

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2009年11月6日から2024年10月8日までです。	
運用方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引を行う、「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。	
主要運用対象	アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）	ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円） CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）	米ドル建のハイイールド債
	CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）	本邦通貨表示の短期公社債
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。原則として外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎決算時（年12回、原則毎月8日。休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

アムンディ・リそな米国
ハイ・イールド債券ファンド
（ブラジルリアルコース）運用報告書（全体版）
第28作成期

第161期	（決算日	2023年5月8日）
第162期	（決算日	2023年6月8日）
第163期	（決算日	2023年7月10日）
第164期	（決算日	2023年8月8日）
第165期	（決算日	2023年9月8日）
第166期	（決算日	2023年10月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしくごお願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン:050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

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

<3196566・3196532>

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■最近5作成期の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 率			投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純資産総額
			税 分	込 配	み 金			
第24作成期		円		円	%	%	%	百万円
	137期 (2021年5月10日)	1,259		10	6.1	0.3	91.9	8,239
	138期 (2021年6月8日)	1,296		10	3.7	0.3	98.1	8,376
	139期 (2021年7月8日)	1,275		10	△ 0.8	0.3	97.1	8,135
	140期 (2021年8月10日)	1,248		10	△ 1.3	0.3	97.3	7,858
	141期 (2021年9月8日)	1,281		10	3.4	0.3	97.4	7,974
第25作成期	142期 (2021年10月8日)	1,213		10	△ 4.5	0.3	97.6	7,446
	143期 (2021年11月8日)	1,229		10	2.1	0.3	97.5	7,446
	144期 (2021年12月8日)	1,199		10	△ 1.6	0.3	97.5	7,105
	145期 (2022年1月11日)	1,197		10	0.7	0.4	97.4	6,906
	146期 (2022年2月8日)	1,256		10	5.8	0.4	97.3	7,013
	147期 (2022年3月8日)	1,293		10	3.7	0.3	97.7	7,161
第26作成期	148期 (2022年4月8日)	1,457		10	13.5	0.3	97.7	7,927
	149期 (2022年5月9日)	1,392		10	△ 3.8	0.3	95.2	7,342
	150期 (2022年6月8日)	1,463		10	5.8	0.3	97.6	7,647
	151期 (2022年7月8日)	1,309		10	△ 9.8	0.4	97.0	6,788
	152期 (2022年8月8日)	1,407		10	8.3	0.3	97.7	7,220
	153期 (2022年9月8日)	1,443		10	3.3	0.3	97.0	7,348
第27作成期	154期 (2022年10月11日)	1,429		10	△ 0.3	0.3	98.0	7,152
	155期 (2022年11月8日)	1,464		10	3.1	0.3	98.0	7,230
	156期 (2022年12月8日)	1,381		10	△ 5.0	0.4	97.7	6,750
	157期 (2023年1月10日)	1,334		10	△ 2.7	0.4	97.8	6,466
	158期 (2023年2月8日)	1,366		10	3.1	0.4	97.6	6,584
	159期 (2023年3月8日)	1,399		10	3.1	0.4	97.2	6,726
第28作成期	160期 (2023年4月10日)	1,393		10	0.3	0.4	96.9	6,672
	161期 (2023年5月8日)	1,453		10	5.0	0.4	97.1	6,895
	162期 (2023年6月8日)	1,514		10	4.9	0.4	98.4	6,680
	163期 (2023年7月10日)	1,557		10	3.5	0.4	98.5	6,951
	164期 (2023年8月8日)	1,562		10	1.0	0.4	98.5	6,813
	165期 (2023年9月8日)	1,590		10	2.4	0.4	98.3	6,853
	166期 (2023年10月10日)	1,510		10	△ 4.4	0.4	97.6	6,451

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■ 当作成期中の基準価額等の推移

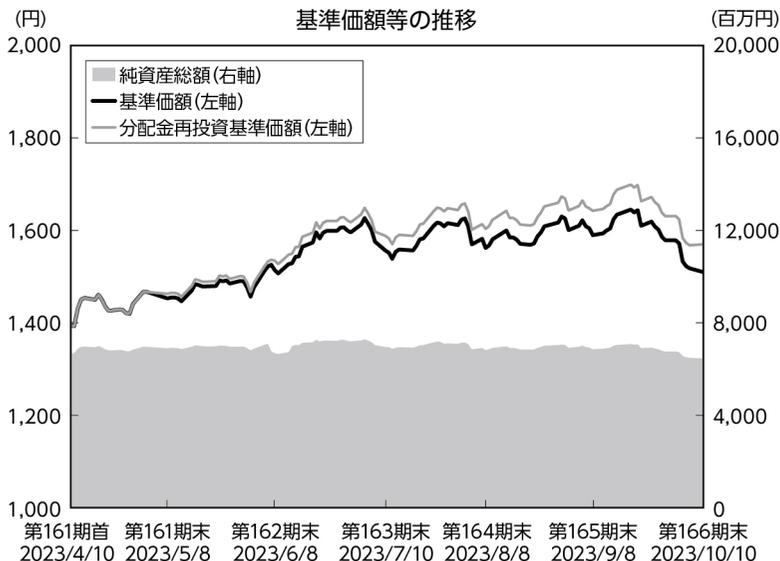
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
第161期	(期 首)2023年 4 月 10 日	円 1,393	% —	%	%
	4 月 末	1,441	3.4	0.4	96.9
	(期 末)2023年 5 月 8 日	1,463	5.0	0.4	97.1
第162期	(期 首)2023年 5 月 8 日	1,453	—	0.4	97.1
	5 月 末	1,477	1.7	0.4	98.8
	(期 末)2023年 6 月 8 日	1,524	4.9	0.4	98.4
第163期	(期 首)2023年 6 月 8 日	1,514	—	0.4	98.4
	6 月 末	1,596	5.4	0.3	98.8
	(期 末)2023年 7 月 10 日	1,567	3.5	0.4	98.5
第164期	(期 首)2023年 7 月 10 日	1,557	—	0.4	98.5
	7 月 末	1,612	3.5	0.3	98.4
	(期 末)2023年 8 月 8 日	1,572	1.0	0.4	98.5
第165期	(期 首)2023年 8 月 8 日	1,562	—	0.4	98.5
	8 月 末	1,626	4.1	0.4	98.7
	(期 末)2023年 9 月 8 日	1,600	2.4	0.4	98.3
第166期	(期 首)2023年 9 月 8 日	1,590	—	0.4	98.3
	9 月 末	1,579	△0.7	0.4	98.3
	(期 末)2023年 10 月 10 日	1,520	△4.4	0.4	97.6

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

【基準価額等の推移】

第161期首	1,393円
第166期末	1,510円
既払分配金 (税込み)	60円
騰落率	12.7% (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、2023年4月10日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 当作成期初め、6月から8月にかけて、米国ハイイールド債券市場が上昇したこと
- ② 当作成期前半、ブラジルリアル高・円安が進行したこと
- ③ 米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

