06/15	
BATH & BODY WORKS INC 7.5 06/15/29	社 債 券	7.5000	1,286	1,452	164,892	2029/06/15	
CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO 7.5 06/01/29	社 債 券	7.5000	962	1,009	114,537	2029/06/01	
OASIS PETROLEUM INC 6.375 06/01/26	社 債 券	6.3750	1,344	1,393	158,177	2026/06/01	
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP 3.75 06/15/29	社 債 券	3.7500	186	183	20,879	2029/06/15	
VISTAJET MALTA/XO MGMT 10.5 06/01/24	社 債 券	10.5000	1,320	1,420	161,250	2024/06/01	
BOMBARDIER INC 7.125 06/15/26	社 債 券	7.1250	3,270	3,391	384,884	2026/06/15	
ONEMAIN FINANCE CORP 8.875 06/01/25	社 債 券	8.8750	1,460	1,571	178,363	2025/06/01	
AIRCASLE LTD 06/15/26	社 債 券	5.2500	971	992	112,688	2026/06/15	
AZUL INVESTMENTS LLP 7.25 06/15/26	社 債 券	7.2500	1,004	901	102,347	2026/06/15	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT 3.375 06/15/26	社 債 券	3.3750	1,689	1,678	190,523	2026/06/15	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 6.5 06/01/25	社 債 券	6.5000	2,389	1,235	140,235	2025/06/01	
SEALED AIR CORP 6.875 07/15/33	社 債 券	6.8750	752	948	107,699	2033/07/15	
LIMAK ISKENDERUN 9.5 07/10/36	社 債 券	9.5000	2,031	1,928	218,878	2036/07/10	
CATALENT PHARMA SOLUTION 5.0 07/15/27	社 債 券	5.0000	1,337	1,392	158,080	2027/07/15	
VMED O2 UK FINAN 4.75 07/15/31	社 債 券	4.7500	1,450	1,466	166,396	2031/07/15	
ACADIA HEALTHCARE CO INC 5.5 07/01/28	社 債 券	5.5000	843	880	99,903	2028/07/01	
ILLUMINATE BUYER/HLDG 9.0 07/01/28	社 債 券	9.0000	1,032	1,095	124,360	2028/07/01	
MINERALS TECHNOLOGIES IN 5.0 07/01/28	社 債 券	5.0000	1,148	1,169	132,794	2028/07/01	
VTR FINANCE BV 6.375 07/15/28	社 債 券	6.3750	933	980	111,327	2028/07/15	
ELWOOD ENERGY LLC 8.159 07/05/26	社 債 券	8.1590	1,508	1,562	177,287	2026/07/05	
VERTICAL HOLDCO GMBH 7.625 07/15/28	社 債 券	7.6250	946	992	112,655	2028/07/15	
GRUBHUB HOLDINGS INC 5.5 07/01/27	社 債 券	5.5000	1,406	1,412	160,288	2027/07/01	
MURPHY OIL CORP 6.375 07/15/28	社 債 券	6.3750	924	962	109,256	2028/07/15	
UNITED RENTALS NORTH AM 4.0 07/15/30	社 債 券	4.0000	2,130	2,193	248,950	2030/07/15	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
ARCOR SAIC 6.0 07/06/23	社 債 券	6.0000	621	613	69,662	2023/07/06	
TAYLOR MORRISON COMM 6.625 07/15/27	社 債 券	6.6250	2,632	2,772	314,714	2027/07/15	
CINEMARK USA INC 5.25 07/15/28	社 債 券	5.2500	2,457	2,343	265,975	2028/07/15	
TENNECO INC 5.0 07/15/26	社 債 券	5.0000	1,413	1,349	153,195	2026/07/15	
COMPASS MINERALS INTERNA 4.875 07/15/24	社 債 券	4.8750	2,503	2,543	288,665	2024/07/15	
CEDAR FAIR LP 5.25 07/15/29	社 債 券	5.2500	1,386	1,449	164,480	2029/07/15	
COLT MERGER SUB INC 8.125 07/01/27	社 債 券	8.1250	1,716	1,885	214,041	2027/07/01	
VERTICAL US NEWCO INC 5.25 07/15/27	社 債 券	5.2500	1,874	1,933	219,479	2027/07/15	
API GROUP DE INC 4.125 07/15/29	社 債 券	4.1250	1,562	1,540	174,815	2029/07/15	
COLGATE ENERGY P 5.875 07/01/29	社 債 券	5.8750	2,125	2,144	243,401	2029/07/01	
AHP HEALTH PARTN 5.75 07/15/29	社 債 券	5.7500	967	954	108,320	2029/07/15	
LEEWARD RENEWABL 4.25 07/01/29	社 債 券	4.2500	945	948	107,667	2029/07/01	
