

## ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2013年10月11日から2024年10月8日までです。	
運用方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／メキシコペソ買いの為替取引を行う、「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。	
主要運用対象	アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ） CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）	米ドル建のハイイールド債
	CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）	本邦通貨表示の短期公社債
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。原則として外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎決算時（年12回、原則毎月8日。休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

アムンディ・リそな米国  
ハイ・イールド債券ファンド  
（メキシコペソコース）運用報告書（全体版）  
第21作成期

第121期	（決算日	2023年11月8日）
第122期	（決算日	2023年12月8日）
第123期	（決算日	2024年1月9日）
第124期	（決算日	2024年2月8日）
第125期	（決算日	2024年3月8日）
第126期	（決算日	2024年4月8日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

## アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン:050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

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

&lt;3525484・3550589&gt;

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■最近5作成期の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	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			
		円	円	%	%	%	百万円	
第17作成期	97期 (2021年11月8日)	3,206	45	3.8	0.0	97.3	677	
	98期 (2021年12月8日)	3,049	45	△3.5	0.0	98.0	639	
	99期 (2022年1月11日)	3,153	45	4.9	0.0	97.5	628	
	100期 (2022年2月8日)	3,023	45	△2.7	0.0	97.4	604	
	101期 (2022年3月8日)	2,867	45	△3.7	0.1	97.1	555	
	102期 (2022年4月8日)	3,172	45	12.2	0.0	97.4	614	
第18作成期	103期 (2022年5月9日)	3,181	45	1.7	0.0	92.9	614	
	104期 (2022年6月8日)	3,302	45	5.2	0.0	96.8	637	
	105期 (2022年7月8日)	3,066	45	△5.8	0.0	96.6	597	
	106期 (2022年8月8日)	3,173	30	4.5	0.0	97.0	592	
	107期 (2022年9月8日)	3,332	30	6.0	0.0	96.4	617	
	108期 (2022年10月11日)	3,264	30	△1.1	0.0	97.8	599	
第19作成期	109期 (2022年11月8日)	3,367	30	4.1	0.0	98.5	611	
	110期 (2022年12月8日)	3,191	30	△4.3	0.1	97.7	580	
	111期 (2023年1月10日)	3,204	30	1.3	0.1	97.6	576	
	112期 (2023年2月8日)	3,252	30	2.4	0.1	97.0	586	
	113期 (2023年3月8日)	3,495	30	8.4	0.0	96.8	630	
	114期 (2023年4月10日)	3,391	30	△2.1	0.0	96.7	612	
第20作成期	115期 (2023年5月8日)	3,523	30	4.8	0.0	96.9	637	
	116期 (2023年6月8日)	3,731	30	6.8	0.0	96.9	672	
	117期 (2023年7月10日)	3,844	30	3.8	0.0	97.1	688	
	118期 (2023年8月8日)	3,912	30	2.5	0.0	97.3	724	
	119期 (2023年9月8日)	3,905	30	0.6	0.0	98.0	663	
	120期 (2023年10月10日)	3,715	30	△4.1	0.0	96.5	635	
第21作成期	121期 (2023年11月8日)	3,987	30	8.1	0.0	97.6	659	
	122期 (2023年12月8日)	3,916	30	△1.0	0.0	97.7	642	
	123期 (2024年1月9日)	4,150	30	6.7	0.0	97.5	667	
	124期 (2024年2月8日)	4,238	30	2.8	0.0	97.3	680	
	125期 (2024年3月8日)	4,295	30	2.1	0.0	97.2	687	
	126期 (2024年4月8日)	4,495	30	5.4	0.0	97.4	716	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■ 当作成期中の基準価額等の推移

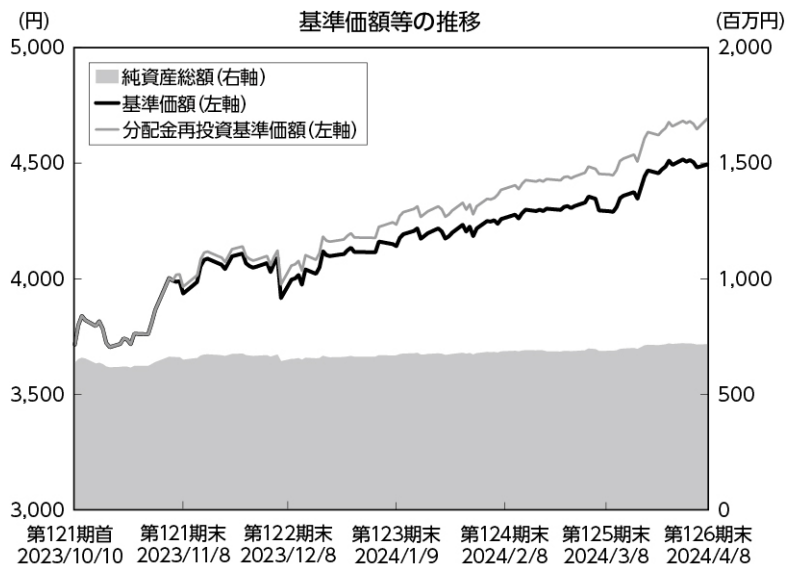
決算期	年 月 日	基準価額	騰 落 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
第121期	(期 首)2023年10月10日	円 3,715	% —	%	%
	10月末	3,760	1.2	0.0	98.2
	(期 末)2023年11月8日	4,017	8.1	0.0	97.6
第122期	(期 首)2023年11月8日	3,987	—	0.0	97.6
	11月末	4,048	1.5	0.0	98.3
	(期 末)2023年12月8日	3,946	△1.0	0.0	97.7
第123期	(期 首)2023年12月8日	3,916	—	0.0	97.7
	12月末	4,116	5.1	0.0	98.1
	(期 末)2024年1月9日	4,180	6.7	0.0	97.5
第124期	(期 首)2024年1月9日	4,150	—	0.0	97.5
	1月末	4,226	1.8	0.0	98.0
	(期 末)2024年2月8日	4,268	2.8	0.0	97.3
第125期	(期 首)2024年2月8日	4,238	—	0.0	97.3
	2月末	4,306	1.6	0.0	97.9
	(期 末)2024年3月8日	4,325	2.1	0.0	97.2
第126期	(期 首)2024年3月8日	4,295	—	0.0	97.2
	3月末	4,493	4.6	0.0	98.1
	(期 末)2024年4月8日	4,525	5.4	0.0	97.4

(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（メキシコペソコース）

## 【基準価額等の推移】

第121期首	3,715円
第126期末	4,495円
既払分配金 (税込み)	180円
騰落率	26.3% (分配金再投資ベース)



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2023年10月10日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

## 【基準価額の主な変動要因】

### 上昇要因

- ①2023年11月～12月と2024年3月に、米国ハイイールド債券市場が上昇したこと
- ②2023年11月前半および12月半ば以降、メキシコペソ高・円安が進行したこと
- ③米ドル売り／メキシコペソ買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

### 下落要因

- ①2023年10月、米国ハイイールド債券市場が下落したこと
- ②2023年10月と12月前半、メキシコペソ安・円高となったこと

## 【投資環境】

### <米国ハイイールド債券市場>

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

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

よびPPI（生産者物価指数）が予想を上回り、年内の利下げ回数の減少見通しが広まりました。投資家が緩やかなプラスの経済成長およびディスインフレの再燃を見込んだことや、2023年10-12月期の米国ハイイールド債の発行体の決算が底堅い状況だったことなどを受け、米国ハイイールド債券市場は上昇しました。ICE BofA US High Yield Constrained Index（以下、「米国ハイイールド債券指数」）が示す当作成期のリターンはプラスとなりました。格付別では、CCC格債以下、BB格債、B格債の順となりました。過去12カ月の発行額面ベースのデフォルト（債務不履行）率は前作成期末比で上昇しました。

## <為替市場>

当作成期、メキシコペソ/円相場は8円台前半で始まり、高い実質金利への需要やGDP（国内総生産）など良好な経済指標などがメキシコペソの支援材料となり上昇した後、日銀の金融政策修正観測を受け円高方向に振れたことなどから下落しました。その後、米国の早期利下げ観測が後退しメキシコペソ/円相場の上昇が一服する場面もみられましたが、高い実質金利への需要が引き続きメキシコペソの支援材料となったほか、日銀がマイナス金利政策を解除するなか緩和的な金融環境を継続する見通しを示したことなどから上昇基調で推移し、9円台前半で当作成期末を迎えました。

## <日本の短期国債市場>

当作成期の短期国債市場では、マイナス圏での推移が続いていたTDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが、当作成期末に向けて0%近辺まで上昇しました。TDB3ヵ月物利回りは、日銀によるマイナス金利政策や海外投資家からの需要に支えられ、-0.20%前後での推移が続いていましたが、2024年3月に実施された日銀によるマイナス金利解除を背景に、当作成期末に向けては0%近辺まで金利が上昇しました。

## 【ポートフォリオ】

### <当ファンド>

当ファンドは、米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする外国籍投資信託「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」に投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」に90%以上投資することを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期初より当該投資信託を高位に組入れました。なお、国内籍投資信託「CAマネーブルファンド（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）

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

ポートフォリオにおいて、金融引き締めの影響を受けやすいBB格債を米国ハイイールド債券指数比でアンダーウェイトし、経済回復の恩恵を受けやすいと考えられるCCC格債以下をオーバーウェイトの保有としました。セクター別では、割安であると判断したレジャー、金融サービス、素材などをオーバーウェイトした一方、割高であると判断した通信、資本財、エネルギーなどをアンダーウェイトとしました。2023年後半に、新型コロナウイルスからの経済再開の好影響を受けるセクターにて好機を捉え利益確定を行いました。業績改善により2023年に上昇した旅行・娯楽関連へのエクスポージャーについて、バリュエーションに留意しながら、年末にかけてウェイトを削減しました。

（ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク）

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

米ドル建資産に対し、米ドル売り／メキシコペソ買いの為替取引を行い、当完成期を通じてメキシコペソのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

## <CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

## 【分配金】

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

## 【今後の運用方針】

### <当ファンド>

当ファンドが投資する「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド（IH13シェアクラス、メキシコペソ）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」への投資も行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

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

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

(ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク)

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き米ドル建資産に対し、米ドル売り／メキシコペソ買いの為替取引を継続いたします。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

## <CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

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

(アムンディ・ジャパン株式会社)

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第121期～第126期 (2023年10月11日 ～2024年4月8日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 )  ( 受 託 会 社 )	20円 ( 8 ) (11)  ( 1 )	0.479% (0.190) (0.272)  (0.016)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 ( 監 査 費 用 ) ( そ の 他 )	0 ( 0 ) ( 0 )	0.005 (0.005) (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	20	0.484	

期中の平均基準価額は4,158円です。

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

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

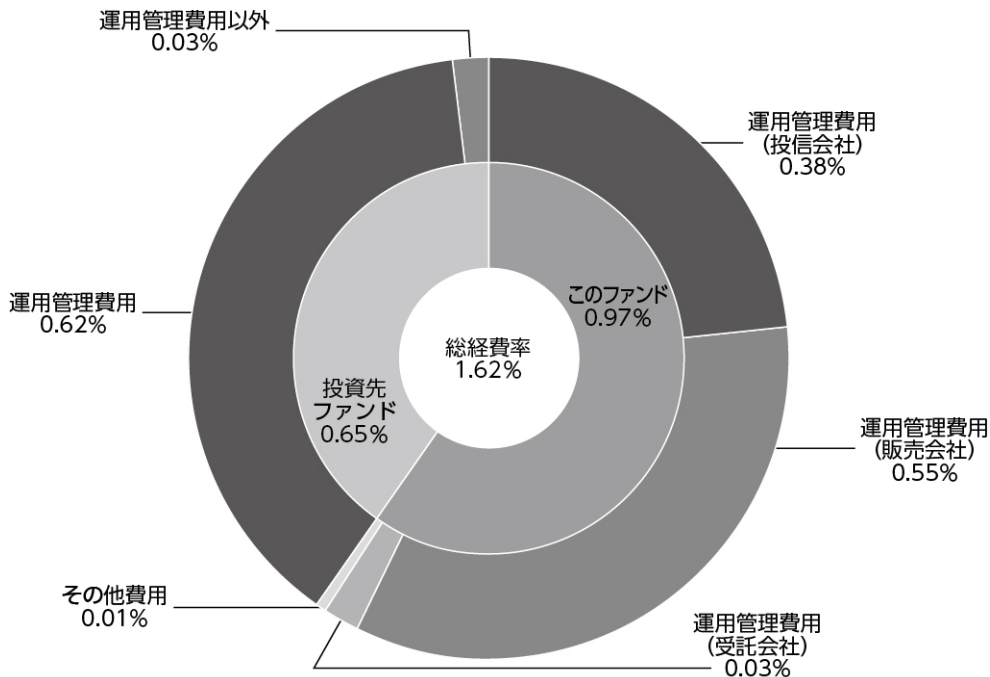
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## （参考情報）