下落要因

- ① 5月および9月頃に、米国ハイイールド債券市場が下落したこと
- ② 当作成期末にかけて、ブラジルリアル安・円高傾向となったこと

【投資環境】

<米国ハイイールド債券市場>

当作成期の米国ハイイールド債券市場は、3月中旬に起きた銀行破綻が市場にボラティリティ（価格変動性）を引き起こしましたが、経済指標がおおむね堅調であったこと、および1-3月期決算報告も良好であったことから、4月は上昇しました。5月は、頑固なインフレを示すデータやFRB（米連邦準備理事会）のコメントから、FOMC（米連邦公開市場委員会）が金融引き締めを継続する可能性があるとの見方が強まり、金利に対して弱気なセンチメントが強まったことを受けて市場は下落しました。6月は、米国の経済成長が上向きであったことから、ソフトランディングへの期待の高まりを反映し、市場は上昇しました。インフレ率の

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

低下と景気後退の回避というソフトランディングへの期待の高まりから、7月も強気相場となり、市場は上昇しました。ディスインフレ継続の見通しが続いたことにより、8月も引き続き市場は上昇しました。9月は、米国経済が底堅く、FRBは高金利長期化を維持するだろうという見方を背景に、米国国債市場の下落により米国ハイイールド債券市場も下落しました。ICE BofA US High Yield Constrained Index（以下、「米国ハイイールド債券指数」）が示す当作成期のリターンはプラスとなりました。格付別では、CCC格債、B格債、BB格債の順となりました。過去12カ月の発行額面ベースのデフォルト（債務不履行）率は前作成期末比で上昇しました。

<為替市場>

当作成期、ブラジルリアル/円相場は26円台で始まり、中国への資源輸出拡大への期待や財政悪化懸念の後退などが支援材料となるなか、ブラジル中央銀行の利下げ開始観測などが重しとなる場面があったものの、当作成期半ばにかけて上昇基調となりました。その後、日銀による長短金利操作の柔軟化決定を受けてややブラジルリアル安・円高となったものの、ブラジルの財政健全化に向けた動きや資源価格の上昇などが支援材料となった一方で、ブラジル中央銀行による利下げや中国景気への警戒感などから一進一退の動きとなり、29円近辺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、日銀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。TDB 3ヵ月物利回りは、米欧の銀行に対する信用不安の沈静化や、7月の日銀による金融政策修正により、一時-0.10%近辺まで上昇しました。しかしその後9月末から10月月初にかけては、年末越えの担保差入れなどを目的とした需要が高まり、利回りは一時-0.30%近辺まで低下しました。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする外国籍投資信託「ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」に投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」に90%以上投資することを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期初より当該投資信託を高位に組入れました。なお、国内籍投資信託「CAマネーブルファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

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

ポートフォリオにおいて、金融引き締めの影響を受けやすいBB格債を米国ハイイールド債券指数比でアンダーウェイトし、経済回復の恩恵を受けやすいと考えられるB格債およびCCC格債をオーバー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、素材、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。2023年前半に従来型の石油・ガスへのエクスポージャーを減らした後、同セクターのリスクを選択的に引き上げ始めた一方で、経済再開テーマと考えられるセクターにおいて好機を捉え、引き続き利益確定を行いました。また、通信セクター内で割安と考えられる銘柄のウェイトを引き上げました。石油の中期的な需給動向に対する見方が良好となったことから、9月に石油・ガス生産関連銘柄を組入れるとともに、ウェイトを引き上げました。

（ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク）

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

【分配金】

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

【今後の運用方針】

<当ファンド>

当ファンドが投資する「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）」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-ブラジルリアル（I4シェアクラス、円）>

今後は、財政赤字が経済を刺激し続けると同時に、長短金利の上昇（債券価格は下落）、原油高および米ドル高すべてが金融引き締め作用に作用すると考えられます。FOMCでは、2024年のコアPCEインフレ率の予想中央値が2.6%に据え置かれました。この水準はディスインフレの進展を示唆するものですが、依然としてインフレ率をさらに低下させる必要性があり、その結果、高金利長期化という見通しにつながっています。当ファンドは、高金利が長期化するとの見方は強調されすぎており、長期的には金利は低下（債券価格は上昇）する可能性が高いとみています。その場合、米国ハイイールド債券市場の現在の利回り水準は、良好な投資機会になると考えています。

(ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク)

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第161期～第166期 (2023年4月11日 ～2023年10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)	8円 (3) (4) (0)	0.484% (0.193) (0.275) (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)	0.006 (0.005) (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	8	0.490	

期中の平均基準価額は1,555円です。

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

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

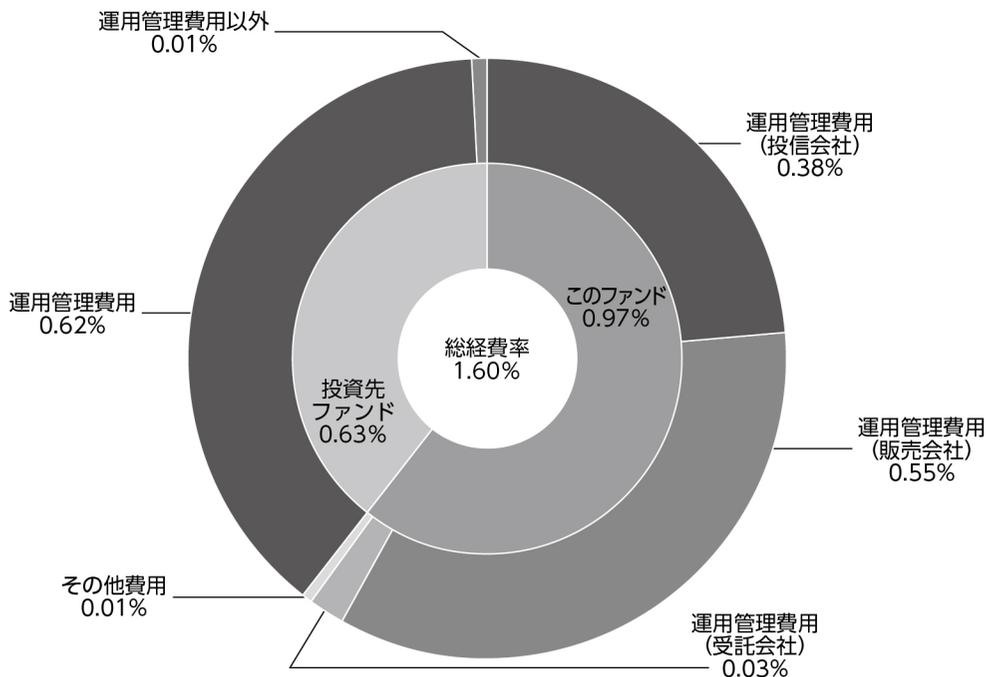
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

（参考情報）

●総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.60%です。



総経費率 (①+②+③)	1.60%
①このファンドの費用の比率	0.97%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■売買及び取引の状況（2023年4月11日から2023年10月10日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 161 期 ～ 第 166 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク)	口	千円	口	千円
	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)	95,000	165,775	357,166	623,513