VICTORIA'S SECRET & CO 4.625 07/15/29	社 債 券	4.6250	1,412	1,414	160,519	2029/07/15	
ELASTIC NV 4.125 07/15/29	社 債 券	4.1250	1,018	993	112,718	2029/07/15	
CALLON PETROLEUM CO 6.375 07/01/26	社 債 券	6.3750	1,031	976	110,807	2026/07/01	
EVERI HOLDINGS INC 5.0 07/15/29	社 債 券	5.0000	951	954	108,341	2029/07/15	
LAREDO PETROLEUM INC 7.75 07/31/29	社 債 券	7.7500	1,391	1,337	151,782	2029/07/31	
PENN NATIONAL GA 4.125 07/01/29	社 債 券	4.1250	329	316	35,949	2029/07/01	
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25 07/23/29	社 債 券	4.2500	209	196	22,329	2029/07/23	
WYNDHAM DESTINATIONS INC 6.625 07/31/26	社 債 券	6.6250	2,148	2,332	264,756	2026/07/31	
AMERICAN AIRLINES INC 11.75 07/15/25	社 債 券	11.7500	3,119	3,797	431,070	2025/07/15	
ANTERO RESOURCES CORP 8.375 07/15/26	社 債 券	8.3750	435	482	54,721	2026/07/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 3.5 08/15/29	社 債 券	3.5000	5,392	5,371	609,713	2029/08/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 4.4 08/15/49	社 債 券	4.4000	539	546	62,002	2049/08/15	
MSCI INC 3.25 08/15/33	社 債 券	3.2500	1,834	1,849	209,936	2033/08/15	
SIRIUS XM RADIO INC 5.0 08/01/27	社 債 券	5.0000	928	959	108,856	2027/08/01	
NOVELIS CORP 3.875 08/15/31	社 債 券	3.8750	2,976	2,916	330,990	2031/08/15	
TRIUMPH GROUP INC 7.75 08/15/25	社 債 券	7.7500	2,217	2,206	250,403	2025/08/15	
MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN 6.0 08/01/26	社 債 券	6.0000	4,793	4,931	559,751	2026/08/01	
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.375 08/01/28	社 債 券	4.3750	819	854	97,000	2028/08/01	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 4.125 08/15/31	社 債 券	4.1250	673	698	79,267	2031/08/15	
CENTENE CORP 2.625 08/01/31	社 債 券	2.6250	709	694	78,816	2031/08/01	
PATTERN ENERGY OP LP/PAT 4.5 08/15/28	社 債 券	4.5000	2,795	2,849	323,393	2028/08/15	
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON 5.375 08/15/26	社 債 券	5.3750	1,719	859	97,500	2026/08/15	
MASTEC INC 4.5 08/15/28	社 債 券	4.5000	1,367	1,422	161,430	2028/08/15	
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC 4.0 08/15/28	社 債 券	4.0000	1,002	994	112,857	2028/08/15	
CROCS INC 4.125 08/15/31	社 債 券	4.1250	1,025	1,032	117,215	2031/08/15	
NATIONSTAR MTG HLD INC 5.5 08/15/28	社 債 券	5.5000	2,422	2,450	278,144	2028/08/15	
BALL CORP 2.875 08/15/30	社 債 券	2.8750	2,492	2,413	273,932	2030/08/15	
HOWARD HUGHES CORP 5.375 08/01/28	社 債 券	5.3750	1,032	1,086	123,327	2028/08/01	
HORIZON PHARMA USA INC 5.5 08/01/27	社 債 券	5.5000	1,495	1,578	179,167	2027/08/01	
WINDSTREAM ESCROW LLC 7.75 08/15/28	社 債 券	7.7500	1,484	1,560	177,137	2028/08/15	
PARK RIVER HOLDINGS INC 6.75 08/01/29	社 債 券	6.7500	1,613	1,595	181,138	2029/08/01	
SEASPAR CORP 5.5 08/01/29	社 債 券	5.5000	1,902	1,915	217,398	2029/08/01	
WILLIAMS SCOTSMAN INTL 4.625 08/15/28	社 債 券	4.6250	716	739	83,897	2028/08/15	
AG MERGER SUB II INC 10.75 08/01/27	社 債 券	10.7500	971	1,057	120,064	2027/08/01	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 3.875 08/15/29	社 債 券	3.8750	673	687	78,001	2029/08/15	