### ●総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.62%です。



総経費率 (①+②+③)	1.62%
①このファンドの費用の比率	0.97%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.03%

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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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



# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■売買及び取引の状況（2023年10月11日から2024年4月8日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 121 期 ～ 第 126 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク) ストラクチャル-米国ハイ・イールド・ボンド (IH13シェアクラス、メキシコペソ)	6,500	千メキシコペソ 2,143	12,500	千メキシコペソ 4,113

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年10月11日から2024年4月8日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細（2024年4月8日現在）

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第20作成期末 (第120期末)	第21作成期末 (第126期末)	
		口 数	口 数	評 価 額
CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）		294,275	294,275	千円 294
合 計	口 数 ・ 金 額	294,275	294,275	294
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	<0.0%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

### (2) 外国（外貨建）投資証券

銘 柄		第20作成期末 (第120期末)	第21作成期末 (第126期末)		
			口 数	評 価 額	
		口 数		口 数	外 貨 建 金 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 (IH13シェアクラス、メキシコペソ)		235,000	229,000	千メキシコペソ 75,741	千円 697,876
合 計	口 数 ・ 金 額	235,000	229,000	75,741	697,876
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<97.4%>

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

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■投資信託財産の構成（2024年4月8日現在）

項 目	第 21 作 成 期 末 (第 126 期 末)	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	294	0.0
投 資 証 券	697,876	96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	24,056	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	722,226	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（697,876千円）の投資信託財産総額（722,226千円）に対する比率は96.6%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年4月8日現在における邦貨換算レートは、1メキシコペソ=9.2139円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第 121 期 末 (2023年11月8日)	第 122 期 末 (2023年12月8日)	第 123 期 末 (2024年1月9日)	第 124 期 末 (2024年2月8日)	第 125 期 末 (2024年3月8日)	第 126 期 末 (2024年4月8日)
(A) 資 産	665,489,334円	648,317,437円	673,153,874円	685,835,637円	692,665,335円	722,226,564円
コール・ローン等	21,181,943	19,852,989	22,038,013	23,500,876	24,211,974	24,054,847
投資信託受益証券(評価額)	294,981	294,863	294,892	294,863	294,834	294,804
投資証券(評価額)	644,012,410	628,169,585	650,820,969	662,039,898	668,158,527	697,876,910
未 収 利 息	—	—	—	—	—	3
(B) 負 債	5,515,773	5,471,836	5,461,424	5,522,138	5,509,169	5,399,970
未払収益分配金	4,966,344	4,924,536	4,826,549	4,816,045	4,799,320	4,784,644
未 払 解 約 金	58,345	7,999	59,998	147,469	153,551	—
未 払 信 託 報 酬	485,836	528,290	557,899	535,791	527,761	580,590
未 払 利 息	—	59	—	67	72	—
その他未払費用	5,248	10,952	16,978	22,766	28,465	34,736
(C) 純資産総額(A-B)	659,973,561	642,845,601	667,692,450	680,313,499	687,156,166	716,826,594
元 本	1,655,448,154	1,641,512,074	1,608,849,852	1,605,348,408	1,599,773,661	1,594,881,572
次期繰越損益金	△995,474,593	△998,666,473	△941,157,402	△925,034,909	△912,617,495	△878,054,978
(D) 受 益 権 総 口 数	1,655,448,154口	1,641,512,074口	1,608,849,852口	1,605,348,408口	1,599,773,661口	1,594,881,572口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,987円	3,916円	4,150円	4,238円	4,295円	4,495円

(注記事項)

作成期首元本額 1,710,842,404円

作成期中追加設定元本額 37,151,181円

作成期中一部解約元本額 153,112,013円

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■損益の状況

項 目	第 121 期 自2023年10月11日 至2023年11月 8 日	第 122 期 自2023年11月 9 日 至2023年12月 8 日	第 123 期 自2023年12月 9 日 至2024年 1 月 9 日	第 124 期 自2024年 1 月10日 至2024年 2 月 8 日	第 125 期 自2024年 2 月 9 日 至2024年 3 月 8 日	第 126 期 自2024年 3 月 9 日 至2024年 4 月 8 日
(A) 配 当 等 收 益	9,942,754円	9,451,606円	9,711,017円	9,875,331円	9,943,396円	10,540,671円
受 取 配 当 金	9,943,726	9,460,281	9,712,876	9,876,575	9,944,730	10,547,604
受 取 利 息	—	—	—	—	—	282
支 払 利 息	△ 972	△ 8,675	△ 1,859	△ 1,244	△ 1,334	△ 7,215
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	40,457,294	△ 15,574,149	33,297,623	9,544,671	4,522,415	26,587,597
売 買 益	40,573,124	15,515,784	33,483,079	9,766,069	5,836,108	34,067,447
売 買 損	△ 115,830	△ 31,089,933	△ 185,456	△ 221,398	△ 1,313,693	△ 7,479,850
(C) 信 託 報 酬 等	△ 491,727	△ 534,508	△ 564,417	△ 541,901	△ 533,736	△ 586,861
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	49,908,321	△ 6,657,051	42,444,223	18,878,101	13,932,075	36,541,407
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	57,540,916	101,338,639	87,732,740	124,634,696	137,275,476	145,567,310
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,097,957,486	△1,088,423,525	△1,066,507,816	△1,063,731,661	△1,059,025,726	△1,055,379,051
( 配 当 等 相 当 額 )	( 241,641,585)	( 240,644,832)	( 236,890,635)	( 237,679,004)	( 239,408,842)	( 239,680,048)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△1,339,599,071)	(△1,329,068,357)	(△1,303,398,451)	(△1,301,410,665)	(△1,298,434,568)	(△1,295,059,099)
(G) 計 (D+E+F)	△ 990,508,249	△ 993,741,937	△ 936,330,853	△ 920,218,864	△ 907,818,175	△ 873,270,334
(H) 収 益 分 配 金	△ 4,966,344	△ 4,924,536	△ 4,826,549	△ 4,816,045	△ 4,799,320	△ 4,784,644
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 995,474,593	△ 998,666,473	△ 941,157,402	△ 925,034,909	△ 912,617,495	△ 878,054,978
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,097,957,486	△1,088,423,525	△1,066,507,816	△1,063,731,661	△1,059,025,726	△1,055,379,051
( 配 当 等 相 当 額 )	( 241,641,585)	( 240,644,832)	( 236,890,635)	( 237,679,004)	( 239,408,842)	( 239,680,048)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△1,339,599,071)	(△1,329,068,357)	(△1,303,398,451)	(△1,301,410,665)	(△1,298,434,568)	(△1,295,059,099)
分 配 準 備 積 立 金	369,350,438	369,203,539	365,594,510	368,283,805	369,276,365	372,739,406
繰 越 損 益 金	△ 266,867,545	△ 279,446,487	△ 240,244,096	△ 229,587,053	△ 222,868,134	△ 195,415,333

(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121期計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,845,736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（241,641,585円）および分配準備積立金（364,471,046円）より分配対象収益は615,958,367円（10,000口当たり3,720円）であり、うち4,966,344円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第122期計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,917,098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（240,644,832円）および分配準備積立金（365,210,977円）より分配対象収益は614,772,907円（10,000口当たり3,745円）であり、うち4,924,536円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第123期計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,583,572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（236,890,635円）および分配準備積立金（360,837,487円）より分配対象収益は607,311,694円（10,000口当たり3,774円）であり、うち4,826,549円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第124期計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,599,774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（237,679,004円）および分配準備積立金（363,500,076円）より分配対象収益は610,778,854円（10,000口当たり3,804円）であり、うち4,816,045円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第125期計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,576,506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（239,408,842円）および分配準備積立金（364,499,179円）より分配対象収益は613,484,527円（10,000口当たり3,834円）であり、うち4,799,320円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

第126期計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,374,061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（239,680,048円）および分配準備積立金（367,149,989円）より分配対象収益は617,204,098円（10,000口当たり3,869円）であり、うち4,784,644円（10,000口当たり30円）を分配金額としております。

# アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド（メキシコペソコース）

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期	第126期
1万口当たりの分配金（税込み）	30円	30円	30円	30円	30円	30円

### ◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しております。

### ◇分配金を再投資する場合

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

## 【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期	第126期
	(2023年10月11日 ～2023年11月8日)	(2023年11月9日 ～2023年12月8日)	(2023年12月9日 ～2024年1月9日)	(2024年1月10日 ～2024年2月8日)	(2024年2月9日 ～2024年3月8日)	(2024年3月9日 ～2024年4月8日)
当期分配金	30	30	30	30	30	30
（対基準価額比率）	(0.747%)	(0.760%)	(0.718%)	(0.703%)	(0.694%)	(0.663%)
当期の収益	30	30	30	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,690	3,715	3,744	3,774	3,804	3,839

（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「ストラクチャラ-米国ハイ・イールド・ボンド」の決算日（毎年12月末日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年4月5日現在の情報を掲載しています。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2024年4月5日現在）  
債券

	銘柄		通貨	額面金額	評価額（米ドル）
アメリカ	TENET HEALTHCARE	6.125 20-28 01/10S	USD	300,000	298,285.67
パナマ	CARNIVAL CORP	5.75 21-27 01/03S	USD	300,000	297,130.49
アメリカ	CCO HOLDINGS	4.75 22-32 01/02S	USD	350,000	283,488.12
	VENTURE GLOBAL	9.8750 23-32 01/02S	USD	250,000	278,669.80
	IMOLA MERGER CO	4.7500 21-29 15/05S	USD	250,000	237,979.72
バミューダ	WEATHERFORD INT	8.6250 21-30 30/04S	USD	200,000	214,378.77
アメリカ	OLYMPUS WTR US	9.7500 23-28 15/11S	USD	200,000	212,768.52
	SPIRIT AEROSYSTEMS	4.6 18-28 15/06S	USD	190,000	180,793.42
オランダ	UPC BROADBAND FINCO B	4.875 21-31 15/07S	USD	200,000	180,141.21
アメリカ	ORGANON COMPANY	5.125 21-31 30/04S30/04S	USD	200,000	179,617.81
カナダ	1011778 BC UNLIMITED	4.0000 20-30 15/10S	USD	200,000	179,232.67
アメリカ	ALLIED UNIVERSAL	9.75 19-27 15/07S	USD	175,000	179,193.96
	CCO HLDG LLC/CAPITAL	4.50 21-33 01/06S	USD	225,000	176,632.23
イギリス	VMED 02 UK FINA	4.7500 21-31 15/07S	USD	200,000	172,505.12
アメリカ	CSC HOLDINGS LLC	6.5 19-29 01/02S	USD	200,000	166,438.78
	ALBERTSONS COMPANIES	4.875 20-30 15/02S	USD	175,000	166,253.79
	NEWS	5.125 22-32 15/02S	USD	175,000	164,389.73
フランス	ALTICE FRANCE SA	5.125 21-29 15/07S	USD	225,000	158,337.16
アメリカ	LIFE TIME INC	8.00 21-26 15/04S	USD	150,000	157,532.93
カナダ	BOMBARDIER	7.875 19-27 15/04S	USD	150,000	155,857.20
アメリカ	BUILDERS FIRSTS	4.2500 21-32 01/02S	USD	175,000	155,659.47
パナマ	CARNIVAL CORP	7.625 20-26 01/03S	USD	150,000	152,564.37
アメリカ	FRONTIER COM CORP	5.875 20-27 15/10S5/10	USD	150,000	148,619.65
ケイマン諸島	TRANSOCEAN	6.80 07-38 15/03S	USD	175,000	148,558.30
アメリカ	UNITED RENTALS NORTH	5.25 19-30 15/01S	USD	150,000	147,312.97
	IRON MOUNTAIN INC	5.2500 20-30 15/07S	USD	150,000	142,490.72
	CSC HOLDINGS LLC	4.5 21-31 15/11S	USD	200,000	142,095.23
	CLEAR CHANNEL OUTDOOR	5.125 19-27 15/08S	USD	150,000	141,665.20
	SLM CORP	3.125 21-26 02/11S	USD	150,000	141,358.18
	CAESARS ENTERTAINMENT	4.625 21-29 15/10S	USD	150,000	139,623.70