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

■利害関係人との取引状況等（2023年4月11日から2023年10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10月10日現在）

(1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第27作成期末 (第160期末)	第28作成期末 (第166期末)	
		口 数	口 数	評 価 額
CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)		口 24,626,158	口 24,626,158	千円 24,687
合 計	口 数 ・ 金 額	24,626,158	24,626,158	24,687
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<0.4%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(2) 外国（邦貨建）投資証券

銘 柄		第27作成期末 (第160期末)	第28作成期末 (第166期末)	
		口 数	口 数	評 価 額
(ルクセンブルク) ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド- ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)		口 4,055,166	口 3,793,000	千円 6,296,380
合 計	口 数 ・ 金 額	4,055,166	3,793,000	6,296,380
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<97.6%>

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■投資信託財産の構成（2023年10月10日現在）

項 目	第 28 作 成 期 末 (第 166 期 末)	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	24,687	0.4
投 資 証 券	6,296,380	96.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	184,067	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	6,505,134	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第 161 期 末 (2023年5月8日)	第 162 期 末 (2023年6月8日)	第 163 期 末 (2023年7月10日)	第 164 期 末 (2023年8月8日)	第 165 期 末 (2023年9月8日)	第 166 期 末 (2023年10月10日)
(A) 資 産	6,950,016,615円	7,108,119,238円	7,018,151,782円	6,868,691,052円	6,924,039,056円	6,505,134,068円
コール・ローン等	226,188,822	512,901,618	145,832,833	133,450,866	164,688,870	184,066,345
投資信託受益証券(評価額)	24,692,648	24,692,648	24,692,648	24,690,186	24,690,186	24,687,723
投資証券(評価額)	6,699,135,145	6,570,524,972	6,847,626,301	6,710,550,000	6,734,660,000	6,296,380,000
(B) 負 債	54,316,900	427,844,660	66,669,586	55,481,096	70,141,390	53,185,704
未払収益分配金	47,467,181	44,116,953	44,654,995	43,622,724	43,100,199	42,735,313
未払解約金	1,697,894	377,917,638	15,830,026	6,239,230	21,055,369	4,305,065
未払信託報酬	5,096,695	5,693,359	6,002,495	5,379,324	5,684,035	5,781,495
未払利息	—	—	435	—	491	—
その他未払費用	55,130	116,710	181,635	239,818	301,296	363,831
(C) 純資産総額(A-B)	6,895,699,715	6,680,274,578	6,951,482,196	6,813,209,956	6,853,897,666	6,451,948,364
元 本	47,467,181,389	44,116,953,769	44,654,995,623	43,622,724,332	43,100,199,823	42,735,313,609
次期繰越損益金	△40,571,481,674	△37,436,679,191	△37,703,513,427	△36,809,514,376	△36,246,302,157	△36,283,365,245
(D) 受 益 権 総 口 数	47,467,181,389口	44,116,953,769口	44,654,995,623口	43,622,724,332口	43,100,199,823口	42,735,313,609口
1万口当たり基準価額(C/D)	1.453円	1.514円	1.557円	1.562円	1.590円	1.510円

(注記事項)

作成期首元本額	47,887,212,371円
作成期中追加設定元本額	2,685,443,132円
作成期中一部解約元本額	7,837,341,894円

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■損益の状況

項 目	第 161 期 自2023年4月11日 至2023年5月8日	第 162 期 自2023年5月9日 至2023年6月8日	第 163 期 自2023年6月9日 至2023年7月10日	第 164 期 自2023年7月11日 至2023年8月8日	第 165 期 自2023年8月9日 至2023年9月8日	第 166 期 自2023年9月9日 至2023年10月10日
(A) 配 当 等 收 益	101,346,773円	96,058,922円	97,957,393円	95,500,579円	95,175,213円	94,718,167円
受 取 配 当 金	101,355,395	96,066,238	97,965,241	95,508,147	95,180,337	94,725,354
支 払 利 息	△ 8,622	△ 7,316	△ 7,848	△ 7,568	△ 5,124	△ 7,187
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	232,836,687	225,318,934	139,551,362	△ 24,128,623	75,933,034	△ 390,101,275
売 買 益	235,140,307	238,820,900	147,370,211	2,886,037	78,294,526	2,014,296
売 買 損	△ 2,303,620	△ 13,501,966	△ 7,818,849	△ 27,014,660	△ 2,361,492	△ 392,115,571
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,155,101	△ 5,760,769	△ 6,075,428	△ 5,444,745	△ 5,747,521	△ 5,847,253
(D) 当 期 繰 上 益 金 (A+B+C)	329,028,359	315,617,087	231,433,327	65,927,211	165,360,726	△ 301,230,361
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 8,768,248,213	△ 7,864,694,862	△ 7,326,104,708	△ 6,959,401,801	△ 6,840,111,347	△ 6,646,974,961
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△32,084,794,639	△29,843,484,463	△30,564,187,051	△29,872,417,062	△29,528,451,337	△29,292,424,610
(配当等相当額)	(5,277,920,223)	(4,923,444,119)	(5,279,149,697)	(5,169,698,847)	(5,119,702,262)	(5,088,695,620)
(売買損益相当額)	(△37,362,714,862)	(△34,766,928,582)	(△35,843,336,748)	(△35,042,115,909)	(△34,648,153,599)	(△34,381,120,230)
(G) 計 (D+E+F)	△40,524,014,493	△37,392,562,238	△37,658,858,432	△36,765,891,652	△36,203,201,958	△36,240,629,932
(H) 収 益 分 配 金	△ 47,467,181	△ 44,116,953	△ 44,654,995	△ 43,622,724	△ 43,100,199	△ 42,735,313
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△40,571,481,674	△37,436,679,191	△37,703,513,427	△36,809,514,376	△36,246,302,157	△36,283,365,245
追 加 信 託 差 損 益 金	△32,084,794,639	△29,843,484,463	△30,564,187,051	△29,872,417,062	△29,528,451,337	△29,292,424,610
(配当等相当額)	(5,277,920,223)	(4,923,444,119)	(5,279,149,697)	(5,169,698,847)	(5,119,702,262)	(5,088,695,620)
(売買損益相当額)	(△37,362,714,862)	(△34,766,928,582)	(△35,843,336,748)	(△35,042,115,909)	(△34,648,153,599)	(△34,381,120,230)
分 配 準 備 積 立 金	6,683,368,876	6,244,348,171	6,075,777,617	5,969,289,859	5,934,822,065	5,918,426,294
繰 越 損 益 金	△15,170,055,911	△13,837,542,899	△13,215,103,993	△12,906,387,173	△12,652,672,885	△12,909,366,929