UBER TECHNOLOGIES INC 4.5 08/15/29	社 債 券	4.5000	2,384	2,377	269,810	2029/08/15	
CALLON PETROLEUM 8.0 08/01/28	社 債 券	8.0000	1,913	1,920	217,939	2028/08/01	
MIDAS OPCO HOLDINGS LLC 5.625 08/15/29	社 債 券	5.6250	1,251	1,261	143,225	2029/08/15	
WOLVERINE WORLD WIDE 4.0 08/15/29	社 債 券	4.0000	966	939	106,654	2029/08/15	
CARNIVAL CORP 4.0 08/01/28	社 債 券	4.0000	2,612	2,556	290,165	2028/08/01	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
SEAWORLD PARKS & ENTERTA 5.25 08/15/29	社 債 券	5.2500	2,372	2,398	272,222	2029/08/15	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC 3.375 08/31/27	社 債 券	3.3750	2,279	2,173	246,739	2027/08/31	
COUNTRY GARDEN HLDGS 4.8 08/06/30	社 債 券	4.8000	1,081	990	112,436	2030/08/06	
AIR CANADA 3.875 08/15/26	社 債 券	3.8750	954	961	109,091	2026/08/15	
GPS HOSPITALITY HOLDING 7.0 08/15/28	社 債 券	7.0000	1,110	1,006	114,218	2028/08/15	
IEA ENERGY SERVICES LLC 6.625 08/15/29	社 債 券	6.6250	977	957	108,728	2029/08/15	
JEFFERSON CAPITAL HOLDIN 6.0 08/15/26	社 債 券	6.0000	1,227	1,247	141,636	2026/08/15	
CARNIVAL CORP 9.875 08/01/27	社 債 券	9.8750	820	926	105,169	2027/08/01	
JOSEPH T RYERSON & SON I 8.5 08/01/28	社 債 券	8.5000	1,708	1,876	212,933	2028/08/01	
ACRISURE LLC / FIN INC 6.0 08/01/29	社 債 券	6.0000	504	484	55,025	2029/08/01	
CENTURY COMMUNITIES 3.875 08/15/29	社 債 券	3.8750	117	117	13,301	2029/08/15	
CURO GROUP HOLDINGS CORP 7.5 08/01/28	社 債 券	7.5000	978	979	111,222	2028/08/01	
APACHE CORP 5.1 09/01/40	社 債 券	5.1000	1,578	1,742	197,746	2040/09/01	
GLOBAL AIR LEASE CO LTD 09/15/24	社 債 券	6.5000	1,798	1,741	197,626	2024/09/15	
FREEPOR-TMCMORAN INC 5.25 09/01/29	社 債 券	5.2500	3,011	3,277	371,993	2029/09/01	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.45 09/15/36	社 債 券	6.4500	1,492	1,877	213,050	2036/09/15	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.625 09/01/30	社 債 券	6.6250	481	575	65,335	2030/09/01	
NEXTERA ENERGY OPERATING 4.5 09/15/27	社 債 券	4.5000	1,355	1,440	163,552	2027/09/15	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT 3.75 09/15/30	社 債 券	3.7500	4,085	4,008	454,986	2030/09/15	
BELO CORP 7.25 09/15/27	社 債 券	7.2500	2,933	3,397	385,581	2027/09/15	
ELEMENT SOLUTIONS INC 3.875 09/01/28	社 債 券	3.8750	1,137	1,143	129,773	2028/09/01	
MGM RESORTS INTL 4.625 09/01/26	社 債 券	4.6250	3,247	3,324	377,281	2026/09/01	
SOUTHWESTERN ENERGY CO 8.375 09/15/28	社 債 券	8.3750	1,854	2,048	232,471	2028/09/15	
UBER TECHNOLOGIES INC 7.5 09/15/27	社 債 券	7.5000	1,038	1,122	127,434	2027/09/15	
ON SEMICONDUCTOR CORP 3.875 09/01/28	社 債 券	3.8750	2,363	2,425	275,297	2028/09/01	
SIRIUS XM RADIO INC 3.875 09/01/31	社 債 券	3.8750	2,054	2,010	228,157	2031/09/01	
PIKE CORP 5.5 09/01/28	社 債 券	5.5000	1,933	1,946	220,873	2028/09/01	
ONEMAIN FINANCE CORP 4.0 09/15/30	社 債 券	4.0000	3,436	3,354	380,760	2030/09/15	
PENNYMAC FIN SVCS INC 5.75 09/15/31	社 債 券	5.7500	132	131	14,952	2031/09/15	
FMG RESOURCES AUG 2006 4.5 09/15/27	社 債 券	4.5000	3,016	3,155	358,148	2027/09/15	
