

運用報告書（全体版）

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	原則として無期限（2003年1月30日設定）	
運用方針	イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の高利回り社債に投資することにより、高い金利収入の確保とともに証券の値上り益を追求し信託財産の成長を図ることを目指した運用を行います。	
主要投資対象	イーストスプリング米国高利回り社債オープン	イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	イーストスプリング米国高利回り社債オープンマザーファンド	米国の高利回り社債を主要投資対象とします。
組入制限	イーストスプリング米国高利回り社債オープン	・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	イーストスプリング米国高利回り社債オープンマザーファンド	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時（毎月10日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配の対象とし、分配金額は基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象金額が少額の場合は、収益分配を行わないこともあります。	

イーストスプリング 米国高利回り社債オープン

第30作成期

第174期（決算日 2017年8月10日）
 第175期（決算日 2017年9月11日）
 第176期（決算日 2017年10月10日）
 第177期（決算日 2017年11月10日）
 第178期（決算日 2017年12月11日）
 第179期（決算日 2018年1月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引立てにあずかり厚くお礼申し上げます。
 さて、「イーストスプリング米国高利回り社債オープン」は、上記の決算を行いましたので、ここに当作成期中の運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

イーストスプリング・インベストメンツ株式会社

【お問い合わせ先】

電話番号：03-5224-3400

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時まで）

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

〒100-6905

東京都千代田区丸の内2-6-1丸の内パークビルディング

最近5作成期の運用実績

決 算 期		基準価額 (分配前)	税 込		債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
			分 配	金		
		円	円	%	%	百万円
第26 作成期	150期(2015年8月10日)	7,034	20	0.9	94.5	43,600
	151期(2015年9月10日)	6,755	20	△ 3.7	95.0	41,232
	152期(2015年10月13日)	6,659	20	△ 1.1	94.2	40,046
	153期(2015年11月10日)	6,803	20	2.5	94.5	40,270
	154期(2015年12月10日)	6,522	20	△ 3.8	95.1	37,894
	155期(2016年1月12日)	6,189	20	△ 4.8	94.8	35,360
第27 作成期	156期(2016年2月10日)	5,786	20	△ 6.2	92.8	32,695
	157期(2016年3月10日)	6,039	20	4.7	95.4	33,816
	158期(2016年4月11日)	5,835	20	△ 3.0	96.5	32,181
	159期(2016年5月10日)	5,950	20	2.3	94.9	32,546
	160期(2016年6月10日)	5,987	20	1.0	95.5	32,203
	161期(2016年7月11日)	5,702	20	△ 4.4	95.2	30,361
第28 作成期	162期(2016年8月10日)	5,822	20	2.5	95.0	30,707
	163期(2016年9月12日)	5,886	20	1.4	97.0	30,687
	164期(2016年10月11日)	5,987	20	2.1	97.3	30,902
	165期(2016年11月10日)	6,002	20	0.6	95.8	30,587
	166期(2016年12月12日)	6,596	20	10.2	96.2	33,114
	167期(2017年1月10日)	6,684	20	1.6	96.0	32,977
第29 作成期	168期(2017年2月10日)	6,565	20	△ 1.5	95.7	32,002
	169期(2017年3月10日)	6,580	20	0.5	96.1	31,792
	170期(2017年4月10日)	6,437	20	△ 1.9	95.2	30,737
	171期(2017年5月10日)	6,588	20	2.7	95.5	31,102
	172期(2017年6月12日)	6,417	20	△ 2.3	95.7	29,947
	173期(2017年7月10日)	6,596	20	3.1	96.4	30,491
第30 作成期	174期(2017年8月10日)	6,400	20	△ 2.7	95.7	29,301
	175期(2017年9月11日)	6,321	20	△ 0.9	95.6	28,654
	176期(2017年10月10日)	6,587	20	4.5	95.2	29,568
	177期(2017年11月10日)	6,558	20	△ 0.1	95.7	29,054
	178期(2017年12月11日)	6,583	20	0.7	96.9	28,905
	179期(2018年1月10日)	6,543	20	△ 0.3	96.1	28,393

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 当ファンドは公表されている適切な指数が存在しないためベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

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		債 券 組 入 比 率
第174期	(期 首) 2017年7月10日	円 6,596	% —	% 96.4	
	7月末	6,466	△2.0	96.0	
	(期 末) 2017年8月10日	6,420	△2.7	95.7	
第175期	(期 首) 2017年8月10日	6,400	—	95.7	
	8月末	6,434	0.5	95.3	
	(期 末) 2017年9月11日	6,341	△0.9	95.6	
第176期	(期 首) 2017年9月11日	6,321	—	95.6	
	9月末	6,595	4.3	95.0	
	(期 末) 2017年10月10日	6,607	4.5	95.2	
第177期	(期 首) 2017年10月10日	6,587	—	95.2	
	10月末	6,616	0.4	95.2	
	(期 末) 2017年11月10日	6,578	△0.1	95.7	
第178期	(期 首) 2017年11月10日	6,558	—	95.7	
	11月末	6,512	△0.7	95.8	
	(期 末) 2017年12月11日	6,603	0.7	96.9	
第179期	(期 首) 2017年12月11日	6,583	—	96.9	
	12月末	6,549	△0.5	96.0	
	(期 末) 2018年1月10日	6,563	△0.3	96.1	