(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161期計算期間末における費用控除後の配当等収益（99,783,231円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（5,277,920,223円）および分配準備積立金（6,631,052,826円）より分配対象収益は12,008,756,280円（10,000口当たり2,529円）であり、うち47,467,181円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第162期計算期間末における費用控除後の配当等収益（94,337,028円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（4,923,444,119円）および分配準備積立金（6,194,128,096円）より分配対象収益は11,211,909,243円（10,000口当たり2,541円）であり、うち44,116,953円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第163期計算期間末における費用控除後の配当等収益（95,451,886円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（5,279,149,697円）および分配準備積立金（6,024,980,726円）より分配対象収益は11,399,582,309円（10,000口当たり2,552円）であり、うち44,654,995円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第164期計算期間末における費用控除後の配当等収益（90,055,834円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（5,169,698,847円）および分配準備積立金（5,922,856,749円）より分配対象収益は11,182,611,430円（10,000口当たり2,563円）であり、うち43,622,724円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第165期計算期間末における費用控除後の配当等収益（91,978,442円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（5,119,702,262円）および分配準備積立金（5,885,943,822円）より分配対象収益は11,097,624,526円（10,000口当たり2,574円）であり、うち43,100,199円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

第166期計算期間末における費用控除後の配当等収益（88,870,914円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（5,088,695,620円）および分配準備積立金（5,872,290,693円）より分配対象収益は11,049,857,227円（10,000口当たり2,585円）であり、うち42,735,313円（10,000口当たり10円）を分配金額としております。

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（ブラジルリアルコース）

■分配金のお知らせ

決 算 期	第161期	第162期	第163期	第164期	第165期	第166期
1万口当たりの分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	10円

◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しております。

◇分配金を再投資する場合

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

収益分配金に関する留意事項

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

【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第161期	第162期	第163期	第164期	第165期	第166期
	(2023年4月11日 ～2023年5月8日)	(2023年5月9日 ～2023年6月8日)	(2023年6月9日 ～2023年7月10日)	(2023年7月11日 ～2023年8月8日)	(2023年8月9日 ～2023年9月8日)	(2023年9月9日 ～2023年10月10日)
当期分配金 (対基準価額比率)	10 (0.684%)	10 (0.656%)	10 (0.638%)	10 (0.636%)	10 (0.625%)	10 (0.658%)
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,519	2,531	2,542	2,553	2,564	2,575

(注1) 「対基準価額比率」は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

(注2) 「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

< 1. 補足情報 >

組入ファンド「ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル」の決算日（毎年12月末）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2023年10月9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10月9日現在）

債券

	銘柄	通貨	額面金額	評価額（円）
パナマ	CARNIVAL CORP 5.75 21-27 01/03S	USD	625,000	84,464,752
アメリカ	FORD MOTOR CREDIT CO 5.1130 19-29 03/05S	USD	400,000	55,035,189
パナマ	CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S	USD	325,000	47,471,979
アメリカ	CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S	USD	325,000	38,320,826
	AMERICAN AIRLINES 11.7500 20-25 15/07	USD	225,000	36,639,808
	CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S	USD	300,000	35,635,283
リベリア	ROYAL CARIBBEAN 3.7 17-28 15/03S	USD	275,000	34,260,827
アメリカ	LIFE TIME INC 8.00 21-26 15/04S	USD	225,000	33,899,791
カナダ	BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S	USD	225,000	33,721,168
アメリカ	IMOLA MERGER CO 4.7500 21-29 15/05S	USD	250,000	32,934,736
	HILTON DOMESTIC 4.875 19-30 15/01S	USD	225,000	30,292,697
	BALL CORP 6.875 22-28 15/03S	USD	200,000	30,159,320
	VENTURE GLOBAL 8.1250 23-28 01/06S	USD	200,000	30,101,340
	NAVIENT CORP 6.75 17-25 25/06S	USD	200,000	29,658,003
	OLYMPUS WTR US 9.7500 23-28 15/11S	USD	200,000	29,518,026
	GTCR W-2 MERGER 7.5000 23-31 15/01S	USD	200,000	29,514,314
	NEPTUNE BIDCO US CO 9.29 22-29 15/04S	USD	200,000	28,107,272
	FORD MOTOR CREDIT CO 4.542 19-26 01/08S	USD	200,000	28,001,402
	BOYD GAMING COR 4.75 20-27 01/12S	USD	200,000	27,567,710
	DAVITA INC 4.6250 20-30 01/06S	USD	225,000	27,486,378
ケイマン諸島	TRANSOCEAN 6.80 07-38 15/03S	USD	250,000	27,180,243
イギリス	JAGUAR LAND ROVER 5.875 20-28 15/01S	USD	200,000	27,146,605
バミューダ	WEATHERFORD INT 8.6250 21-30 30/04S	USD	175,000	26,728,879
アメリカ	SLM CORP 3.125 21-26 02/11S	USD	200,000	26,238,291
フランス	ALTICE FRANCE SA 8.1250 18-27 01/02S	USD	200,000	26,218,073
アメリカ	CLOUD SOFTWARE 6.5000 22-29 31/03S	USD	200,000	26,190,436
	CAESARS ENTERTAINMEN 4.625 21-29 15/10S	USD	200,000	25,568,568
	FORD MOTOR CREDIT CO 2.9 21-28 16/02S	USD	200,000	25,212,183
カナダ	1011778 BC UNLIMITED 4.0000 20-30 15/10S	USD	200,000	25,015,585
アメリカ	CSC HOLDINGS LLC 6.5 19-29 01/02S	USD	200,000	24,993,238

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)

■外国為替取引 [N D F] （2023年10月9日現在）

買 建	契約額	売 建	契約額	満期日	評価損益 円
米ドル	1,000,000.00	ブラジルリアル	5,070,303.00	2023/11/3	3,352,492
米ドル	1,000,000.00	ブラジルリアル	5,185,210.00	2023/11/3	52,178
ブラジルリアル	234,445,494.00	米ドル	47,000,000.00	2023/11/3	△ 267,575,091
				合計	△ 264,170,421

< 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10月10日現在の情報を掲載しています。

■主要な売買銘柄（2023年2月16日から2023年10月10日まで）

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	50,023	—	—
第137回共同発行市場公募地方債	50,289		

（注1）金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）国内の現先取引によるものは含まれていません。

■組入資産の明細（2023年10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 10 月 10 日 現 在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	350,000	350,427	65.0	—	—	—	65.0
合 計	350,000	350,427	65.0	—	—	—	65.0

（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 10 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11回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.001	50,000	49,993	2024/8/28
	第128回共同発行市場公募地方債	0.66	250,000	250,202	2023/11/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,231	2024/8/23
	合 計		350,000	350,426	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

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

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しております。

■費用の明細 (2022年1月1日～2022年12月31日)

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

■純資産計算書 (2022年12月31日現在)

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

■有価証券明細 (2022年12月31日現在)