SM ENERGY CO 6.75 09/15/26	社 債 券	6.7500	709	720	81,796	2026/09/15	
DANA INC 4.25 09/01/30	社 債 券	4.2500	1,050	1,063	120,744	2030/09/01	
KEN GARFF AUTOMOTIVE LLC 4.875 09/15/28	社 債 券	4.8750	1,003	999	113,422	2028/09/15	
SWITCH LTD 3.75 09/15/28	社 債 券	3.7500	1,971	1,977	224,408	2028/09/15	
LOGAN MERGER SUB INC 5.5 09/01/27	社 債 券	5.5000	2,343	2,346	266,322	2027/09/01	
WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN 4.875 09/15/28	社 債 券	4.8750	996	1,022	116,011	2028/09/15	
RADIATE HOLDCO / FINANCE 6.5 09/15/28	社 債 券	6.5000	1,229	1,214	137,858	2028/09/15	
AVAYA INC 6.125 09/15/28	社 債 券	6.1250	921	966	109,689	2028/09/15	
CABLEVISION LIGHTPATH 5.625 09/15/28	社 債 券	5.6250	200	196	22,345	2028/09/15	
CABLEVISION LIGHTPATH 3.875 09/15/27	社 債 券	3.8750	2,013	1,960	222,473	2027/09/15	
PRA GROUP INC 7.375 09/01/25	社 債 券	7.3750	1,467	1,563	177,493	2025/09/01	
VERITAS US INC/BERMUDA L 7.5 09/01/25	社 債 券	7.5000	938	971	110,231	2025/09/01	
USA COM PART/USA COM FIN 6.875 09/01/27	社 債 券	6.8750	976	1,008	114,419	2027/09/01	
SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP 8.0 09/20/25	社 債 券	8.0000	785	859	97,533	2025/09/20	
MATADOR RESOURCES CO 5.875 09/15/26	社 債 券	5.8750	4,003	4,083	463,497	2026/09/15	
UNIFRAX ESCROW ISS CORP 5.25 09/30/28	社 債 券	5.2500	1,712	1,709	194,054	2028/09/30	
WEATHERFORD INTERNATIONA 6.5 09/15/28	社 債 券	6.5000	1,153	1,192	135,345	2028/09/15	
RADIATE HOLDCO / FINANCE 4.5 09/15/26	社 債 券	4.5000	951	947	107,546	2026/09/15	
SABRE GLBL INC 7.375 09/01/25	社 債 券	7.3750	1,422	1,480	168,004	2025/09/01	
SPECIALTY BUILDING PRODU 6.375 09/30/26	社 債 券	6.3750	906	947	107,540	2026/09/30	
RESIDEO FUNDING INC 4.0 09/01/29	社 債 券	4.0000	1,848	1,776	201,678	2029/09/01	
SYLVAMO CORP 7.0 09/01/29	社 債 券	7.0000	1,716	1,783	202,401	2029/09/01	

銘柄	当 期 末						
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
SUNNOVA ENERGY CORP 5.875 09/01/26	社 債 券	5.8750	2,442	2,495	283,235	2026/09/01	
PAPA JOHN'S INTERNATIONAL 3.875 09/15/29	社 債 券	3.8750	1,485	1,460	165,821	2029/09/15	
MHP LUX SA 6.25 09/19/29	社 債 券	6.2500	1,470	1,396	158,502	2029/09/19	
UNIFRAX ESCROW ISS CORP 7.5 09/30/29	社 債 券	7.5000	1,486	1,477	167,719	2029/09/30	
MIRABELA NICKEL 144-A 1%	社 債 券	0.0000	52	0.00522	0,592	2044/09/10	
GLOBAL ATLANTIC 10/15/51	社 債 券	4.7000	1,199	1,201	136,399	2051/10/15	
TRANSJAMAICAN HIGHWAY 5.75 10/10/36	社 債 券	5.7500	2,759	2,761	313,438	2036/10/10	
APACHE CORP 4.375 10/15/28	社 債 券	4.3750	3,232	3,432	389,543	2028/10/15	
GAP INC/THE 3.875 10/01/31	社 債 券	3.8750	474	458	52,063	2031/10/01	
COINBASE GLOBAL INC 3.625 10/01/31	社 債 券	3.6250	2,894	2,675	303,725	2031/10/01	
MINSUR SA 4.5 10/28/31	社 債 券	4.5000	1,010	1,013	115,078	2031/10/28	
TEMPUR SEALY INTL INC 3.875 10/15/31	社 債 券	3.8750	406	402	45,667	2031/10/15	
MATCH GROUP HLD II LLC 3.625 10/01/31	社 債 券	3.6250	1,641	1,571	178,408	2031/10/01	
TONON LUXEMBOURG SA 0.0 10/31/24	社 債 券	0.0000	538	0.24244	27	2024/10/31	