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。  
USD (米ドル)

■外国為替先物契約（IH13シェアクラス、メキシコペソ）（2024年4月5日現在）

買 建	契約額	売 建	契約額	満 期 日	評 価 損 益 米ドル
メキシコペソ	77,000,000.00	米ドル	4,557,274.94	2024/6/4	71,477.65
				合計	71,477.65

## < 2. 補足情報 >

組入ファンド「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2024年2月15日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年4月8日現在の情報を掲載しています。

### ■組入資産の明細（2024年4月8日現在）

公社債

#### (A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 4 月 8 日 現 在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	350,000	350,472	67.8	—	—	—	67.8
合 計	350,000	350,472	67.8	—	—	—	67.8

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) —印は組入れなしです。

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

#### (B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	2024 年 4 月 8 日 現 在			
		利率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第 1 1 回 政 府 保 証 地 方 公 共 団 体 金 融 機 構 債 券	0.001	50,000	49,978	2024/8/28
	第 1 3 4 回 共 同 発 行 市 場 公 募 地 方 債	0.674	100,000	100,074	2024/5/24
	第 1 3 7 回 共 同 発 行 市 場 公 募 地 方 債	0.566	50,000	50,080	2024/8/23
	第 1 3 9 回 共 同 発 行 市 場 公 募 地 方 債	0.544	150,000	150,340	2024/10/25
	合 計		350,000	350,472	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド  
 決算日 2023年12月31日  
 (計算期間：2023年1月1日～2023年12月31日)

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

■費用の明細 (2023年1月1日～2023年12月31日)

項目	当期
	米ドル
(a)運用報酬	210,860.22
(b)管理費用等	77,926.74
(c)その他の費用	40,362.91
合計	329,149.87

■純資産計算書 (2023年12月31日現在)

項目	当期末
	米ドル
<b>資産合計</b>	43,598,359.25
有価証券	41,694,605.20
預金	176,485.67
未収利息	699,380.65
為替予約取引評価勘定	1,027,887.73
<b>負債合計</b>	618,751.42
未払配当金	595,924.76
未払運用報酬	15,859.24
未払管理費用	5,861.04
未払税	1,077.30
為替未払金	29.08
<b>純資産</b>	42,979,607.83

■有価証券明細 (2023年12月31日現在)

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
<b>債券</b>			
	<b>41,421,324.74</b>		
オーストラリア			
125.000 FMG RES AUG 2006 PTY 4.375 21-31 01/04SS	317,159.56	50.000 PRECISION DRILL 6.8750 21-29 15/01S	48,178.23
25.000 FMG RESO AUG 2006 PTY 6.125 22-32 15/04S	113,603.42	46.000 PRECISION DRILLING 7.125 17-26 15/01S	45,960.11
50.000 FMG RESOURCES A 5.8750 22-30 15/04S	25,226.69	50.000 SUPERIOR PLUS LP SUP 4.5 21-29 15/03S	46,272.70
25.000 MINERAL RESOURC 9.2500 23-28 01/10S	49,743.82	25.000 TASEKO MINES LT 7.0000 21-26 15/02S	23,828.26
25.000 MINERAL RESOURCES 8.0 22-27 01/11S	26,402.38	25.000 TELESAT CANADA 4.875 19-27 15/10S	14,854.63
25.000 MINERAL RESOURCES 8.5 22-30 01/05S	25,645.77	50.000 TELESAT CANADA 5.625 21-26 06/12S	31,188.22
50.000 MINERAL RESOURCES LTD 8.125 19-27 01/05S	25,901.20	25.000 TELESAT CANADA 6.50 19-27 15/10S	11,826.46
25.000 VIRGIN AUSTRALIA 19-24 15/11S - DEFAULT	50,531.00	100.000 TITAN ACQUISITION LTD 7.75 18/26 15/04S	100,764.89
	105.28	50.000 VALEANT PHARMA 5.50 17-25 01/11S	46,167.40
		50.000 VERMILION ENERGY 6.875 22-30 01/05S	48,229.55
バミューダ		アメリカ	
50.000 NABORS INDUSTRIES INC 7.50 20-28 15/01S	322,575.51	25.000 ABERCROMBIE 8.75 20-25 15/07S	37,028,206.97
25.000 VALARIS LTD 8.375 23-30 30/04S	43,576.85	50.000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.00 20-29 15/04S	25,473.74
50.000 VIKING OCEAN CR 5.6250 21-29 15/02S	25,627.28	25.000 ACADIA HEALTHCARE CO 5.50 20-28 01/07S	48,310.31
50.000 VOC ESCROW LTD 5.00 18-28 15/02S	48,790.92	25.000 ACRISURE LLC 0.125 19-26 01/08S	24,764.65
150.000 WEATHERFORD INT 8.6250 21-30 30/04S	48,035.18	50.000 ACRISURE LLC 4.25 21-29 15/02S	26,244.39
	156,545.28	100.000 ACRISURE LLC 7.0 17-25 15/11S	45,646.16
カナダ		25.000 ACRISURE LLC 0.125 19-26 01/08S	99,867.62
200.000 1011778 BC UNLIMITED 4.0000 20-30 15/10S	1,876,744.88	17.000 ACUSHET COMPANY DEL 7.375 23-28 10/15S	26,147.70
50.000 BAFFINLAND IRON MINES 8.75 18-26 15/07A	180,150.76	17.000 ADAMS HOMES 7.50 20-25 15/02S	16,951.01
50.000 BAUSCH & LOMB E 8.3750 23-28 01/10S	47,037.34	25.000 ADAMS HOMES 9.25 23-28 15/10S	25,441.37
75.000 BAUSCH HEALTH 5.2500 19-30 30/01S	52,846.64	53.000 ADTALEM ESCROW CORP 5.50 21-28 01/03S	51,442.49
25.000 BAUSCH HEALTH 6.2500 20-29 15/02S	33,807.96	50.000 ADT SEC CORP 4.1250 21-29 01/08S	46,322.15
75.000 BAUSCH HEALTH 7.0000 19-28 15/01S	11,001.54	25.000 ADVANCED DRAINAGE 6.3750 22-30 15/06S	25,369.64
46.000 BAUSCH HEALTH 9.00 17-25 15/12S	32,793.04	25.000 ADVANCED DRAINAGE 5 19-27 30/09S	24,323.24
50.000 BAUSCH HEALTH CO 8.75 23-30 30/05S	43,043.76	25.000 AETHON UNATHIN UN F 8.25 21-26 15/02S	25,221.67
50.000 BAUSCH HEALTH COM 5.75 19-27 15/08S	22,991.37	50.000 AFFINITY GAMING 6.8750 20-27 15/12S	44,723.30
50.000 BAUSCH HEALTH COMPANIE 5.25 20-31 15/02S	32,352.18	100.000 AG ISSUER LLC 6.25 20-28 01/03S	99,596.23
150.000 BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S	22,063.48	25.000 AHP HEALTH PARTNERS 5.75 21-29 15/07S	21,867.10
25.000 BOMBARDIER 8.75 23-30 15/11S	150,381.76	75.000 ALBERTSONS COMPANIES 4.625 19-27 15/01S	72,863.98
50.000 BOMBARDIER INC 6.0 21-28 15/02S	26,694.88	175.000 ALBERTSONS COMPANIES 4.875 20-30 15/02S	168,072.42
50.000 BOMBARDIER INC 7.1250 21-26 15/06S	48,750.06	50.000 ALLEGHENY TECHN 4.8750 21-29 01/10S	46,941.43
50.000 BROOKFIELD RESIDEN 5.00 21-29 15/06S	25,050.29	50.000 ALLEGHENY TECHN 5.1250 21-31 01/10S	46,741.03
50.000 EMPIRE COMMUNIT 7.0000 20-25 15/12S	44,798.43	25.000 ALLEGHENY TECHNO 5.875 19-27 01/12S	24,716.84
25.000 GARDA WORLD SECURITY 4.625 20-27 15/02S	49,569.73	25.000 ALLEGIANTE TRAVEL 7.25 22-27 15/08S	24,653.77
100.000 GARDA WORLD SECURITY 6.0 21-29 01/06S	24,065.24	25.000 ALLEN MEDIA LLC 10.5 20-28 15/02S	13,357.72
25.000 GFL ENVIRONMENTAL 6.75 23-31 15/01S	90,036.43	150.000 ALLIED UNIVERSAL 6.625 19-26 15/07S	149,615.73
25.000 GOEASY 9.25 23-28 01/12S	25,799.17	175.000 ALLIED UNIVERSAL 9.75 19-27 15/07S	171,632.35
50.000 INTELLIGENT PACKAGING 6.00 20-28 15/09S	26,755.43	25.000 ALLISON TRANSMI 3.7500 20-31 30/01S	22,097.82
50.000 MATTAMY GROUP 4.625 20-30 01/03S	46,844.54	50.000 ALLY FINANCIAL INC 6.70 23-33 14/02S	50,075.39
25.000 METHANEX CORP 5.125 20-27 15/10S7 15/10S	46,413.51	25.000 ALTA EQUIPMENT GROUP 5.625 21-26 15/04S	24,300.28
25.000 NOVA CHEMICALS CORP 4.2500 21-29 15/05S	24,439.50	100.000 AMC NETWORKS INC 4.25 21-29 15/02S	77,362.48
32.000 NOVA CHEMICALS CORP 5.25 17-27 01/06S66S	21,170.50	25.000 AMC NETWORKS INC 4.75 17-25 01/08S	24,317.32
50.000 OPEN TEXT CORP 3.8750 20-28 15/02S	30,056.47	50.000 AMERICAN AIRLIN 8.5000 23-29 15/05S	53,004.30
75.000 OPEN TEXT CORP 3.875 21-29 01/12S	46,485.96	25.000 AMERICAN CAMPUS 4.00 19-28 15/01S	23,743.84
50.000 PARKLAND CORP 4.6250 21-30 01/05S	67,354.43	64.000 AMERIGAS PART/FIN 5.50 16-25 20/05S	63,242.54
125.000 PARKLAND CORPORATION 4.5 -21-29 01/10S	46,346.68	25.000 AMERITEX HOLDCO 10.2500 23-28 15/10	25,721.91
25.000 PARKLAND FUEL CORP 5.875 19-27 15/07S	115,433.59	25.000 AMKOR TECHNOLOGY INC 6.625 19-27 15/09S	25,268.09
	24,939.76	75.000 AMN HEALTHCARE 4.0000 20-29 15/04S	68,186.27
		25.000 AMN HEALTHCARE 4.625 19-27 01/10S	23,848.25
		25.000 ANTERO MIDSTREAM 5.375 21-29 15/06S	24,090.48
		25.000 ANTERO MIDSTREAM 5.750 19-27 01/03S	24,857.72



ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
50.000	ANTERO MIDSTREAM 7.875 20-26 15/05S	51,371.25	475.000	CARNIVAL CORP 5.75 21-27 01/03S	463,787.28
25.000	API ESCROW CORP 4.75 21-29 15/10S	23,476.93	150.000	CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S	152,761.98
75.000	API GROUP DE INC 4.125 21-29 15/07S	68,855.45	50.000	CARNIVAL CORPORATION 6.65 98-28 15/01S	48,180.62
25.000	APX GROUP INC 5.7500 21-29 15/07S	23,415.08	100.000	CARNIVAL CORPORATION 6 21-29 01/05S	96,222.00
25.000	ARCHES BUYER 4.250 20-28 01/06S	22,697.75	25.000	CARNIVAL CORPORATION 7.00 23-29 15/08S	26,108.00
75.000	ARCHROCK PARTNE 6.2500 19-28 01/04S	74,077.76	75.000	CARPENTER TECHNOLOGY 6.375 20-28 15/07SS	75,372.80
25.000	ARCHROCK PARTNE 6.8750 19-27 01/04S	25,146.70	25.000	CARRIAGE SERVIC 4.2500 21-29 15/05S	22,227.31
25.000	ARKO CORP 5.125 21-29 15/11S	21,735.67	50.000	CARROLS RESTAURANT GR 5.875 21-29 01/07S	44,142.14
50.000	ARSENAL AIC PAR 8.0000 23-30 01/10S	52,656.98	100.000	CASTLE US HOLDING CORP 9.5 20-28 15/02S	51,968.00
25.000	ASBURY AUTOMOTIVE 4.6250 21-29 15/11S	23,211.77	25.000	CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.25 20-31 01/02S	21,867.18
25.000	ASBURY AUTOMOTIVE 4.75 20-30 01/03S	23,386.26	225.000	CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.50 21-33 01/06S	190,332.44
75.000	ASGN INCORPORAT 4.6250 19-28 15/05S	71,593.39	145.000	CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S	124,523.07
50.000	ASHTON WOODS US 4.6250 21-30 01/04S	45,244.02	100.000	CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.75 19-30 01/03S	91,532.77
75.000	ASHTON WOODS USA LLC 6.625 20-28 15/01S	73,475.01	25.000	CCO HLDG LLC/CAPITAL 5.375 19-29 01/06S	23,681.53
25.000	ASSUREDPARTNERS 5.6250 20-29 15/01S	23,413.70	350.000	CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S	308,974.97
25.000	ATI 7.25 23-30 15/08S	26,088.73	50.000	CCO HOLDINGS 5 17-28 01/02S 17-28 01/02S	47,924.78
25.000	AUSTIN BIDCO INC 7.125 20-28 15/12S	21,558.84	150.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO 4.25 21-34 15/01S	122,114.28
100.000	AVANTOR FUNDING INC 3.8750 21-29 01/11S	91,095.26	100.000	CCO HOLDLLCCCO HOLD C 6.375 22-29 01/09S	98,788.63
75.000	AVANTOR FUNDING INC 4.6250 20-28 15/07S	72,233.41	100.000	CDI ESCROW ISSU 5.7500 22-30 01/04S	97,492.07
50.000	AVIENT CORP 7.125 22-30 01/08S	51,925.93	50.000	CDR FR/CND WNDR 6.5 21-28 01/10S	50,063.98
25.000	AVIS BUDGET CAR 5.750 19-27 15/07S	24,299.28	50.000	CDW LLC CDW FINANCE 3.25 20-29 15/02S	45,773.45
75.000	AVIS BUDGET CAR RENT 4.75 21-28 23/03S	69,578.07	25.000	CEC ENTERTAINMENT 6.75 21-26 01/05S	24,507.71
25.000	B&G FOODS INC 8.0 23-28 15/09S	26,335.96	50.000	CEDAR FAIR LP CANADA 5.25 20-29 15/07S	47,245.16
50.000	BALL CORP 6.0000 23-29 15/06S	51,095.18	125.000	CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S	120,819.04
100.000	BALL CORP 6.875 22-28 15/03S	103,851.10	50.000	CENTERFIELD MEDIA PAR 6.625 21-26 01/08S	35,555.92
50.000	BASIC EN SE ES 10.75 GTD SNR SEC PERP USD	250.00	25.000	CENTRAL GARDEN & PET 4.125 20-30 15/10S	22,778.87
125.000	BATH&BODY WORKS INC 6.75 16-36 01/07S	126,304.14	25.000	CENTRAL GARDEN & PET 4.125 21-31 30/04S	22,192.35
75.000	BCPE EMPIRE HOLDINGS 7.625 21-27 01/05S	72,616.88	25.000	CENTURY COMMUNI 6.7500 20-27 01/06S	25,326.08
50.000	BEACON ROOFING 4.125 21-29 15/05S	45,651.82	25.000	CENTURY COMMUNITIES I 3.875 21-29 15/08S	22,656.37
25.000	BEACON ROOFING 4.5000 19-26 15/11S	24,319.92	25.000	CHENIERE ENERGY 3.2500 22-32 30/01S	21,322.04
25.000	BEACON ROOFING SUPPL 6.5 23-30 01/08S	25,681.69	25.000	CHENIERE ENERGY PARTNER 4.0 21-31 01/03S	22,760.78
75.000	BEAZER HOMES USA INC 7.25 19-29 15/10S	75,939.88	75.000	CHS/COMMUNITY H 5.2500 22-30 15/05S	62,761.47
50.000	BELLRING BRANDS 7.0000 22-30 15/03S	52,054.87	75.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 4.75 21-31 15/02S	59,178.31
50.000	BERRY GLOBAL INC 4.50 18-26 15/02S	48,887.35	50.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 5.625 20-27 15/03S	46,527.12
51.000	BIG RIVER STEEL 6.6250 20-29 31/01S	52,061.34	50.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 6.00 20-29 15/01S	45,049.09
75.000	BLACKSTONE MORTGAGE 3.750 21-27 15/01S	67,207.52	75.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 6.125 21-30 01/04S	48,450.35
50.000	BLUE RACER MIDSTREAM 7.625 20-25 15/12S	50,715.41	125.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 6.875 21-29 15/04S	81,724.02
100.000	BOYD GAMING COR 4.75 21-31 15/06S	92,027.65	29.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 8.00 19-27 15/12S	28,237.88
25.000	BRAND ENERGY INFRAS 10.375 23-30 01/08S	26,541.96	50.000	CHS/COMMUNITY HEALTH 8.0 19-26 15/03S	49,944.25
25.000	BREAD FINANCIAL 9.7500 23-29 15/03S	25,930.27	100.000	CHS COMMUNITY HEALTH 10.875 23-32 15/01S	105,059.37
25.000	BRIGHTSTAR ESCROW COR 9.75 20-25 15/10S	25,395.13	20.000	CHS COMMUNITY HEALTH 6.875 19-28 01/04S	12,392.56
50.000	BRISTOW GROUP I 6.8750 21-28 01/03S	48,408.87	50.000	CHURCHILL DOWNS INC 5.50 19-27 01/04S	49,512.89
50.000	BTH & BDY WRKS 6.6250 20-30 01/10S	51,235.96	75.000	CINEMARK USA 5.25 21-28 15/07S	68,926.80
175.000	BUILDERS FIRSTS 4.2500 21-32 01/02S	158,059.03	50.000	CINEMARK USA INC 5.875 21-26 16/03S	49,225.31
50.000	BUILDERS FIRSTS 5.0000 20-30 01/03S	48,344.13	75.000	CITGO PETROLEUM 6.3750 21-26 15/06S	74,870.59
25.000	BUILDERS FIRSTSOURCE 6.375 22-32 15/06S	25,734.94	50.000	CITGO PETROLEUM 7.0 20-25 15/06S	49,934.64
225.000	CAESARS ENTERTAINMENT 4.625 21-29 15/10S	203,618.20	50.000	CITGO PETROLEUM CORP 8.375 23-29 15/01S	51,526.96
25.000	CAESARS ENTERTAINMENT 5.75 20-25 01/07SS	24,996.01	150.000	CLEAR CHANNEL OUTDOOR 5.125 19-27 15/08S	143,295.85
50.000	CAESARS ENTERTAINMENT 6.25 20-25 01/07S	50,056.43	25.000	CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.50 21-29 01/06S	20,768.64
50.000	CALPINE CORP 5.00 20-31 01/02S	45,918.57	75.000	CLEAR CHANNEL OUTDOOR 7.750 21-28 15/04S	64,910.58
75.000	CALPINE CORP 5.125 19-28 15/03S	71,924.88	25.000	CLEARWAY ENERGY 3.7500 21-32 15/01S	21,749.28
25.000	CARGO AIRCRAFT MANAG 4.750 20-28 01/02S	22,884.45	50.000	CLEARWAY ENERGY 4.7500 19-28 15/03S	48,275.58

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
75.000	CLEVELAND CLIFFS 5.875 20-27 01/06S	74,857.28	25.000	DUN AND BRADSTREE 5.0000 21-29 15/12S	23,360.46
25.000	CLEVELAND-CLIFFS INC 4.625 21-29 01/03S	23,252.53	100.000	EDGEWELL PERSONAL CAR 4.125 21-29 01/04S	91,463.37
25.000	CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875 21-31 01/03S	22,705.99	25.000	ENACT HOLDINGS INC 6.5000 20-25 15/08S	24,967.21
100.000	CLOUD SOFTWARE 6.5000 22-29 31/03S	95,401.76	50.000	ENCOMPASS HEALTH 4.75 19-30 01/02S	47,145.61
125.000	CLOUD SOFTWARE 9.0000 23-29 30/09S	118,886.90	25.000	ENDURANCE ACQ M 6.0000 21-29 15/02S	18,944.46
50.000	COEUR MINING IN 5.1250 21-29 15/02S	46,054.72	25.000	ENERGIZER 6.5 22-27 31/12S	25,060.89
50.000	COGENT COMMUNIC 7.0000 22-27 15/06S	50,612.51	75.000	ENLINK MIDSTREAM 4.85 16-26 15/07S5/07S	73,900.06
75.000	COHERENT CORP 5.0000 21-29 15/12S	71,310.00	50.000	ENLINK MIDSTREAM 5.45 17-47 01/06S1/06S	44,164.76
125.000	COINBASE GLOBAL 3.6250 21-31 01/10S	95,974.05	50.000	ENLINK MIDSTREAM 5.6 14-44 01/10S01/04S	44,161.32
100.000	COINBASE GLOBAL INC 3.375 21-28 01/10S	83,609.54	50.000	ENLINK MIDSTREAM 6.5 22-30 01/09S	51,074.02
50.000	COLT MERGER SUB INC 8.1250 20-27 01/07S	51,299.65	50.000	ENLINK MIDSTREAM PART 5.05 14-45 01/04S	41,559.48
25.000	COMMERCIAL META 4.1250 22-30 15/01S	23,015.64	50.000	ENLINK MIDSTREAM PART 5.375 19-29 01/06S	49,008.61
25.000	COMMERCIAL METALS CO 4.375 22-32 15/03S	22,629.12	25.000	ENLINK MIDSTREAM PART 5.625 20-28 15/01S	24,694.92
75.000	COMMSCOPE INC 7.125 20-28 01/07S	36,150.09	75.000	EQM MIDSTREAM 4.50 21-29 15/01S	71,091.30
25.000	COMMSCOPE TECH 144A 6.00 15-25 15/06S	20,414.50	50.000	EQM MIDSTREAM PART 4.75 21-31 15/01S1S	46,720.58
25.000	COMPASS GROUP 5.0000 21-32 15/01S	22,653.49	25.000	EQM MIDSTREAM PART 5.50 18-28 15/07S	24,901.79
50.000	COMPASS GROUP D 5.2500 21-29 15/04S	46,780.21	25.000	EQM MIDSTREAM PART 6.00 20-25 01/07S	25,068.73
25.000	COMPASS MINERALS 6.75 19-27 01/12S	24,868.05	50.000	EQM MIDSTREAM PART 6.50 18-48 15/07S	51,697.90
25.000	CONSENSUS CLOUD 6.5000 21-28 15/10S	22,869.99	25.000	EQM MIDSTREAM PART 6.50 20-27 01/07S	25,574.03
25.000	CONSOLIDATED COMM INC 6.5 20-28 01/10S	21,656.46	50.000	EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-27 01/06S06S	51,679.37
25.000	CORNERSTONE BUI 6.1250 20-29 15/01S	20,813.25	50.000	EQM MIDSTREAM PART 7.5 22-30 01/06S	53,948.75
25.000	COTY/HFC PRESTI 6.6250 23-30 15/07S	25,781.61	25.000	EVERI HOLDINGS 5.0000 21-29 15/07S	22,841.99
50.000	COVANTA HOLDING 5.00 20-30 01/09S	42,930.55	50.000	FAIR ISAAC CORP 4.0000 19-28 15/06S	47,391.44
25.000	CREDIT ACCEPTANCE 9.2500 23-28 15/12S	26,724.21	125.000	FERRELLGAS 5.375 21-26 01/04S	122,578.13
50.000	CRESTWOOD MIDSTREAM 6.00 21-29 01/02S	50,433.29	25.000	FERRELLGAS 5.875 21-29 01/04S	23,670.36
25.000	CROCS INC 4.125 21-31 15/08S	21,272.25	25.000	FERTITTA ENTERT 6.7500 22-30 15/01S	22,000.32
50.000	CROCS INC 4.25 21-29 15/03S	44,945.19	25.000	FERTITTA ENTERTMT FIN 4.625 22-29 15/01S	22,749.33
25.000	CROWN AMERICAS LLC4.7519-26 01/02S	24,826.91	50.000	FIRSTCASH HOLDINGS 4.625 20-28 01/09S09S	46,717.48
25.000	CROWN AMERICAS LLC 5.25 23-30 01/04S	24,622.73	25.000	FIRSTCASH INC 5.6250 21-30 01/01S	23,952.65
25.000	CROWN HOLDINGS INC 7.375 96-26 15/12S	26,409.30	25.000	FORD MOTOR CO 3.25 21-32 12/02S32 12/02S	20,814.60
200.000	CSC HOLDINGS LLC 4.5 21-31 15/11S	151,444.02	200.000	FORD MOTOR CO 4.75 13-43 15/01S3 15/01S	165,533.57
200.000	CSC HOLDINGS LLC 6.5 19-29 01/02S	178,282.38	75.000	FORD MOTOR CO 5.291 16-46 08/12S 08/12S	66,448.90
50.000	CS GROUP 5.00 20-28 15/12S	40,756.43	50.000	FORD MOTOR COMPANY 6.10 22-32 19/08S	50,498.86
25.000	DANA INC 4.5000 21-32 15/02S	21,914.45	500.000	FORD MOTOR CREDIT CO 5.1130 19-29 03/05S	487,015.93
75.000	DARLING INGREDI 6.0000 22-30 15/06S	75,053.01	50.000	FORESTAR GROUP INC 3.85 21-26 15/05S	47,830.09
75.000	DAVITA INC 4.6250 20-30 01/06S	65,808.40	50.000	FORESTAR GROUP INC 5.00 20-28 01/03S	48,004.40
25.000	DEALER TIRE LLC/DT 8.0 20-28 01/02S	24,828.94	25.000	FORTRESS TRANSPORT 5.50 21-28 01/05S	24,090.73
25.000	DELEK 6.75 18-25 15/05S	24,777.09	57.000	FORTRESS TRANSPORT 6.50 18-25 01/10S	56,946.01
50.000	DELEK LOGISTICS PARTN 7.125 21-28 01/06S	47,454.27	50.000	FOUNDATION BUIL 6.0000 21-29 01/03S	45,296.27
25.000	DELTA AIR LINES INC 7.375 20-26 12/06S	25,985.44	21.000	FOXTROT ESCROW ISSUER 12.25 19-26 15/11S	18,845.58
150.000	DIRECTV FINANCING LLC 5.875 21-27 15/08S	140,945.92	50.000	FREEDOM MORTGAG 6.0000 23-28 01/10	54,619.17
75.000	DISH DBS CORPORATION 5.125 21-29 01/06S	38,746.80	75.000	FREEDOM MORTGAGE 6.625 23-27 15/01S	71,572.40
100.000	DISH DBS CORPORATION 5.25 21-26 01/12S2S	86,030.00	75.000	FREEDOM MORTGAGE 7.625 23-26 01/05S	74,175.68
25.000	DISH DBS CORPORATION 5.75 21-28 01/12S	20,285.10	50.000	FREEDOM MORTGAGE CO 12.25 23-30 01/10S	54,973.82
75.000	DISH DBS CORPORATION 7.375 20-28 01/07S	45,280.79	50.000	FREEPORT MCMORAN 4.375 20-28 01/08S	48,174.33
125.000	DISH NETWORK CORP 11.75 22-27 15/11S	130,545.39	150.000	FRONTIER COM CORP 5.875 20-27 15/10S5/10	144,960.56
14.000	DIVERSIFIED HEALTH 9.75 20-25 15/06S	13,785.07	25.000	FRONTIER COMMUN 6.0000 21-30 15/01S	21,330.72
42.000	DOMTAR CORP 6.75 21-28 01/10S1-28 01/10S	37,988.87	25.000	FRONTIER COMMUNICATI 5.875 21-29 30/04S	21,215.39
100.000	DORNOCH DEBT ME 6.6250 21-29 15/10S	90,224.33	75.000	FRONTIER COMMUNICATION 5.00 20-28 01/05S	69,356.52
25.000	DREAM FINDERS H 8.2500 23-28 15/08S	26,509.07	100.000	FRONTIER COMMUNICATION 6.75 20-29 01/05S	89,512.11
25.000	DT MIDSTREAM INCORPOR 4.375 21-31 15/06S	22,619.06	50.000	FULL HOUSE RESORTS INC 8.25 21-28 15/02S	47,277.16
25.000	DTZ US BORROWER LLC 8.875 23-31 01/09S	26,480.65	50.000	GAP INC 3.625 21-29 01/10S	42,771.12