数量	評価額 円	数量	評価額 円
債券	524,125,030		
オーストラリア	13,006,939		
25,000 FMG RESO AUG 2006 PTY 6.125 22-32 15/04S	3,080,732	75,000 JACOBS ENTERTAI 6.7500 22-29 15/02S	9,028,943
25,000 FMG RESOURCES A 5.8750 22-30 15/04S	3,112,830	50,000 KAISER ALUMINUM 4.6250 19-28 01/03S	5,815,200
25,000 MINERAL RESOURCES 8.0 22-27 01/11S	3,374,096	25,000 KB HOME 7.25 22-30 15/07S	3,206,036
25,000 MINERAL RESOURCES 8.5 22-30 01/05S	3,396,396	50,000 KINETIK HOLDING 5.8750 22-30 15/06S	6,187,489
50,000 VIRGIN AUSTRALIA 19-24 15/11S - DEFAULT	42,885	25,000 LEVEL 3 FINANCING INC 3.625 20-29 15/01S	2,416,569
バミューダ	5,617,037	25,000 LINDBLAD EXPEDITIO LLC 6.75 22-27 15/02S	2,995,266
25,000 NABORS INDUSTRI 7.2500 20-26 15/01S	3,128,141	25,000 MATCH GP 5.625 19-29 15/02S	3,048,908
25,000 NCL 7.75 22-29 15/02S	2,488,896	50,000 MATCH GROUP HLD 3.6250 21-31 01/10S	5,086,398
カナダ	19,733,827	50,000 MATTEL INC 3.375 21-26 19/03S	6,109,329
50,000 BAUSCH HEALTH C 6.1250 22-27 01/02S	4,551,450	25,000 MATTEL INC 3.75 21-29 01/04S	2,902,031
50,000 BAUSCH HEALTH 5.2500 19-30 30/01S	3,207,380	100,000 MINERVA MERGER 6.5000 22-30 15/02S	9,790,903
50,000 VERMILION ENERGY 6.875 22-30 01/05S	6,061,164	25,000 MIVD HOLDCO II 5.5 22-30 01/02S	2,660,404
25,000 VIDEOTRON 3.625 21-29 15/06S	2,793,681	25,000 MOLINA HEALTHCARE INC 4.35 20-28 15/06S	3,011,797
25,000 VIDEOTRON LTEE 5.125 17-27 15/04S04S	3,120,152	25,000 NATL FI 7.5 22-30 01/10S	3,108,207
アメリカ	413,035,547	50,000 NEWS 5.125 22-32 15/02S	6,007,419
25,000 ADVANCED DRAIN 6.3750 22-30 15/06S	3,205,990	50,000 NORTONLIFELOCK INC 6.75 -27 30/09S	6,484,946
25,000 ALBERTSONS COMPANIES 4.875 20-30 15/02S	2,946,903	50,000 NORTONLIFELOCK INC 7.125 -30 30/09	6,506,764
25,000 ALLEGIANT TRAVEL 7.25 22-27 15/08S	3,143,919	50,000 OSCAR ACQUISITI 9.5000 22-30 15/04S	5,918,791
200,000 ALLIED UNIVERSAL 6.0 21-29 01/06S	19,383,734	25,000 OWENS & MINOR I 6.6250 22-30 01/04S	2,839,216
50,000 ARAMARK SERVICES INC 6.375 20-25 01/05S	6,543,876	50,000 OWENS BROCKWAY 144A 5.375 14-25 15/01S	6,366,387
50,000 AVIENT CORP 7.125 22-30 01/08S	6,496,683	25,000 OXFORD FINANCE LLC/OX 6.375 22-27 01/02S	3,034,350
50,000 BELLRING BRANDS 7,0000 22-30 15/03S	6,409,635	25,000 PEDIATRIX MEDICAL 5.3750 22-30 15/02U	2,836,180
50,000 BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375 22-32 15/06S	6,216,196	25,000 REALOGY GROUP/C 5.2500 22-30 15/04S	2,410,217
25,000 CAESARS ENTERTAINMENT 6.25 20-25 01/07S	3,212,050	100,000 ROCKETMTGE CO-I 4,0000 21-33 15/10S	9,883,609
100,000 CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.75 19-30 01/03S	11,409,284	25,000 RYAN SPECIALTY 4.3750 22-30 01/02S	2,886,736
300,000 CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S	32,218,638	25,000 SCI GAMES 6.625 22-30 01/03S	2,789,820
50,000 CCO HOLDINGS 5 17-28 01/02S 17-28 01/02S	6,005,362	75,000 SEALED AIR 5.0 22-29 15/04S	9,306,470
75,000 CCO HOLLDLCCCO HOLD C 6.375 22-29 01/09S	9,303,334	100,000 SENSATA TECHNOLOGIES 20-31 20-31 15/02S	10,933,398
75,000 CDI ESCROW ISSU 5,7500 22-30 01/04S	8,938,448	50,000 SIRIUS XM RADIO 5.00 17-27 01/08S	6,122,879
25,000 CHARLES RIVER L 4.0 21-31 15/03S	2,859,039	50,000 TENET HEALTHCARE 6.125 22-30 15/06S	6,287,034
100,000 CHS/COMMUNITY H 5,2500 22-30 15/05S	9,992,250	50,000 UNIVISION COMMUNICAT 7.375 22-30 30/06S	6,319,785
50,000 CIENA CORP 4.0 22-30 31/01S	5,832,155	ケイマン諸島	15,649,722
75,000 COGENT COMMUNIC 7,0000 22-27 15/06S	9,638,363	88,800 SEAGATE HDD CAYMAN 9.625 22-32 01/12S	12,863,611
25,000 COINBASE GLOBAL 3.6250 21-31 01/10S	1,607,023	25,000 TRANSOCEAN INC 7.50 17-26 15/01S	2,786,111
25,000 CONSENSUS CLOUD 6,5000 21-28 15/10S	3,035,239	リベリア	16,118,167
400,000 CSC HOLDINGS LLC 5.0 21-31 15/11S	29,576,514	25,000 ROYAL CARIB CRUISES 4.25 21-26 01/07S	2,676,332
100,000 DIAMOND SPORTS 5.375 22-26 15/08S	1,634,171	125,000 ROYAL CARIB CRUISES 5.375 22-27 15/07S	13,441,835
51,000 DIEBOLD NIXDORF INC 9,375 22-25 15/07S	4,812,384	マルタ	11,278,227
25,000 ENERGIZER 6.5 22-27 31/12S	3,155,999	50,000 VISTAJET MAL FIN 7.875 22-27 01/05S	5,977,645
50,000 ENLINK MIDSTREAM 6,5 22-30 01/09S	6,541,530	50,000 VISTAJET MALT 6.375 22-30 01/02S	5,300,582
25,000 EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-27 01/06S06S	3,235,778	パナマ	8,107,986
25,000 EQM MIDSTREAM PARTNER 7.5 22-30 01/06S	3,182,843	75,000 CARNIVAL CORPORATION 10.5 22-30 01/06S	8,107,986
50,000 FERTITTA ENTERT 6,7500 22-30 15/01S	5,333,826	イギリス	21,577,578
50,000 FERTITTA ENTERTMT FIN 4,625 22-29 15/01S	5,594,607	200,000 VMED O2 UK FINA 4,7500 21-31 15/07S	21,577,578
75,000 GAP INC 3,875 21-31 01/10S	6,993,676	債券	4,664,657,460
25,000 HESS MIDSTREAM 5,5000 22-30 15/10S	3,038,889	オーストラリア	17,367,563
50,000 HILCORP ENERGY 6,0000 22-30 15/04S	5,911,657	125,000 FMG RES AUG 2006 PTY 4.375 21-31 01/04SS	13,995,750
25,000 HILTON DOMESTIC 5,375 20-25 01/05S	3,277,472	25,000 MINERAL RESOURCES LTD 8.125 19-27 01/05S	3,371,813
75,000 HLF FIN SARL LLCHERB 4,875 21-29 01/06S	6,787,592		
25,000 HOLLY ENERGY PARTNER 6,375 22-27 15/04SS	3,259,007		