CALLON PETROLEUM CO 6.125 10/01/24	社 債 券	6.1250	1,068	1,050	119,260	2024/10/01	
STEVENS HOLDING CO INC 6.125 10/01/26	社 債 券	6.1250	1,890	2,028	230,281	2026/10/01	
TENET HEALTHCARE CORP 6.125 10/01/28	社 債 券	6.1250	1,966	2,042	231,768	2028/10/01	
KRAFT HEINZ FOODS CO 4.875 10/01/49	社 債 券	4.8750	2,048	2,570	291,736	2049/10/01	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP 5.25 10/01/25	社 債 券	5.2500	1,917	1,938	219,983	2025/10/01	
L BRANDS INC 6.625 10/01/30	社 債 券	6.6250	1,543	1,729	196,322	2030/10/01	
PARK INTERMED HOLDINGS 5.875 10/01/28	社 債 券	5.8750	1,987	2,064	234,314	2028/10/01	
CENTENE CORP 3.0 10/15/30	社 債 券	3.0000	1,450	1,460	165,778	2030/10/15	
CARVANA CO 5.875 10/01/28	社 債 券	5.8750	676	681	77,294	2028/10/01	
SEG HLD LLC/SEG FIN CORP 5.625 10/15/28	社 債 券	5.6250	1,434	1,508	171,174	2028/10/15	
WHITE CAP BUYER LLC 6.875 10/15/28	社 債 券	6.8750	1,037	1,072	121,736	2028/10/15	
CONNECT FINCO SARL/CONN 6.75 10/01/26	社 債 券	6.7500	3,136	3,289	373,314	2026/10/01	
COINBASE GLOBAL INC 3.375 10/01/28	社 債 券	3.3750	1,441	1,346	152,846	2028/10/01	
LCPR SR SECURED FIN DAC 6.75 10/15/27	社 債 券	6.7500	1,183	1,234	140,119	2027/10/15	
WABASH NATIONAL CORP 4.5 10/15/28	社 債 券	4.5000	2,438	2,426	275,370	2028/10/15	
LSB INDUSTRIES 6.25 10/15/28	社 債 券	6.2500	1,004	1,037	117,797	2028/10/15	
MODIVCARE ESCROW ISSUER 5.0 10/01/29	社 債 券	5.0000	966	969	110,079	2029/10/01	
LIVE NATION ENTERTAINMEN 4.75 10/15/27	社 債 券	4.7500	2,082	2,115	240,135	2027/10/15	
CAESARS ENTERTAIN INC 4.625 10/15/29	社 債 券	4.6250	1,035	1,026	116,557	2029/10/15	
GAP INC/THE 3.625 10/01/29	社 債 券	3.6250	1,465	1,420	161,239	2029/10/01	
FRONTIER COMMUNICATIONS 5.875 10/15/27	社 債 券	5.8750	969	1,013	115,086	2027/10/15	
SWF ESCROW ISSUER CORP 6.5 10/01/29	社 債 券	6.5000	1,832	1,764	200,316	2029/10/01	
EG GLOBAL FINANCE PLC 8.5 10/30/25	社 債 券	8.5000	918	950	107,846	2025/10/30	
PRA GROUP INC 5.0 10/01/29	社 債 券	5.0000	959	946	107,391	2029/10/01	
SUMMER (BC) BIDC 5.5 10/31/26	社 債 券	5.5000	967	977	110,995	2026/10/31	
CARRIAGE PURCHASER INC 7.875 10/15/29	社 債 券	7.8750	1,466	1,402	159,222	2029/10/15	
VIAMI SOLUTIONS INC 3.75 10/01/29	社 債 券	3.7500	1,514	1,477	167,662	2029/10/01	
LFS TOPCO LLC 5.875 10/15/26	社 債 券	5.8750	998	1,027	116,572	2026/10/15	
ROLLER BEARING CO OF AME 4.375 10/15/29	社 債 券	4.3750	967	971	110,303	2029/10/15	
ROCKCLIFF ENERGY II LLC 5.5 10/15/29	社 債 券	5.5000	1,349	1,377	156,368	2029/10/15	
WELLTEC INTERNATIONAL 8.25 10/15/26	社 債 券	8.2500	968	985	111,819	2026/10/15	
180 MEDICAL INC 3.875 10/15/29	社 債 券	3.8750	1,458	1,454	165,099	2029/10/15	
LSF11 A5 HOLDCO LLC 6.625 10/15/29	社 債 券	6.6250	1,469	1,431	162,467	2029/10/15	
BONANZA CREEK ENERGY INC 5.0 10/15/26	社 債 券	5.0000	1,544	1,549	175,919	2026/10/15	
FOOT LOCKER INC 4.0 10/01/29	社 債 券	4.0000	1,554	1,544	175,304	2029/10/01	
API ESCROW CORP 4.75 10/15/29	社 債 券	4.7500	1,155	1,168	132,587	2029/10/15	
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO 4.5 10/01/27	社 債 券	4.5000	1,040	1,001	113,624	2027/10/01	