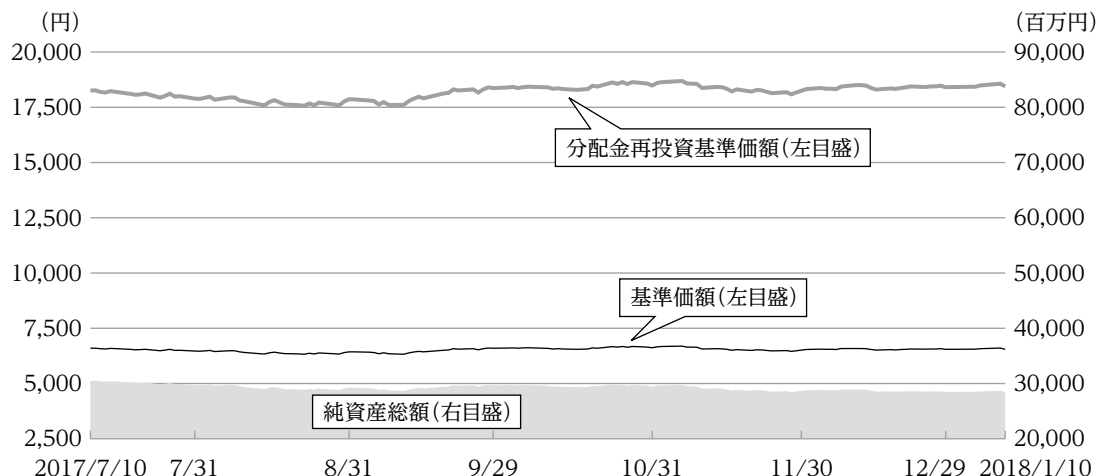
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

運用経過

基準価額等の推移について

(2017年7月11日～2018年1月10日)



第174期首	6,596円
第179期末	6,543円 (既払分配金120円)
騰落率	1.0% (分配金再投資ベース)

(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税引前)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) 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。したがって、お客様1人ひとりの損益の状況を示すものではありません。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

上昇要因

- ・米国高利回り社債の利回りが低下(債券価格は上昇)したこと。
- ・米国高利回り社債からのクーポン収入(利金)。

投資環境について

米国高利回り社債市場

米国債利回りは、2017年9月の連邦公開市場委員会（FOMC）で10月からのバランスシートの縮小と年内の追加利上げに前向きな姿勢が確認されたことで上昇圧力が強まり、当作成期末にかけて上昇（価格は下落）しました。一方で、高利回り社債の対国債スプレッド（社債スプレッド）は景気拡大期待から縮小し、結果として高利回り社債市場は小幅の上昇（利回りは低下）となりました。社債スプレッドは、8月中旬にかけてトランプ政権の政策遂行力への懸念や北朝鮮を巡る緊張を背景に拡大しましたが、10月下旬にかけては北朝鮮情勢の緊張緩和とともに縮小傾向となりました。しかし、11月中旬に税制改革を巡る不透明感を背景に高利回り社債市場から大幅な資金流出が見られ、社債スプレッド

は急拡大しました。その後は当作成期末にかけて税制改革法の成立などを受け米国株式市場が大幅高となったことや原油高などを好感し、社債スプレッドは縮小しました。

為替市場

当作成期初から2017年9月上旬にかけては、米国政治情勢の混乱や北朝鮮を巡る緊張の高まりなどから円高米ドル安となりました。その後は北朝鮮情勢の緊張緩和に加え、米国の金利先高観や税制改革への期待から米ドルが買い戻され、11月上旬には一時1米ドル114円台後半まで円安米ドル高が進みました。しかし、米ドル買いの動きは持続せず、当作成期末にかけて概ね111円～114円での揉み合いに終始し、通期では円高米ドル安となりました。

ポートフォリオについて

当ファンド

イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の高利回り社債に投資しました。

イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド

主として米国の高利回り社債に投資することにより、高い金利収入の確保とともに証券

の値上り益の獲得を目指した運用を行いました。クレジット・アナリスト・チームによる徹底した個別銘柄の調査・分析と、バリュエーションを重視するとともに業種や個別銘柄の分散に配慮した銘柄選択及びポートフォリオ構築を行いました。当作成期は、セクター別ではエネルギー、素材などが大きくプラスとなった一方で、電気通信サービスなどはマイナスとなりました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用の基本方針に適合した、公表されている指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

分配金額は、基準価額水準・市況動向等を勘案して、以下の通りとさせていただきます。なお、留保益の運用につきましては、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳（1万口当たり、税引前）