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル

数量	評価額 円	数量	評価額 円
バミューダ		48,180,685	
25,000 NABORS INDUSTRIES INC 7.50 20-28 15/01S	3,032.421	100,000 AG ISSUER LLC 6.25 20-28 01/03S	12,174.303
150,000 NCL CORP LTD 5.875 20-26 15/03S	15,612.043	25,000 AHP HEALTH PARTNERS 5.75 21-29 15/07S	2,585.863
25,000 NCL CORPORATION 3.6250 19-24 15/12S	2,839.447	100,000 ALBERTSONS COMPANIES 4.625 19-27 15/01S	12,296.296
50,000 NCL FINANCE LTD6.125 21-28 15/03S	4,915.126	50,000 ALLEGHENY TECHN 4.8750 21-29 01/10S	5,838.044
25,000 VIKING OCEAN CR 5.6250 21-29 15/02S	2,661.897	25,000 ALLEGHENY TECHN 5.1250 21-31 01/10S	2,909.851
50,000 VOC ESCROW LTD 5.00 18-28 15/02S	5,677.455	50,000 ALLEGHENY TECHNO 5.875 19-27 01/12S	6,336.046
5,000 WEATHERFORD 11.00 19-24 01/12S	678.661	25,000 ALLEN MEDIA LLC 10.5 20-28 15/02S	1,257.489
100,000 WEATHERFORD INT 8.6250 21-30 30/04S	12,763.635	25,000 ALLIED UNIVERSAL 6.625 19-26 15/07S	3,032.855
カナダ		125,000 ALLIED UNIVERSAL 9.75 19-27 15/07S	14,509.970
208,247,038		25,000 ALTA EQUIPMENT GROUP 5.625 21-26 15/04S	2,997.191
50,000 BAFFINLAND IRON MINES 8.75 18-26 15/07A	6,267.613	75,000 AMC NETWORKS INC 4.25 21-29 15/02S	6,183.736
25,000 BAUSCH HEALTH CO 7.25 19-29 30/05S	1,595.575	100,000 AMERICAN AIRLINES 11.7500 20-25 15/07	14,207.415
50,000 BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.25 20-31 15/02S	3,207.824	50,000 AMERIGAS PART/FIN 5.50 16-25 20/05S	6,347.668
25,000 BAUSCH HEALTH 7.0000 19-28 15/01S	1,611.943	150,000 AMN HEALTHCARE 4.0000 20-29 15/04S	17,153.927
174,000 BAUSCH HEALTH 9.00 17-25 15/12S	18,164.977	25,000 AMN HEALTHCARE 4.625 19-27 01/10S	3,044.080
61,000 BOMBARDIER 7.50 17-24 01/12S	8,072.012	25,000 ANTERO MIDSTREAM 5.375 21-29 15/06S	3,019.532
225,000 BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S	28,935.090	50,000 ANTERO MIDSTREAM 5.750 19-27 01/03S	6,241.533
50,000 BOMBARDIER INC 6.0 21-28 15/02S	6,133.707	50,000 ANTERO MIDSTREAM 7.875 20-26 15/05S	6,704.355
50,000 BROOKFIELD RESIDEN 5.00 21-29 15/06S	5,274.246	25,000 APACHE CORP 4.25 13-44 15/01S	2,339.040
50,000 EMPIRE COMMUNIT 7.0000 20-25 15/12S	6,009.741	100,000 APACHE CORP 5.10 10-40 01/09S	10,968.774
25,000 ENSIGN DRILLING INC 9.25 19-24 15/04S	3,146.136	75,000 APACHE CORP 5.35 19-49 01/07S	8,054.983
125,000 GARDA WORLD SECURITY 6.0 21-29 01/06S	13,503.618	25,000 API ESCROW CORP 4.75 21-29 15/10S	2,907.061
25,000 HUSKY III HOLDING 13.0 20-25 15/02S	2,932.203	50,000 API GROUP DE INC 4.125 21-29 15/07S	5,589.059
25,000 INTELLIGENT PACKAGING 6.00 20-28 15/09S	2,675.495	25,000 APX GROUP INC 5.7500 21-29 15/07S	2,746.547
50,000 MATTAMY GROUP 4.625 20-30 01/03S	5,412.450	50,000 ARAMARK SERVICES INC 5.00 18-28 01/02S	6,170.393
25,000 METHANEX CORP 5.125 20-27 15/10S7 15/10S	3,071.583	50,000 ARCHES BUYER 4.250 20-28 01/06S	5,190.082
25,000 NOVA CHEMICALS 4.2500 21-29 15/05S	2,705.602	25,000 ARCHROCK PARTNE 6.2500 19-28 01/04S	3,038.884
33,000 NOVA CHEMICALS CORP 5.25 17-27 01/06S6S	3,920.479	50,000 ARCHROCK PARTNE 6.8750 19-27 01/04S	6,334.285
75,000 OPEN TEXT CORP 3.875 21-29 01/12S	7,976.257	25,000 ARCONIC CORPORATION 6.125 20-28 15/02S	3,109.331
50,000 PARKLAND CORP/C 4.6250 21-30 01/05S	5,507.888	50,000 ARCONIC CORPORATION 6.20-25 13/05S	6,536.545
150,000 PARKLAND CORPORATION 4.5 -21-29 01/10S	16,626.899	25,000 ARKO CORP 5.125 21-29 15/11S	2,591.016
50,000 PRECISION DRILL 6.8750 21-29 15/01S	6,198.376	25,000 ASBURY AUTOMOTI 4.6250 21-29 15/11S	2,787.710
25,000 PRECISION DRILLING 7.125 17-26 15/01S	3,221.453	25,000 ASBURY AUTOMOTI 5.0000 21-32 15/02S	2,727.022
50,000 SUPERIOR PLUS LP SUP 4.5 21-29 15/03S	5,674.120	25,000 ASBURY AUTOMOTIVE 4.75 20-30 01/03S	2,774.789
25,000 TASEKO MINES LT 7.0000 21-26 15/02S	2,913.727	50,000 ASCENT RESOURCE 8.25 20-28 31/12S	6,493.408
25,000 TEINE ENERGY LT 6.8750 21-29 15/04S	2,984.577	64,000 ASCENT RESOURCES UTI 9.0 20-27 01/11S	10,360.911
50,000 TELESAT CANADA 5.625 21-26 08/12S	3,101.671	75,000 ASGN INCORPORAT 4.6250 19-28 15/05S	8,988.473
25,000 TELESAT CANADA 6.50 19-27 15/10S	986.343	50,000 ASHTON WOODS US 4.6250 21-30 01/04S	5,349.970
50,000 TITAN ACQUISITION LTD 7.75 18/26 15/04S	5,964.178	50,000 ASHTON WOODS USA LLC 6.625 20-28 15/01S	5,806.882
200,000 1011778 BC UNLIMITED 4.0000 20-30 15/10S	21,476.988	75,000 ASP AMC MERGER SUB 8.00 17-25 15/05S	584.379
25,000 1011778 BC UNLIMITED 4.3750 19-28 15/01S	2,974.267	25,000 ASSURED PARTNERS 5.6250 20-29 15/01S	2,740.795
デンマーク		50,000 AUDACY CAPITAL 6.75 21-29 31/03S	1,212.333
3,054,943		50,000 AUSTIN BIDCO INC 7.125 20-28 15/12S	5,122.201
25,000 COMMSCOPE FINANCE LLC 6 19-28 01/03S	3,054.943	125,000 AVANTOR FUNDING 3.8750 21-29 01/11S	13,877.835
アメリカ		75,000 AVANTOR FUNDING INC 4.6250 20-28 15/07S	8,994.525
4,006,045,041		50,000 AVIS BUDGET CAR RENT 4.75 21-28 23/03S	5,603.990
50,000 ABERCROMBIE 8.75 20-25 15/07S	6,536.188	25,000 AVIS BUDGET CAR 5.375 21-29 01/03S	2,838.098
25,000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.00 20-29 15/04S	3,056.506	25,000 AVIS BUDGET CAR 5.750 19-27 15/07S	3,000.048
25,000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.50 20-28 01/07S	3,134.661	100,000 BALL CORP 6.875 22-28 15/03S	13,574.238
75,000 ACRISURE LLC 0.125 19-26 01/08S	9,705.337	50,000 BASIC ENERGY SERVICES 0.00 18-23 15/10S	169.055
75,000 ACRISURE LLC 4.25 21-29 15/02S	8,237.092	125,000 BATH&BODY WORKS INC 6.75 16-36 01/07S	14,496.611
25,000 ACRISURE LLC 7.0 17-25 15/11S	3,043.252	50,000 BCPE EMPIRE HOLDINGS 7.625 21-27 01/05S	5,936.959
50,000 ADAMS HOMES 7.50 20-25 15/02S	5,632.536	50,000 BCPE ULYSSES INTERMED 7.75 21-27 01/04S	4,109.352
50,000 ADT SEC CORP 4.1250 21-29 01/08S	5,661.279	50,000 BEACON ROOFING 4.125 21-29 15/05S	5,516.631
40,000 ADTALEM ESCROW CORP 5.50 21-28 01/03S	4,848.677	50,000 BEAZER HOMES USA INC 6.7500 17-25 15/03	6,422.242
25,000 AETHON UN/AETHIN UN F 8.25 21-26 15/02S	3,280.175	50,000 BEAZER HOMES USA INC 7.25 19-29 15/10S	5,913.708
50,000 AFFINITY GAMING 6.8750 20-27 15/12S	5,617.554	40,000 BIG RIVER STEEL 6.6250 20-29 31/01S	5,075.772