EVERARC ESCROW SARL 5.0 10/30/29	社 債 券	5.0000	1,041	1,036	117,630	2029/10/30	

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
CA MAGNUM HOLDINGS 5.375 10/31/26	社 債 券	5.3750	852	875	99,409	2026/10/31
OPTION CARE HEALTH INC 4.375 10/31/29	社 債 券	4.3750	1,174	1,172	133,032	2029/10/31
TAP ROCK RESOURCES LLC 7.0 10/01/26	社 債 券	7.0000	507	515	58,456	2026/10/01
PGT INNOVATIONS INC 4.375 10/01/29	社 債 券	4.3750	980	981	111,359	2029/10/01
DORNOCH DEBT MERGER SUB 6.625 10/15/29	社 債 券	6.6250	979	967	109,777	2029/10/15
CARVANA CO 5.625 10/01/25	社 債 券	5.6250	1,088	1,094	124,236	2025/10/01
NEW HOME CO INC/THE 7.25 10/15/25	社 債 券	7.2500	970	991	112,532	2025/10/15
ULKER BISKUVI SANAYI AS 6.95 10/30/25	社 債 券	6.9500	1,702	1,714	194,579	2025/10/30
INDIKA ENERGY CAPITAL IV 8.25 10/22/25	社 債 券	8.2500	915	941	106,903	2025/10/22
L BRANDS INC 6.875 11/01/35	社 債 券	6.8750	765	942	106,977	2035/11/01
PLAINS ALL AMERICAN PIPE 11/15/22	社 債 券	6.1250	1,141	971	110,321	2022/11/15
VENTURE GLOBAL CALCASIEU 3.875 11/01/33	社 債 券	3.8750	839	854	97,031	2033/11/01
MATTEL INC 5.45 11/01/41	社 債 券	5.4500	2,233	2,643	300,011	2041/11/01
NETFLIX INC 5.875 11/15/28	社 債 券	5.8750	1,653	1,995	226,440	2028/11/15
HILCORP ENERGY I/HILCORP 6.25 11/01/28	社 債 券	6.2500	1,311	1,339	152,053	2028/11/01
NETFLIX INC 5.375 11/15/29	社 債 券	5.3750	1,347	1,612	183,068	2029/11/15
WARRIOR MET COAL INC 8.0 11/01/24	社 債 券	8.0000	1,984	2,026	230,025	2024/11/01
SONIC AUTOMOTIVE INC 4.875 11/15/31	社 債 券	4.8750	646	648	73,576	2031/11/15
SPRINT CAPITAL CORP 6.875 11/15/28	社 債 券	6.8750	6,176	7,735	877,972	2028/11/15
GRAY ESCROW II INC 5.375 11/15/31	社 債 券	5.3750	1,353	1,368	155,286	2031/11/15
SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.375 11/15/29	社 債 券	5.3750	1,737	1,846	209,544	2029/11/15
CABLE ONE INC 4.0 11/15/30	社 債 券	4.0000	136	132	15,073	2030/11/15
OCEANEERING INTL INC 4.65 11/15/24	社 債 券	4.6500	1,760	1,787	202,916	2024/11/15
VIPER ENERGY PARTNERS LP 5.375 11/01/27	社 債 券	5.3750	2,461	2,550	289,475	2027/11/01
CHOBANI LLC/FINANCE CORP 4.625 11/15/28	社 債 券	4.6250	1,215	1,229	139,529	2028/11/15
SCIENTIFIC GAMES INTERNA 7.25 11/15/29	社 債 券	7.2500	1,833	2,026	229,988	2029/11/15
MOLINA HEALTHCARE INC 3.875 11/15/30	社 債 券	3.8750	919	938	106,490	2030/11/15
INGEVITY CORP 3.875 11/01/28	社 債 券	3.8750	1,464	1,419	161,074	2028/11/01
MSCI INC 3.625 11/01/31	社 債 券	3.6250	465	478	54,302	2031/11/01
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.0 11/13/30	社 債 券	4.0000	3,553	3,799	431,280	2030/11/13
PORT OF NEWCASTLE INVEST 5.9 11/24/31	社 債 券	5.9000	1,259	1,284	145,754	2031/11/24
SRM ESCROW ISSUER LLC 6.0 11/01/28	社 債 券	6.0000	1,303	1,370	155,506	2028/11/01
TRANSDIGM INC 5.5 11/15/27	社 債 券	5.5000	1,914	1,943	220,564	2027/11/15
RAPTOR ACQ/RAPTOR CO-ISS 4.875 11/01/26	社 債 券	4.8750	1,064	1,077	122,260	2026/11/01
EMPIRE RESORTS INC 7.75 11/01/26	社 債 券	7.7500	989	1,004	113,968	2026/11/01
TIANQI FINCO CO LTD 3.75 11/28/22	社 債 券	3.7500	1,007	951	108,008	2022/11/28