ストラクチャ-米国ハイ・イールド・ボンド

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
50.000	GCI LLC 4.75 20-28 15/10S	46,195.93	75.000	IHEARTCOMMUNICATIONS 05.00 19-27 15/08S	59,623.68
25.000	GENESIS ENERGY 8.8750 23-30 15/04S	25,911.34	25.000	IHEARTCOMMUNICATIONS 8.375 19-27 01/05S	16,269.04
25.000	GENESIS ENERGY LP 8.25 23-29 15/01S	25,764.63	25.000	ILLUMINATE BUYER LLC 9.0 20-28 01/07S	24,178.58
25.000	GLATFELTER CORP 4.75 21-29 15/11S 15/11S	17,512.06	250.000	IMOLA MERGER CO 4.7500 21-29 15/05S	237,427.50
25.000	GO DADDY OPCO/GD FIN CO 3.5 21-29 01/03S	22,669.29	50.000	INGLES MARKETS 4.0000 21-31 15/06S	44,292.73
75.000	GO DADDY OPERATING COM 5.25 19-27 01/12S	73,642.83	25.000	INNOFOS HOLDINGS INC 9.375 20-28 15/02S	22,804.40
125.000	GOLDEN ENTERTAI 7.6250 19-26 15/04S	125,949.41	50.000	INSTALLED BUILDING 5.75 19-28 01/02S	49,006.64
50.000	GOODYEAR TIRE 5.625 21-33 30/04S3 30/04S	44,910.75	25.000	IQVIA INC 6.25 23-29 01/02S	26,121.56
75.000	GOODYEAR TIRE 9.5 20-25 31/05S25 31/05S	76,420.40	75.000	IRON MOUNTAIN INC 4.5000 20-31 15/02S	68,335.57
25.000	GOODYEAR TIRE AND RUBB 5.00 22-29 15/07S	23,642.93	25.000	IRON MOUNTAIN INC 5.0000 20-28 15/07S	24,083.11
75.000	GOODYEAR TIRE RUBBER 5.25 22-31 15/07S	68,370.69	150.000	IRON MOUNTAIN INC 5.2500 20-30 15/07S	142,807.87
75.000	GPS HOSPITALITY HOLDING 7 21-28 15/08S	55,482.00	25.000	IRON MOUNTAIN INC 5.25 17-28 15/03S	24,367.43
25.000	GRAPHIC PACKAGING 4.75 19-27 15/07S	24,390.15	125.000	IRON MOUNTAIN INFORMATI 5.0 21-32 15/07S	114,666.67
100.000	GRAY ESCROW II 5.3750 21-31 15/11S	75,511.01	50.000	ITT HOLDINGS LLC 6.5 21-29 01/08S	44,282.09
100.000	GRAY TELEVISION INC 4.75 20-30 15/10S	75,820.38	75.000	JACOBS ENTERTAI 6.7500 22-29 15/02S	71,085.30
25.000	GREYSTAR REAL E 7.7500 23-30 01/09S	26,469.07	50.000	JANE STREET GRP 4.5000 21-29 15/11S	46,725.07
100.000	GRIFFON 5.75 20-28 01/03S	98,469.00	50.000	JEFFERSON CAPITAL HOLDING 6 21-26 15/08S	47,862.30
75.000	HARVEST MIDSTREAM 7.5 20-28 01/09S	75,098.19	23.000	JELD-WEN INC 4.625 17-25 15/12S	22,355.90
25.000	HAT HLDG I LLC HAT II 8.00 23-27 15/06S	26,036.96	25.000	JP POINDEXT 8.7500 23-31 15/12S	25,563.18
25.000	HAT HOLDINGS I LLC 3.375 21-26 15/06S	23,599.40	25.000	KAISER ALUMINUM 4.6250 19-28 01/03S	21,183.32
25.000	HAT HOLDINGS I LLC 3.75 20-30 15/09S	21,046.23	25.000	KAISER ALUMINUM CORP 4.500 21-31 01/06S	21,578.41
50.000	HELIX ENERGY SOLUTIO 9.75 23-29 01/03S	52,622.26	50.000	KB HOME 4.000 21-31 15/06S	45,115.47
100.000	HERTZ CORP 5.0 21-29 01/12S	82,184.86	50.000	KB HOME 6.875 19-27 15/06S	52,060.83
100.000	HESS MIDSTREAM PART 5.125 19-28 15/06S	96,793.23	25.000	KB HOME 7.25 22-30 15/07S	26,088.44
50.000	HILCORP ENERGY 6.0000 21-31 01/02S	48,206.53	25.000	KEN GARFF AUTOM 4.8750 20-28 15/09S	23,798.26
25.000	HILCORP ENERGY 6.0000 22-30 15/04S	24,274.23	50.000	KENNEDY WILSON INC 4.75 21-30 01/02S	40,317.71
25.000	HILCORP ENERGY 6.2500 18-28 01/11S	24,973.76	50.000	KINETIK HOLDING 5.8750 22-30 15/06S	49,117.17
50.000	HILCORP ENERGY 8.3750 23-33 01/11S	53,288.58	25.000	KONTOOR BRANDS 4.1250 21-29 15/11S	22,729.75
125.000	HILTON DOMESTIC 3.620 21-32 15/02S	108,987.29	25.000	KRONOS ACQUISITION7.0 20-27 31/12S	23,910.37
25.000	HILTON DOMESTIC 3.75 20-29 01/05S	23,185.86	25.000	LABL INC 5.8750 21-28 01/11S	22,697.50
100.000	HILTON DOMESTIC 4.0 20-31 01/05S	91,682.21	25.000	LABL INC 8.2500 21-29 01/11S	21,391.34
100.000	HILTON DOMESTIC 4.875 19-30 15/01S	97,010.67	50.000	LADDER CAP FIN 4.25 20-27 01/02S	47,177.66
75.000	HILTON DOMESTIC 5.75 20-28 01/05S	75,189.17	25.000	LADDER CAP FIN 4.7500 21-29 15/06S	22,559.44
100.000	HILTON GRAND VACATION 4.875 21-31 01/07S	88,456.27	25.000	LAMAR MEDIA CORPORAT 4.00 20-30 15/02S	23,140.96
75.000	HILTON GRAND VACATIONS BO 5 21-29 01/06S	69,292.68	25.000	LAMAR MEDIA CORPORATIO 3.75 20-28 15/02S	23,612.36
50.000	HLF FIN SARL LLCHERB 4.875 21-29 01/06S	39,285.77	50.000	LAMB WESTON HOLDINGS 4.125 21-30 31/01S	46,181.32
50.000	HOLLYFRONTIER CORP 5.00 23-28 01/02S	48,464.14	50.000	LAMB WESTON HOLDINGS 4.375 21-32 31/01S	45,685.56
50.000	HOLLYFRONTIER CORP 6.375 23-27 15/04S	50,480.77	100.000	LBM ACQUISITION 6.2500 20-29 15/01S	89,165.58
100.000	HOWARD HUGUES CORP 4.125 21-29 01/02S	90,248.00	25.000	LCM INVESTMENTS 8.2500 23-31 01/08S	26,194.58
25.000	HOWARD HUGUES CORP 4.375 21-31 01/02S	21,969.13	75.000	LCM INVESTM HLDS II 4.875 21-29 01/05S	69,955.91
50.000	HOWARD HUGUES CORP 5.375 20-28 01/08S	48,266.70	25.000	LEEWARD RENEWAB 4.2500 21-29 01/07S	21,760.94
50.000	HOWARD MIDSTREAM ENE 6.75 21-27 15/01S	49,733.15	13.000	LEVEL 3 FINANCING 10.50 23-30 15/05S	12,715.90
16.000	HOWMET AEROSPACE INC 5.90 07-27 01/02S	16,429.41	50.000	LEVEL 3 FINANCING INC 3.75 21-29 15/07S	21,132.64
25.000	HOWMET AEROSPACE INC 5.95 07-37 01/02S	26,183.36	100.000	LEVEL 3 FINANCING INC 4.25 20-28 01/07S	49,813.05
50.000	HOWNET AEROSPACE INC 5.125 14-24 01/10S	49,943.47	50.000	LEVEL 3 FINANCING INC 4.625 19-27 15/09	30,317.24
25.000	HUB INTERNATION 5.6250 21-29 01/12S	23,970.95	25.000	LGI HOMES INC 8.7500 23-28 15/12S	26,616.14
65.000	HUGHES SAT SYS CORP 6.625 17-26 01/08S	51,307.61	25.000	LIFEPOINT HEALTH INC 11 23-30 15/10S	26,410.48
25.000	ICAHN ENTER 4.375 21-29 01/02S	20,905.24	50.000	LIFEPOINT HEALTH INC 5.375 20-29 15/01S	37,047.63
25.000	ICAHN ENTERPRIS 9.7500 23-29 15/01S	25,572.26	25.000	LIFEPOINT HEALTH INC 9.875 23-30 15/08S	25,424.08
100.000	ICAHN ENTERPRISES LP 5.25 19-27 15/05S	90,710.56	125.000	LIFE TIME INC 5.7500 21-26 15/01S	124,113.27
100.000	ICAHN ENTERPRISES LP 6.25 19-26 15/05S	95,615.92	175.000	LIFE TIME INC 8.00 21-26 15/04S	177,439.92
50.000	IHEARTCOMMUNI 6.375 19-26 01/05S	42,681.88	25.000	LIGHT & WONDER 7.5000 23-31 01/09S	26,156.33