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

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

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

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

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル

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

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルレアル

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

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

数量	評価額 円	数量	評価額 円
25.000 TENET HEALTHCARE 6.25 19-27 01/02S	3,174.744	25.000 VERSCEND 9.75 18-26 27/08S	3,238.029
50.000 TEREX CORP 5.0000 21-29 15/05S	5,934.658	50.000 VICI PROPERTIES 3.75 20-27 15/02S	6,002.127
75.000 TERRAFORM POWER 4.7500 19-30 15/01S	8,659.830	150.000 VICI PROPERTIES LP 4.25 19-26 01/12S/12S	18,489.170
25.000 THE ADT CORPORATION 4.875 16-32 15/07S	2,819.476	50.000 VICTORIA'S SECR 4.6250 21-29 15/07S	5,184.939
25.000 THE CHEMOURS CO 5.375 17-27 15/05S	3,051.364	100.000 VIKING CRUISES LTD 5.875 17-27 15/09S	10,786.279
50.000 THE SCOTTS MIRACLE-GRO 4.00 22-31 01/04S	5,082.533	75.000 VIKING CRUISES LTD 6.25 15-25 15/05S	8,980.893
25.000 THOR INDUSTRIES 4.0000 21-29 15/10S	2,607.318	25.000 VISTRA OPERATIONS CO 4.375 21-29 01/05S	2,855.568
50.000 TKC HOLDINGS INC 10.5 21-29 15/05S	3,754.662	125.000 VISTRA OPERATIONS CO 5 19-27 31/07S	15,360.722
100.000 T-MOBILE USA INC 3.375 21-29 15/04S	11,644.854	50.000 WASH MULTIFAMILY ACQ 5.75 21-26 15/04S	6,225.844
50.000 T-MOBILE USA INC 2.625 21-26 23/03S	6,047.904	75.000 WEEKLEY HOMES LLC 4.875 20-28 15/09S	8,383.270
25.000 TMS INTERNATIONAL CORP 6.25 21-29 15/04S	2,383.085	75.000 WERNER FINCO LP/IN 8.75 17-25 15/07S	6,694.730
25.000 TOLL BROS FINANCE 4.875 17-27 15/03S	3,137.552	25.000 WESTERN GAS PARTNERS 4.50 18-28 01/03S	3,037.736
25.000 TOPBUILD CORP 4.1250 21-32 15/02S	2,681.869	25.000 WESTERN GAS PARTNERS 4.7500 18-28 15/08S	3,035.952
25.000 TRAVEL + LEISURE CO 6.625 20-26 31/07S	3,236.309	100.000 WESTERN GAS PARTNERS 5.30 18-48 01/03S	10,943.619
50.000 TRAVEL + LEISURE CO 4.6250 19-30 01/03S	5,502.096	50.000 WESTERN GAS PARTNERS 5.45 14-44 01/04S	5,539.122
25.000 TRI POINTE HOMES 5.25 17-27 01/06S	2,946.107	25.000 WESTERN GAS PARTNERS 5.5 18-48 15/08S08S	2,744.544
50.000 TRIDENT TPI -144A 9.25 19-24 01/08S	6,296.003	50.000 WESTERN GLOBAL 10.3750 20-25 15/08	4,999.656
75.000 TRIMAS CORP 4.125 21-29 15/04S	8,702.953	50.000 WHEEL PROS ESCROW ISS 6.500 21-29 15/05S	2,489.102
75.000 TRINSEO OP 5.125 21-29 01/04S	6,433.860	50.000 WHITE CAP BUYER 6.875 20-28 15/10S	5,768.142
89.000 TRINSEO OP 5.375 17-25 01/09S	9,717.897	75.000 WILLIAMS SCOTSMAN 4.6250 20-28 15/08S	9,023.410
50.000 TRITON WATER HOLDINGS 6.25 21-29 01/04S	5,351.761	75.000 WINNEBAGO INDUS 6.2500 20-28 15/07S	9,315.484
25.000 TRIUMPH GROUP I 6.2500 19-24 15/09S	3,130.005	50.000 WORLD ACCEPTANCE CORP 7.00 21-26 01/11S	3,858.217
19.000 TRIUMPH GROUP I 8.8750 20-24 01/06S	2,555.848	25.000 W.R. GRACE HOLDINGS 4.875 21-27 15/06S	2,925.962
75.000 TRONOX INC 4.625 21-29 15/03S	8,232.150	25.000 WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625 21-29 15/08S	2,671.129
75.000 TTM TECHNOLOGIES INC 4 21-29 10/03S	8,511.434	75.000 WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	9,451.048
50.000 TWILIO INC 3.875 21-31 15/03S	5,243.496	75.000 WYNN RESORTS FINANCE 5.125 19-29 01/10S	8,503.133
25.000 UBER TECHNOLOGIES 6.25 20-28 15/01S	3,183.945	50.000 XEROX HOLDINGS CORP 5.00 20-25 15/08S	6,083.856
50.000 UBER TECHNOLOGIES 7.5 19-27 15/09S	6,611.085	25.000 XEROX HOLDINGS CORP 5.50 20-28 15/08S	2,668.065
75.000 UBER TECHNOLOGIES 7.5000 20-25 15/05S	9,921.044	25.000 XHR LP 4.875 21-29 01/06S	2,727.071
75.000 UBER TECHNOLOGIES 8.0 18-26 01/11S	9,987.617	25.000 XHR LP 6.375 20-25 15/08S	3,224.311
25.000 UBER TECHNOLOGIES 4.5 21-29 15/08S	2,879.796	75.000 YUM BRANDS 5.375 22-32 01/04S	9,179.636
25.000 UNITED AIR LINES INC 4.375 21-26 21/04S	3,075.315	22.000 ZIFF DAVIS INC 4.625 20-30 15/10S	2,461.353
19.760 UNITED AIRLINES 2020 5.875 20-27 28/10Q	2,571.691		
50.000 UNITED AIRLINES 4.6250 21-29 15/04S	5,769.169	フランス	43,968,448
25.000 UNITED NATURAL FOODS 6.75 20-28 15/10S	3,176.556	200.000 ALTICE FRANCE SA 5.125 21-29 15/07S	19,815.886