SVB FINANCIAL GROUP 11/15/26	社 債 券	4.2500	1,395	1,390	157,877	2026/11/15
VERTIV GROUP CORPORATION 4.125 11/15/28	社 債 券	4.1250	2,013	2,019	229,211	2028/11/15
APACHE CORP 4.625 11/15/25	社 債 券	4.6250	1,413	1,503	170,623	2025/11/15
EMPRESA GEN ELEC HAINA 5.625 11/08/28	社 債 券	5.6250	990	1,004	113,998	2028/11/08
PENINSULA PACIFIC ENTERT 8.5 11/15/27	社 債 券	8.5000	826	893	101,384	2027/11/15
CANPACK SA EASTERN LAND 3.125 11/01/25	社 債 券	3.1250	2,911	2,885	327,487	2025/11/01
MEDCO LAUREL TREE 6.95 11/12/28	社 債 券	6.9500	1,057	1,011	114,853	2028/11/12
BRASKEM IDESA SAPI 7.45 11/15/29	社 債 券	7.4500	1,869	1,947	221,096	2029/11/15
CANACOL ENERGY LTD 5.75 11/24/28	社 債 券	5.7500	954	944	107,199	2028/11/24
SONIC AUTOMOTIVE INC 4.625 11/15/29	社 債 券	4.6250	521	517	58,689	2029/11/15
BLUELINUX HOLDING 6.0 11/15/29	社 債 券	6.0000	1,436	1,407	159,723	2029/11/15
ARMOR HOLDCO INC 8.5 11/15/29	社 債 券	8.5000	1,447	1,494	169,633	2029/11/15
JANE STREET GRP/JSG FIN 4.5 11/15/29	社 債 券	4.5000	1,169	1,174	133,283	2029/11/15
FXI HOLDINGS INC 7.875 11/01/24	社 債 券	7.8750	1,003	1,021	115,981	2024/11/01
ASTON MARTIN CAPITAL HOL 10.5 11/30/25	社 債 券	10.5000	1,252	1,364	154,822	2025/11/30
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP 4.625 11/15/29	社 債 券	4.6250	512	518	58,836	2029/11/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
KONTOOR BRANDS INC 4.125 11/15/29	社 債 券	4.1250	863	867	98,453	2029/11/15
BUCKEYE PARTNERS LP 3.95 12/01/26	社 債 券	3.9500	2,032	2,012	228,364	2026/12/01
MATCH GROUP INC 5.0 12/15/27	社 債 券	5.0000	1,551	1,616	183,444	2027/12/15
MACY'S RETAIL HLDGS LLC 4.5 12/15/34	社 債 券	4.5000	1,366	1,334	151,409	2034/12/15
BUCKEYE PARTNERS LP 4.125 12/01/27	社 債 券	4.1250	1,587	1,576	178,917	2027/12/01
HCA INC 7.5 12/15/23	社 債 券	7.5000	5,516	6,145	697,543	2023/12/15
PACTIV LLC 7.95 12/15/25	社 債 券	7.9500	2,718	3,011	341,797	2025/12/15
WENDY'S INTERNATIONAL 7.0 12/15/25	社 債 券	7.0000	2,019	2,276	258,432	2025/12/15
NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD 7.75 12/15/25	社 債 券	7.7500	1,269	1,362	154,619	2025/12/15
MERITOR INC 4.5 12/15/28	社 債 券	4.5000	978	981	111,424	2028/12/15
MURPHY OIL CORP 5.875 12/01/27	社 債 券	5.8750	3,411	3,494	396,596	2027/12/01
CENTENE CORP 4.625 12/15/29	社 債 券	4.6250	3,397	3,634	412,485	2029/12/15
H&E EQUIPMENT SERVICES 3.875 12/15/28	社 債 券	3.8750	1,555	1,521	172,729	2028/12/15
SRS DISTRIBUTION INC 6.0 12/01/29	社 債 券	6.0000	2,399	2,396	271,958	2029/12/01
MATTEL INC 5.875 12/15/27	社 債 券	5.8750	1,255	1,352	153,481	2027/12/15
CDW LLC/CDW FINANCE 5.5 12/01/24	社 債 券	5.5000	1,001	1,092	124,043	2024/12/01
AUSTIN BIDCO INC 7.125 12/15/28	社 債 券	7.1250	998	1,027	116,575	2028/12/15
AUTOMATION TOOLING SYSTE 4.125 12/15/28	社 債 券	4.1250	1,444	1,457	165,396	2028/12/15
COMPASS MINERALS INTERNA 6.75 12/01/27	社 債 券	6.7500	1,669	1,740	197,578	2027/12/01
WGM ACQUISITION CORP 3.75 12/01/29	社 債 券	3.7500	1,323	1,314	149,198	2029/12/01
HERTZ CORP/THE 5.0 12/01/29	社 債 券	5.0000	1,484	1,472	167,153	2029/12/01