ストラクチャー・米国ハイ・イールド・ボンド

数量	評価額 米ドル	数量	評価額 米ドル
25.000	LINDBLAD EXPEDITIO LLC 6.75 22-27 15/02S	25.000	NABORS INDUSTRIES INC 5.75 18-24 03/01S
100.000	LITHIA MOTORS INC 3.875 21-29 01/06S	10.000	NATHAN'S FAMOUS IN 6.625 17-25 01/11S
50.000	LITHIA MOTORS INC 4.625 19-27 15/12S	25.000	NATIONSTAR MORTGAGE HO 5.75 21-31 15/11S
100.000	LIVE NATION ENTERT 4.75 19-27 15/10S	25.000	NATIONSTAR MTG 5.125 20-30 15/12S
75.000	LIVE NATION ENTERT 5.625 18-26 15/03U	75.000	NATIONSTAR MTG 5.5 20-28 15/08S
100.000	LOGAN MERGER SUB INC 5.5 20-27 01/09S	25.000	NATIONSTAR MTG 6.0000 20-27 15/01S
25.000	LSB INDUSTRIES 6.2500 21-28 15/10S	25.000	NATL FI 7.5 22-30 01/10S
50.000	LSF9 ATL HLDG/V 7.7500 21-26 15/02S	25.000	NAVIENT 11.5 23-31 15/03S
75.000	LUCENT TECHNOLOGIES 6.45 99-29 15/03S	50.000	NAVIENT 9.375 23-30 25/07S
25.000	LUMEN TECHNOLOGIES 7.995 06-36 01/06S06S	25.000	NAVIENT CORP 5.00 20-27 15/03S
25.000	MACY'S RETAIL H 5.8750 22-30 15/03S	100.000	NAVIENT CORP 5.5 21-29 15/03S
75.000	MACYS RETAIL HLDG 5.875 21-29 01/04S	75.000	NAVIENT CORP 5.8750 14-24 25/10S
75.000	MACYS RET HLDG INC 5.125 12-42 15/01SS	100.000	NAVIENT CORP 6.75 17-25 25/06S
25.000	MACYS RET HLDG INC 6.375 07-37 15/03SS	50.000	NAVIENT CORP 6.75 18-26 15/06S
50.000	MADISON IAQ LLC 5.875 21-29 30/06S	25.000	NCL 7.75 22-29 15/02S
25.000	MAGIC MERGERCO INC 5.250 21-28 01/05S	125.000	NCL CORP LTD 5.875 20-26 15/03S
75.000	MAJORDRIVE HOLDING IV 6.375 21-29 01/06S	25.000	NCL CORPORATION 8.1250 23-29 15/01S
25.000	MATCH GROUP HLD 4.1250 20-30 01/08S	25.000	NCL FINANCE LTD6.125 21-28 15/03S
50.000	MATCH GROUP INC 5.00 17-27 15/12S	75.000	NCR ATLEOS ESCROW 9.50 23-29 01/04S
25.000	MATTEL INC 3.375 21-26 19/03S	50.000	NCR VOYIX 5.00 20-28 01/10S
50.000	MATTEL INC 5.45 11-41 01/11S	100.000	NCR VOYIX 5.125 21-29 15/04S
25.000	MATTHEWS INTERNATIONAL 5.25 17-25 01/12S	25.000	NCR VOYIX 5.25 20-30 01/10S
25.000	MAUSER PACKAGIN 9.2500 23-27 15/04S	50.000	NESCO HOLDINGS II INC 5.5 21-29 15/04S
50.000	MAV ACQUISITION CORP 8 21-29 01/08S	125.000	NEWELL BRANDS INC 4.70 16-26 01/04S
32.000	MERITAGE HOME CORP 6 15-25 01/06S/06S	25.000	NEWELL BRANDS INC 5.375 16-36 01/04S
125.000	METIS MERGER SUB LLC 6.5 21-29 15/06S	50.000	NEWELL BRANDS INC 5.5 16-46 01/04S01/04S
75.000	MGIC INVESTMENT CORP 5.25 20-28 15/08S8S	25.000	NEWELL BRANDS INC 6.375 22-27 15/09S/09S
25.000	MGM RESORTS INTL 4.7500 20-28 15/10S	25.000	NEWELL BRANDS INC 6.6250 20-29 15/09S
50.000	MGM RESORTS INTL 5.5 19-27 15/04S	50.000	NEW ENTERPRISE 5.2500 21-28 15/07S
25.000	MGM RESORTS INTL 5.75 18-25 18/06S	50.000	NEW ENTERPRISE 9.7500 20-28 15/07S
50.000	MIDCONTINENT CO 5.3750 19-27 15/08S	175.000	NEWS 5.125 22-32 15/02S
25.000	MIDWEST GAMING BORRO 4.875 21-29 01/05S	50.000	NEWS CORP 3.875 21-29 15/05S
50.000	MINERALS TECHNOLOGIE 5.00 20-28 01/07S	3.000	NEXETERA ENERGY 144A 4.25 17-24 15/09S
100.000	MINERVA MERGER 6.5000 22-30 15/02S	50.000	NEXSTAR BROADCA 4.7500 20-28 01/11S
25.000	MIWD HOLDCO II 5.5 22-30 01/02S	25.000	NEXSTAR ESCROW 5.6250 19-27 15/07S
25.000	MODIVCARE 5.00 21-29 01/10S	25.000	NEXTERA ENERGY OPER 3.875 19-26 15/10S0S
50.000	MOHEGAN TRIBAL GAM 8.00 21-26 01/02S	25.000	NFP CORP 4.8750 21-28 15/08S
125.000	MOLINA HEALTHCARE 3.8750 21-32 15/05S	50.000	NFP CORP 6.875 20-28 15/08S
50.000	MOLINA HEALTHCARE INC 0.875 20-30 15/11S	25.000	NFP CORP 8.5000 23-31 01/10S
49.000	MOSS CREEK RESOU HLD 7.5 18-26 15/01S	100.000	NGL ENERGY 7.50 21-26 01/02S
25.000	MOSS CREEK RESOURCES 10.5 19-27 15/05S	50.000	NMI HOLDINGS 7.3750 20-25 01/06S
125.000	MOZART DEBT MERGER 3.875 21-29 01/04S	25.000	NORDSTROM INC 4.3750 19-30 01/04S
125.000	MOZART DEBT MERGER 5.25 21-29 01/10S	25.000	NORTHWEST FIBER 4.7500 21-27 30/04S
50.000	MPH ACQUISITION 144A 5.75 29-28 01/11S	50.000	NORTONLIFELOCK INC 6.75 -27 30/09S
100.000	MPT OPER PARTNER 5.00 17-27 15/10S	50.000	NORTONLIFELOCK INC 7.125 -30 30/09
50.000	MPT OPER PARTNERSHIP 3.500 20-31 15/03S	50.000	NOVELIS CORP 3.25 21-26 11/08S
50.000	MPT OPER PARTNERSHIP 4.625 19-29 01/08S	25.000	NOVELIS CORP 4.7500 20-30 30/01S
75.000	MSCI INC 3.6250 21-31 01/11S	25.000	NRG ENERGY INC 3.375 20-29 15/02S
50.000	MSCI INC 4.0000 19-29 15/11S	25.000	NRG ENERGY INC 3.625 20-31 15/02S
25.000	MURPHY OIL USA INC 3.75 21-31 15/02S	32.000	NRG ENERGY INC 6.625 17-27 15/01S
25.000	MURPHY OIL USA INC 4.75 19-29 15/09S	25.000	NUSTAR LOGISTICS LP 6.00 19-26 01/06S
25.000	NABORS INDUSTRIES 9.125 23-30 31/01S	25.000	OCEANEERING INTL 6.0 23-28 01/02S