100.000 UNITED RENTALS 4.0000 20-30 15/07S	11,315.553	200.000 ALTICE FRANCE SA 8.1250 18-27 01/02S	24,152.562
25.000 UNITED RENTALS INC 3.875 20-31 15/02S	2,778.510		
25.000 UNITED RENTALS NORTH 4.875 17-28 15/01	3,128.737	ケイマン諸島	74,935,743
50.000 UNITED RENTALS NORTH 5.25 19-30 15/01S	6,201.733	50.000 AMERICAN AIRLINES 5.5 21-26 24/03Q	6,352.733
75.000 UNITED SHORE FIN SERV 5.5 21-29 15/04S	7,919.833	50.000 AMERICAN AIRLINES 5.75 21-29 20/04Q	6,041.409
10.000 UNITED STATES STEEL 6.875 21-29 01/03S	1,286.566	131.343 GLOBAL AIRCRAFT 6.50 19-24 15/09S	14,802.536
25.000 UNITED WHOLESAL 5.7500 21-27 15/06S	2,857.199	50.000 HAWAIIAN BRAND 5.75 21-26 20/01Q 04/02Q	5,973.608
50.000 UNITI GROUP/CSL 4.7500 21-28 15/04S	5,282.890	25.000 SEAGATE HDD CAYMAN 4.091 21-29 01/06S	2,738.281
25.000 UNITI GROUP/CSL 6.5000 21-29 15/02S	2,189.145	64.000 SEAGATE HDD CAYMAN 4.125 20-31 15/01S	6,623.453
50.000 UNITI GROUP/CSL 7.875 20-25 15/02S	6,407.678	14.960 SPIRIT LOYALTY 8.0000 20-25 20/09Q	1,983.769
75.000 UNIVAR SOLUTION 5.1250 19-27 01/12S	9,407.841	67.849 TRANSOCEAN GUARDIAN 5.875 18-24 15/01S	8,785.038
25.000 UNIVISION COMM 5.125 15-25 15/02S 15/02S	3,149.374	41.000 TRANSOCEAN INC 11.5 20-27 30/01S	5,451.943
100.000 UNIVISION COMMUNICATI 4.5 21-29 01/05S	11,062.025	25.000 TRANSOCEAN INC 7.35 11-41 15/12S	2,228.427
125.000 UNIVISION COMMUNICATI 6.825 20-27 01/06S	15,955.311	25.000 TRANSOCEAN INC 7.50 01-31 15/04S	2,228.173
125.000 US FOODS INC 4.75 21-29 15/02S	14,661.585	100.000 TRANSOCEAN INC 7.25 18-25 01/11S	11,726.373
25.000 USA COMPRESSION PART 6.875 18-26 01/04S	3,172.516		
50.000 USA COMPRESSION PART 6.875 19-27 17/12S	6,201.308	アイルランド	2,356,404
100.000 VALEANT PHARMA 8.5 18-27 01/06S	6,951.602	122.000 ENDO DESIGNATED ACTIVI 6.00 20-28 DEFAULT	936.883
25.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-29 15/08S	2,892.061	75.000 ENDO LTD / ENDO FINANCE 9.5 20-27 DEFAULT	1,419.521
75.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-33 01/11S	8,090.789		
25.000 VENTURE GLOBAL CALCAS 4.125 21-31 15/08S	2,815.657	イタリア	3,132,512
26.000 VERICAST MERGER SUB 11.00 21-26 15/09S	3,654.369	25.000 TELECOM ITALIA SPA 5.303 14-24 30/05S	3,132.512

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル

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

■外国為替取引 [N D F] (2022年12月31日現在)

					評価損益
買建	契約額	売建	契約額	満期日	円
ブラジルリアル	254,610,204.10	米ドル	46,900,000.00	2023/2/2	136,755,473
				合計	136,755,473

CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）

運用報告書

《第16期》

決算日：2023年2月15日

（計算期間：2022年2月16日～2023年2月15日）

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

■投資対象ファンドの概要

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

■最近5期の運用実績

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

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

■ 当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率
		騰	落	
(期 首) 2022年 2月15日	円 10,035	% —	% 70.8	% 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	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
				うちBB格 以下組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
千円	千円	%	%	%	%	%	
地方債証券	350,000 (350,000)	351,667 (351,667)	74.3 (74.3)	—	—	—	74.3 (74.3)
合 計	350,000 (350,000)	351,667 (351,667)	74.3 (74.3)	—	—	—	74.3 (74.3)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 一印は組入れなしです。

(注4) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しております。

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	当 期			末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地方債証券	第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	100,435	2023/8/29
	第128回共同発行市場公募地方債	0.66	250,000	251,232	2023/11/24
合 計			350,000	351,667	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成（2023年2月15日現在）

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

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年2月15日現在

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

(注記事項)

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

■損益の状況

当期 自2022年2月16日 至2023年2月15日

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

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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