ARCHES BUYER INC 6.125 12/01/28	社 債 券	6.1250	960	971	110,221	2028/12/01
HERTZ CORP/THE 4.625 12/01/26	社 債 券	4.6250	414	413	46,930	2026/12/01
ENERSYS 4.375 12/15/27	社 債 券	4.3750	1,415	1,462	166,013	2027/12/15
RACKSPACE TECHNOLOGY 5.375 12/01/28	社 債 券	5.3750	1,004	971	110,214	2028/12/01
WARRIOR MET COAL INC 7.875 12/01/28	社 債 券	7.8750	1,061	1,084	123,040	2028/12/01
ALCOA NEDERLAND HOLDING 5.5 12/15/27	社 債 券	5.5000	1,119	1,190	135,071	2027/12/15
ALLIANCE DATA SYSTEMS CO 4.75 12/15/24	社 債 券	4.7500	1,694	1,724	195,674	2024/12/15
NCL CORPORATION LTD 3.625 12/15/24	社 債 券	3.6250	1,507	1,391	157,930	2024/12/15
AFFINITY GAMING 6.875 12/15/27	社 債 券	6.8750	2,320	2,376	269,712	2027/12/15
合 計	-	-	885,394	903,793	102,580,590	-

■投資信託財産の構成

2021年12月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	323,478	0.3
新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債)	3,979,078	3.6
公 社 債	102,580,590	93.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,451,251	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	110,334,399	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、108,669,099千円、98.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年12月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年12月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	110,334,399,709円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,236,040,190
株 式 (評 価 額)	323,478,901
公 社 債 (評 価 額)	106,559,669,092
未 収 入 金	790,267,003
未 収 利 息	1,291,156,559
前 払 費 用	133,787,964
(B) 負 債	987,381,117
未 払 金	987,381,117
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	109,347,018,592
元 本	28,356,463,500
次 期 繰 越 損 益 金	80,990,555,092
(D) 受 益 権 総 口 数	28,356,463,500口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	38,562円

(注1) 期首元本額 29,134,771,425円
追加設定元本額 2,128,235,710円
一部解約元本額 2,906,543,635円

(注2) 期末における元本の内訳
みずほUSハイールドオープンAコース (為替ヘッジあり) 4,660,749,438円
みずほUSハイールドオープンBコース (為替ヘッジなし) 16,413,796,161円
みずほUSハイールドファンド<DC年金> 1,124,155,436円
MHAM USハイールドファンド (毎月決算型) 134,201,208円
みずほUSハイールドオープン (年1回決算型) 為替ヘッジあり 418,193,276円
みずほUSハイールドオープン (年1回決算型) 為替ヘッジなし 5,605,367,981円
期末元本合計 28,356,463,500円

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2021年12月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,049,666,261円
受 取 配 当 金	11,288,216
受 取 利 息	2,933,275,666
そ の 他 収 益 金	105,197,039
支 払 利 息	△94,660
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,186,660,963
売 買 益	5,252,244,980
売 買 損	△3,065,584,017
(C) そ の 他 費 用	△23,376,582
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	5,212,950,642
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	77,986,296,525
(F) 解 約 差 損 益 金	△8,149,456,365
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,940,764,290
(H) 合 計 (D + E + F + G)	80,990,555,092
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	80,990,555,092

(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) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)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。