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
100.000	OLIN CORP 5.625 19-29 01/08S	98,794.56	25.000	RAISING CANE'S 9.3750 23-29 01/05S	26,692.98
200.000	OLYMPUS WTR US 9.7500 23-28 15/11S	213,476.58	50.000	RAPTOR ACQUISITION CO 4.875 21-26 01/11S	47,825.38
25.000	ONEMAIN FINANCE 4.0000 20-30 15/09S	21,413.93	50.000	REALOGY GROUP LLC RE 7.0 23-30 15/04S	46,228.41
50.000	ONEMAIN FINANCE 9.0000 23-29 15/01S	52,957.64	223.551	REICHHOLD 144A 9.00 12-17 20/04S (IN DEFAULT)	-
25.000	ONEX USI ACQUISITION 7.5 23-32 15/01S	25,612.11	25.000	RESIDEO FUNDING	22,004.59
6.000	OPENLANE INC 5.125 17-25 01/06S	5,906.00	25.000	RHP HOTEL PROPERTIES 4.5 21-29 15/02S	23,360.22
100.000	OPEN TEXT/OPEN 4.1250 21-31 01/12S	88,455.73	25.000	RITCHIE BROS HOL 7.75 23-31 15/03S	26,693.62
50.000	OPEN TEXT HOLDINGS IN 4.125 20-30 15/02S	45,448.45	75.000	RLJ LODGING TRUST 3.75 21-26 17/06S	71,563.89
200.000	ORGANON COMPANY 5.125 21-31 30/04S30/04S	170,890.71	75.000	RLJ LODGING TRUST 4.00 21-29 15/09S	67,761.69
50.000	OSCAR ACQUISITI 9.5000 22-30 15/04S	48,806.81	25.000	ROCKET MORTGAGE CO 3.6250 20-29 01/03S	22,718.92
75.000	OUTFRONT MEDIA 4.2500 21-29 15/01S	67,782.14	25.000	ROCKET MORTGAGE LLC 2.875 21-26 15/10S0S	23,200.61
125.000	OUTFRONT MEDIA 5.0000 19-27 15/08S	122,024.83	100.000	ROCKETMTGE CO-I 4.0000 21-33 15/10S	85,686.47
75.000	OWENS & MINOR I 4.5000 21-29 31/03S	66,236.75	25.000	ROCKIES EXP PIPELINE 3.6 20-25 15/05S05S	24,235.44
25.000	OWENS & MINOR I 6.6250 22-30 01/04S	23,937.95	50.000	ROCKIES EXP PIPELINE 6.875 10-40 15/04S	49,259.33
75.000	OWENSBROCKWAY GLASS 7.25 23-31 15/05S	76,253.20	50.000	ROLLER BEARING COMP 4.375 21-29 15/10S	46,592.49
25.000	PANTHER BF AGGREGATOR 8.5 19-27 15/05S	25,197.03	200.000	ROYAL CARIBBEAN 3.7 17-28 15/03S	184,852.90
75.000	PARK INTERMED HOLD 4.875 21-29 15/05S	70,020.08	125.000	ROYAL CARIBBEAN 5.5 21-28 01/04S	123,491.12
50.000	PARK INTERMEDIATE 7.5 20-25 01/06S06S	50,492.93	50.000	ROYAL CARIBBEAN 7.5000 97-27 15/10S	52,880.72
75.000	PARK-OHIO INDUSTRIES 6.625 17-27 15/04S	70,023.69	50.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES 5.5 21-26 31/08S	49,662.28
43.000	PARK RIVER 5.625 21-29 01/02S	34,542.95	100.000	ROYAL CARIB CRUISES 5.375 22-27 15/07S	98,708.23
75.000	PATRICK INDUSTRIES 4.750 21-29 01/05S	68,771.36	25.000	RP ESCROW ISSUER LLC 5.25 20-25 15/12S	20,177.87
50.000	PAYSAFE FIN PLC 4.0000 21-29 15/06S	44,314.60	25.000	RYAN SPECIALTY 4.3750 22-30 01/02S	23,433.29
50.000	PBF HOLDING CO LLC 6.0 20-28 15/02S	48,909.71	25.000	SBA COMMUNICATIONS CO 3.125 21-29 01/02S	22,534.19
25.000	PBF HOLDING COMPANY 7.875 23-30 15/09S	25,534.85	50.000	SCIENCE APPLICA 4.8750 20-28 01/04S	48,016.37
25.000	PECF USS INTERM 8.0000 21-29 15/11S	11,428.80	125.000	SCIENTIFIC GAMES 7.000 19-28 15/05S	126,454.23
100.000	PENN NATIONAL G 4.1250 21-29 01/07S	85,974.55	25.000	SCIENTIFIC GAMES 7.2500 19-29 15/11S	25,699.03
50.000	PENNYMAC FI 7.875 23-29 15/12U	51,590.09	25.000	SCI GAMES 6.625 22-30 01/03S	23,410.50
50.000	PENNYMAC FINANCIAL 4.25 21-29 15/02S	45,090.26	75.000	SCIH SALT HOLDING 4.8750 21-28 01/05S	70,742.52
50.000	PENNYMAC FINANCIAL SER 5.75 21-31 15/09S	46,459.92	75.000	SCIH SALT HOLDING 6.625 21-29 01/05S	70,380.76
75.000	PERFORMANCE FOOD GR 4.25 21-29 01/08S	68,886.92	25.000	SCRIPPS ESCROW II INC 5.375 20-31 15/01S	18,366.92
50.000	PGT INC 4.375 21-29 01/10S	50,003.58	25.000	SCRIPPS ESCROW INC 19-27 15/07S	22,204.91
25.000	PIKE 8.625 23-31 15/01S	26,315.75	25.000	SEALED AIR/SEAL 7.2500 23-31 15/02S	26,588.76
25.000	PILGRIMS PRIDE 6.25 23-33 01/07S	25,757.18	50.000	SEALED AIR 5.0 22-29 15/04S	48,812.51
50.000	P L DEVELOPMENT LLC 7.75 20-25 15/11S	40,690.89	25.000	SEALED AIR CORP 4.0000 19-27 01/12S	23,611.89
25.000	PM GENERAL PURCHASER 9.5 20-28 01/10S	25,495.82	50.000	SEAWORLD PARKS 5.2500 21-29 15/08S	47,051.80
25.000	POLAR US BOR LLC 6.75 21-26 15/05S	8,160.92	100.000	SEG HLD LLC/SEG 5.6250 20-28 15/10S	100,808.29
25.000	POST HOLDINGS INC 4.625 20-30 15/04S	23,121.62	50.000	SELECT MEDICAL CORP 6.25 19-26 15/08S S	50,332.30
25.000	POST HOLDINGS INC 5.50 19-29 15/12S	24,181.05	25.000	SENSATA TECHNOL 4.3750 19-30 15/02S	23,295.43
50.000	POST HOLDINGS INC 5.625 17-28 15/01S	49,548.65	100.000	SERVICE CORPORATION 4 21-31 15/05S	89,759.70
50.000	PRA GROUP INC 7.375 20-25 01/09S	49,785.23	50.000	SERVICE PROPERTIES 4.3750 18-30 15/02S	38,859.13
25.000	PREM ENTMT SUB LLC PR 5.625 21-29 01/09S	19,836.29	50.000	SERVICE PROPERTIES 4.95 19-29 01/10S10S	41,365.90
75.000	PREM ENTMT SUB LLC PR 5.875 21-31 01/09S	58,089.22	75.000	SERVICE PROPERTIES 5.25 16-26 15/02S	72,872.12
75.000	PRESIDIO HOLDINGS INC 8.25 20-28 01/02S	75,697.66	25.000	SERVICE PROPERTIES 7.50 20-25 15/09S	25,339.57
75.000	PRESTIGE BRANDS 3.7500 21-31 01/04S	65,893.19	50.000	SHEA HOMES 4.7500 20-28 15/02U	47,510.80
75.000	PRIME HEALTHCARE SERV 7.25 20-25 01/11S	73,439.24	50.000	SHEA HOMES 4.7500 20-29 01/04U	46,317.12
19.000	PRIME SECURITY SERV 5.25 19-24 15/04S4S	18,961.88	75.000	SIMMONS FOODS INC 4.625 21-29 01/03S	65,105.79
25.000	PRIME SECURITY SERVIC 3.375 20-27 31/08S	23,222.90	25.000	SINCLAIR TELEVISION 4.125 20-30 01/12S	17,653.80
25.000	PRIME SECURITY SERVIC 6.25 20-28 15/01S	24,829.84	64.000	SINCLAIR TELEVISION 5.125 16-27 15/02S	57,912.86
75.000	PRIMO WATER HOLD INC 21-29 30/04S	69,333.51	75.000	SIRIUS SATELLITE 3.125 21-26 16/08S	70,938.95
25.000	PROG HOLDINGS I 6.0000 21-29 15/11S	23,360.60	75.000	SIRIUS SATELLITE 4.00 21-28 15/07S	69,594.80
50.000	QVC INC 4.45 14-25 15/02S	47,014.53	50.000	SIRIUS XM RADIO 5.00 17-27 01/08S	48,514.85
25.000	QVC INC 4.7500 20-27 15/02S	19,809.51			

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
75.000	SIRIUS XM RADIO 5.50 19-29 01/07S	72,742.51	25.000	THE ADT CORPORATION 4.875 16-32 15/07S	23,240.33
100.000	SIRIUS XM RADIO INC 3.875 21-31 01/09S	85,476.58	100.000	THE CHEMOURS CO 5.375 17-27 15/05S	97,884.06
75.000	SIZZLING PLATTER LLC 8.5 20-25 28/11S	75,314.76	50.000	THE SCOTT'S MIRACLE-GRO 4.000 22-31 01/04S	43,141.26
16.645	SKYMILES IP LIMITED 4.50 20-25 20/10Q	16,436.16	25.000	THOR INDUSTRIES 4.0000 21-29 15/10S	22,339.58
150.000	SLM CORP 3.125 21-26 02/11S	140,651.35	50.000	TKC HOLDINGS INC 10.5 21-29 15/05S	45,627.39
50.000	SOLARIS MIDSTREAM HOL 7.625 21-26 01/04S	50,889.83	25.000	T-MOBILE USA INC 2.8750 21-31 15/02S	22,024.79
50.000	SONIC AUTOMOTIV 4.6250 21-29 15/11S	45,582.26	25.000	TMS INTERNATIONAL CORP 6.25 21-29 15/04S	20,945.27
25.000	SONIC AUTOMOTIVE 4.875 21-31 15/11S	22,297.40	25.000	TOLL BROS FINANCE 4.875 17-27 15/03S	24,929.76
75.000	SPECIALTY BUILDING 6.37520-2630/09S	74,349.34	25.000	TOPBUILD CORP 4.1250 21-32 15/02S	22,369.78
25.000	SPECTRUM BRANDS 3.875 21-31 15/03S	22,722.67	175.000	TRANSOCEAN 6.80 07-38 15/03S	140,547.73
25.000	SPECTRUM BRANDS 5.5 20-30 15/07B	24,391.84	50.000	TRANSOCEAN 7.00 98-28 01/06S	43,841.45
190.000	SPIRIT AEROSYSTEMS 4.6 18-28 15/06S	168,232.37	22.000	TRANSOCEAN INC 11.5 20-27 30/01S	23,053.71
25.000	SPIRIT AEROSYSTEMS 9.75 23-30 15/11S	26,941.48	50.000	TRANSOCEAN INC 7.25 18-25 01/11S	49,810.32
25.000	SPRINGLEAF FINANCE 5.3750 19-29 15/11S	23,453.14	25.000	TRANSOCEAN INC 7.35 11-41 15/12S	22,365.64
75.000	SPRINGLEAF FINANCE 6.625 19-28 15/01S	75,909.58	50.000	TRANSOCEAN INC 7.50 01-31 15/04S	44,126.32
24.000	SPRINGLEAF FINANCE 6.875 18-25 15/03S	24,237.49	50.000	TRANSOCEAN LTD 8.0000 20-27 01/02S	49,387.45
115.000	SPRINGLEAF FINANCE 7.1250 18-26 15/03S	117,313.84	18.750	TRANSOCEAN POSEIDON 6.875 19-27 01/02S	18,746.63
75.000	SPRINGLEAF FINANCE 7.875 23-30 15/03S	77,375.93	25.000	TRAVEL + LEISURE CO 4.6250 19-30 01/03S	22,391.81
25.000	SPRINT CAPITAL CORP 6.875 98-28 15/11S	27,119.23	75.000	TRAVEL + LEISURE CO 6.625 20-26 31/07S	76,069.97
82.000	SPRINT CAPITAL CORP 8.75 02-32 15/03S	101,222.00	50.000	TRIMAS CORP 4.125 21-29 15/04S	45,153.89
100.000	SRM ESCROW ISSUER 6.00 20-28 01/11S	98,967.02	100.000	TRINSEO OP 5.125 21-29 01/04S	40,359.36
25.000	SRS DISTRIBUTION INC 4.625 21-28 01/07S	23,846.30	17.000	TRINSEO OP 5.375 17-25 01/09S	14,557.07
25.000	SRS DISTRIBUTION INC 6.0 21-29 01/12S	23,574.35	50.000	TRI POINTE HOMES 5.25 17-27 01/06S	49,521.03
100.000	SSC TECHNOLOGIE 5.5 19-27 28/03S	98,973.33	50.000	TRITON WATER HOLDINGS 6.25 21-29 01/04S	43,947.51
125.000	STANDARD INDUSTRIES 4.3750 20-30 15/07S	114,923.50	75.000	TRONOX INC 4.625 21-29 15/03S	66,471.91
100.000	STAPLES INC 10.75 19-27 15/04S	73,191.49	75.000	TTM TECHNOLOGIES INC 4 21-29 10/03S	68,224.12
100.000	STAPLES INC 7.5 19-26 15/04S	93,450.62	50.000	TWILIO INC 3.875 21-31 15/03S	44,649.36
25.000	STAR PARENT INC 9.00 23-30 01/10S	26,411.15	50.000	UBER TECHNOLOGIES 6.25 20-28 15/01S	50,374.70
25.000	STATION CASINOS 4.6250 21-31 01/12S	22,669.16	50.000	UBER TECHNOLOGIES 7.5 19-27 15/09S	51,806.37
50.000	STL HOLDING CO LLC 7.5 20-26 15/02S	48,978.18	100.000	UBER TECHNOLOGIES 8.0 18-26 01/11S	101,929.67
50.000	SUBURBAN PROPANE PARTN 5.0 21-31 01/06S	45,791.27	25.000	UNIFRAX ESCROW 5.2500 21-28 30/09S	18,280.49
25.000	SUMMIT MATERIAL 7.2500 23-31 15/01S	26,386.25	16.175	UNITED AIRLINES 2020 5.875 20-27 28/10Q	16,363.61
75.000	SUMMIT MATERIALS LLC 5.2500 20-29 15/01S	72,871.87	50.000	UNITED AIRLINES 4.375 21-26 21/04S	48,815.84
25.000	SUNOCO LP/FINAN 7.0000 23-28 15/09S	25,828.62	50.000	UNITED AIRLINES 4.6250 21-29 15/04S	46,667.93
125.000	SUNOCO LP/SUNOCO FIN 4.50 22-30 30/04S	115,888.34	25.000	UNITED RENTALS 3.7500 21-32 15/01S	22,229.83
50.000	SWF ESCROW ISSUER 6.5 21-29 01/10S	36,003.35	25.000	UNITED RENTALS 4.0000 20-30 15/07S	23,058.37
50.000	SYNAPTICS INC 4 21-29 15/06S 21-29 15/06S	45,229.96	75.000	UNITED RENTALS INC 3.875 20-31 15/02S	68,228.23
25.000	SYNCHRONY FINANCIAL 7.25 23-33 02/02S	24,883.76	150.000	UNITED RENTALS NORTH 5.25 19-30 15/01S	148,342.74
50.000	TALLGRASS ENERGY 6.00 20-30 31/12S	46,949.41	75.000	UNITED SHORE FIN SERV 5.5 21-29 15/04S	71,113.20
25.000	TALLGRASS ENERGY 7.5 20-25 01/10S	25,309.35	25.000	UNITED WHOLESAL 5.7500 21-27 15/06S	24,543.76
50.000	TALLGRASS ENERGY PARTN 6.0 21-31 01/09S	46,428.69	50.000	UNITI GROUP/CSL 4.7500 21-28 15/04S	43,185.38
25.000	TALOS PRODUCTION LLC 12 21-26 15/01S	25,796.87	50.000	UNITI GROUP/CSL 6.5000 21-29 15/02S	36,292.73
50.000	TEGNA INC 4.625 20-28 15/03S	46,768.04	6.000	UNIVISION COMMUNICA 5.125 15-25 15/02S	5,994.67
25.000	TEGNA INC 5 20-29 15/09S	22,958.53	100.000	UNIVISION COMMUNICA 6.625 20-27 01/06S	99,817.87
75.000	TEMPUR SEALY INTL INC 4.0 21-29 15/04S	68,087.47	50.000	UNIVISION COMMUNICAT 7.375 22-30 30/06S	50,040.57
100.000	TENET HEALTHCARE 4.25 21-29 01/06S	93,200.16	125.000	UNIVISION COMMUNICATI 4.5 21-29 01/05S	111,589.58
100.000	TENET HEALTHCARE 6.125 20-28 01/10S	99,638.69	49.000	USA COMPRESSION PART 6.875 18-26 01/04S	48,926.90
100.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.875 19-26 01/01S	98,970.97	25.000	USA COMPRESSION PART 6.875 19-27 17/12S	24,836.65
25.000	TENET HEALTHCARE CORP 5.125 19-27 01/11S	24,505.24	125.000	US FOODS INC 4.75 21-29 15/02S	119,002.77
25.000	TENET HEALTHCARE CORP 6.125 22-30 15/06S	25,291.47	25.000	US FOODS INC 6.875 23-28 15/09S	25,813.47
75.000	TEREX CORP 5.0000 21-29 15/05S	71,330.79	25.000	US FOODS INC 7.25 23-32 15/01S	26,187.79
75.000	TERRAFORM POWER 4.7500 19-30 15/01S	70,316.94	100.000	VALEANT PHARMA 8.5 18-27 01/06S	55,548.73

ストラクチャー-米国ハイ・イールド・ボンド

数量		評価額 米ドル	数量		評価額 米ドル
25.000	VENTURE GLOBAL 9.5000 23-29 01/02S	26,463.41	14.960	SPIRIT LOYALTY 8.0000 20-25 20/09Q	10,778.64
325.000	VENTURE GLOBAL 9.8750 23-32 01/02S	338,657.90	25.000	TRANSOCEAN AQUILA LT 8.00 23-28 30/09S	25,552.71
50.000	VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-29 15/08S	45,171.10		イスラエル	<b>43,873.83</b>
50.000	VENTURE GLOBAL CALCAS 3.875 21-33 01/11S	42,460.24	50.000	PLAYTIKA HOLDIN 4.2500 21-29 15/03S	43,873.83
50.000	VENTURE GLOBAL CALCAS 4.125 21-31 15/08S	44,236.81		ルクセンブルク	<b>290,173.34</b>
26.500	VERICAST MERGER SUB 11.00 21-26 15/09S	28,137.44	200.000	ALTICE FRANCE HOLDIN 6 20-28 06/02S	95,283.62
25.000	VERSCEND 9.75 18-26 27/08S	25,194.03	50.000	CAMELOT FINANCE SA 4.5 19-26 01/11S1/11S	48,881.09
75.000	VICI PROPERTIES 4.6250 19-29 01/12S	70,908.53	50.000	TELECOM ITALIA CAP 6.375 04-33 15/11S	49,112.52
50.000	VICI PROPERTIES LP 3.75 20-27 15/02S	47,303.98	75.000	TELECOM ITALIA CAP 6 05-34 30/09S 30/09S	71,665.66
25.000	VICI PROPERTIES LP 4.125 20-30 15/08S8S	22,950.76	25.000	TELECOM ITALIA CAPITAL7.20 06-36 18/07S	25,230.45
25.000	VICTORIA'S SECR 4.6250 21-29 15/07S	20,952.37		マルタ	<b>78,307.59</b>
50.000	VIKING CRUISES LTD 5.875 17-27 15/09S	48,812.84	50.000	VISTAJET MAL FIN 7.875 22-27 01/05S	43,331.79
50.000	VIKING CRUISES LTD 6.25 15-25 15/05S	49,948.04	50.000	VISTAJET MALT 6.375 22-30 01/02S	34,975.80
50.000	VIKING CRUISES LTD 7.00 21-29 15/02S	49,592.57		オランダ	<b>316,255.91</b>
25.000	VISTRA OPERATIONS CO 4.375 21-29 01/05S	23,262.02	50.000	ELASTIC NV 4.1250 21-29 15/07S	46,005.03
75.000	VISTRA OPERATIONS CO 5.625 19-27 15/02S	74,270.26	100.000	OI EUROPEAN GROUP BV 4.75 21-30 15/02S	93,922.21
50.000	VISTRA OPERATIONS CO 5 19-27 31/07S	48,713.41	200.000	UPC BROADBAND FINCO B 4.875 21-31 15/07S	176,328.67
75.000	VISTRA OPERATIONS CO 7.750 23-31 15/10S	77,964.84		イギリス	<b>309,851.83</b>
25.000	W.R. GRACE HOLDINGS 4.875 21-27 15/06S	24,115.65	100.000	CARNIVAL PLC 7.875 01-27 01/06S	104,734.22
50.000	WASH MULTIFAMILY ACQ 5.75 21-26 15/04S	48,607.22	25.000	MACQUARIE AIRFINANCE 8.125 23-29 30/03S	26,161.08
50.000	WEEKLEY HOMES LLC 4.875 20-28 15/09S	47,193.75	200.000	VMED O2 UK FINA 4.7500 21-31 15/07S	178,956.53
50.000	WESTERN GAS PARTNERS 4.50 18-28 01/03S	48,463.39		変動利付債	<b>273,280.46</b>
25.000	WESTERN GAS PARTNERS 4.7500 18-28 15/08S	24,469.88		カナダ	<b>42,740.67</b>
25.000	WESTERN GAS PARTNERS 5.30 18-48 01/03S	21,931.59	50.000	INTELLIGENT PACKAGING FL.R 20-26 15/01S	42,740.67
25.000	WESTERN GAS PARTNERS 5.5 18-48 15/08S08S	22,311.79		アメリカ	<b>230,539.79</b>
50.000	WHEEL PROS ESCROW ISS 6.500 21-29 15/05S	15,961.01	90.847	AMC ENTERTAINMENT HO FL.R 20-26 15/06S	79,036.89
50.000	WHITE CAP BUYER 6.875 20-28 15/10S	48,584.87	92.214	EXELA INTERMEDIATE FL.R 23-26 15/04S	16,192.31
50.000	WILLIAMS SCOTSMAN 4.6250 20-28 15/08S	47,428.27	50.000	IRIS HOLDINGS INC FL.R 21-26 15/02S	42,586.00
50.000	WINNEBAGO INDUS 6.2500 20-28 15/07S	49,703.35	50.862	WERNER FINCO LP WERNE FL.R 23-28 15/10S	42,597.90
25.000	WORLD ACCEPTANCE CORP 7.00 21-26 01/11S	22,683.90	50.000	WHITE CAPITAL PARENT FL.R 21-26 15/03S	50,126.69
25.000	WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625 21-29 15/08S	22,115.13		<b>合計</b>	<b>41,694,605.20</b>
32.000	WYNN LAS VEGAS 5.50 15-25 01/03S	31,875.24			
100.000	WYNN RESORTS FINANCE 5.125 19-29 01/10S	94,502.91			
50.000	XEROX HOLDINGS CORP 5.00 20-25 15/08S	49,061.50			
25.000	XEROX HOLDINGS CORP 5.50 20-28 15/08S	22,586.78			
50.000	XHR LP 4.875 21-29 01/06S	46,077.16			
25.000	XHR LP 6.375 20-25 15/08S	25,021.95			
50.000	XPO INC 6.2500 23-28 01/06S	50,896.77			
25.000	XPO INC 7.125 23-32 01/02S	25,804.49			
100.000	YUM BRANDS 5.375 22-32 01/04S	98,642.80			
	フランス	<b>359,716.10</b>			
225.000	ALTICE FRANCE SA 5.125 21-29 15/07S	175,432.50			
200.000	ALTICE FRANCE SA 8.1250 18-27 01/02S	184,283.60			
	ケイマン諸島	<b>478,459.22</b>			
41.667	AMERICAN AIRLINES 5.5 21-26 24/03Q	41,362.66			
100.000	AMERICAN AIRLINES 5.75 21-29 20/04Q	97,801.93			
125.000	GLOBAL AIRCRAFT 6.50 19-24 15/09S	118,090.27			
25.000	HAWAIIAN BRAND 5.75 21-26 20/01Q 04/02Q	23,649.13			
25.000	HERBALIFE NUTRITION 7.875 20-25 01/09S	24,841.59			
55.000	SEAGATE HDD CAYMAN 4.125 20-31 15/01S	49,398.43			
76.000	SEAGATE HDD CAYMAN 9.625 22-32 01/12S	86,983.86			

■外国為替先物契約（IH13シェアクラス、メキシコペソ）（2023年12月31日現在）

買 建	契 約 額	売 建	契 約 額	満 期 日	評 価 損 益
					米ドル
メキシコペソ	75,000,000.00	米ドル	4,331,366.39	2024/2/2	73,427.07
メキシコペソ	2,000,000.00	米ドル	114,040.83	2024/2/2	3,420.33
				合計	76,847.40



## C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）

## 運用報告書

《第17期》

決算日：2024年2月15日

（計算期間：2023年2月16日～2024年2月15日）

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

## ■投資対象ファンドの概要

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入率	純資産総額
		税込み 分配金	期中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
13期（2020年2月17日）	10,048	0	△0.1	61.1	788
14期（2021年2月15日）	10,042	0	△0.1	64.6	773
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473
17期（2024年2月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495

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

## ■当期中の基準価額等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	第 17 期 (2023年 2月16日 ～2024年 2月15日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 )  ( 受 託 会 社 )	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	1 (1)	0.012 (0.012)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	2	0.023	

期中の平均基準価額は10,024円です。

- (注1) 費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。  
(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ■ 売買及び取引の状況 (2023年 2月16日から2024年 2月15日まで)

## 公社債

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

- (注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。  
(注2) 単位未満は切捨てです。  
(注3) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■ 主要な売買銘柄 (2023年 2月16日から2024年 2月15日まで)

## 公社債

銘 柄	買 付	売 付
	金 額	金 額
	千円	千円
第139回共同発行市場公募地方債	150,810	
第134回共同発行市場公募地方債	100,353	
第137回共同発行市場公募地方債	50,289	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	50,023	

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

## ■利害関係人との取引状況等（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細（2024年2月15日現在）

公社債

## (A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 2 月 15 日 現 在						
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8
合 計	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

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

## (B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

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

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

## ■投資信託財産の構成（2024年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	350,832	70.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	144,454	29.2
投 資 信 託 財 産 総 額	495,286	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2024年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	495,286,649円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	143,608,953
公 社 債(評価額)	350,832,500
未 収 利 息	452,737
前 払 費 用	392,459
(B) 負 債	59,852
未 払 信 託 報 酬	53,488
未 払 利 息	424
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	495,226,797
元 本	494,224,101
次 期 繰 越 損 益 金	1,002,696
(D) 受 益 権 総 口 数	494,224,101口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	10,020円

(注記事項)

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

## ■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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