項目	第174期	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期
	2017年7月11日 ~2017年8月10日	2017年8月11日 ~2017年9月11日	2017年9月12日 ~2017年10月10日	2017年10月11日 ~2017年11月10日	2017年11月11日 ~2017年12月11日	2017年12月12日 ~2018年1月10日
当期分配金 (円)	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率) (%)	0.312	0.315	0.303	0.304	0.303	0.305
当期の収益 (円)	19	19	20	19	20	19
当期の収益以外 (円)	0	0	—	0	—	0
翌期繰越分配対象額 (円)	373	372	379	378	383	382

(注1) 「当期の収益」と「当期の収益以外」は円未満は切捨てて表示しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) —印は該当がないことを示しています。

今後の運用方針について

当ファンド

引き続きイーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド受益証券を組み入れることにより、信託財産の成長を図ることを目指します。

イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド

2018年も市場環境は良好であり、高利回り社債の対国債スプレッドは縮小気味に推移するとみています。また、高利回り社債は国債の動きと相関性が低く、利上げ環境下においても堅調に推移すると思われま

す。北朝鮮問題や米国の政治的混乱などは依然として大きなリスク要因と考えられます。加えて、高利回り社債市場の流動性は相対的に低く、資金流出が債券価格の下落につながる可能性もあり、注意が必要です。税制改革の高利回り社債への影響については、長期的な視点に立って見極める必要があります。ポートフォリオや投資方針の変更などはありませんが、減税法案による影響は市場価格にはほぼ織り込まれつつあるとみており、引き続き市場環境を注視しながら、企業のクレジット分析を徹底して行っていく方針です。

1 万口当たりの費用明細

(2017年7月11日～2018年1月10日)

項目	第174期～第179期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	59円	0.898%	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 作成期間の平均基準価額は、6,528円です。
(投信会社)	(30)	(0.463)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(25)	(0.381)	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)	(4)	(0.054)	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	0.012	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管 および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他1)	(0)	(0.000)	信託管理事務に係る手数料
(その他)	(0)	(0.000)	余資運用に係る費用（マイナス金利相当額）
合計	60	0.910	

(注1) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約によ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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 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）を作成期間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。

(注4) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

売買及び取引の状況

(2017年7月11日から2018年1月10日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

決 算 期	第 174 期 ～ 第 179 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド	—	—	1,139,624	2,646,175

(注) 単位未満は切捨てです。

利害関係人との取引状況等

(2017年7月11日から2018年1月10日まで)

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(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

(2018年1月10日現在)

親投資信託残高

種 類	前作成期末 (第173期末)	当 作 成 期 末 (第 179 期 末)	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド	13,189,540	12,049,916	28,523,357

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) マザーファンドの2018年1月10日現在の受益権総口数は、12,049,916千口です。

<参考情報>

下記は、イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド全体（12,049,916千口）の内容です。

公社債

(A) 種類別開示

外国（外貨建）公社債

組入有価証券明細表

（2018年1月10日現在）

区 分	当作成期末（第179期末）							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年 以上	2年 以上	2年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 235,929	千米ドル 242,722	千円 27,294,110	% 95.7	% 85.0	% 71.6	% 20.9	% 3.1
合 計	235,929	242,722	27,294,110	95.7	85.0	71.6	20.9	3.1

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

（注2）組入比率は、当ファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

（注3）額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

（注4）BB格以下組入比率の計算においては、S&Pおよびムーディーズの格付けをもとに、当社が独自の基準で採用した格付けを用いています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

組入有価証券明細表

（2018年1月10日現在）

銘 柄	当作成期末（第179期末）					
	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		
普通社債券 (含む投資法人債券)	10.5%	QUAPAW DOWNSTREAM	2,500	2,425	272,691	2019/07/01
	10.5%	WESTERN DIGITAL CO	1,000	1,158	130,301	2024/04/01
	3.1%	FREEPORT-MCMORAN	1,250	1,250	140,562	2020/03/15
	3.36%	SPRINT SPECTRUM /	681	685	77,040	2021/09/20
	3.4%	AT&T INC	1,000	1,000	112,474	2024/08/14
	3.45%	CF INDUSTRIES INC	500	494	55,592	2023/06/01
	3.5%	ANDEAVOR LOGIS LP/C	137	136	15,352	2022/12/01
	3.7%	WILLIAMS COMPANIES	500	500	56,295	2023/01/15
	3.75%	ANGLO AMERICAN CAP	476	483	54,354	2022/04/10
	3.75%	CONSTELLATION BR	330	339	38,226	2021/05/01
	3.75%	TECK RESOURCES LIM	1,000	1,005	113,012	2023/02/01
	3.8%	CONTINENTAL RESOURC	1,000	1,011	113,715	2024/06/01
	3.875%	CIT GROUP INC	2,000	2,024	227,653	2019/02/19
	3.875%	CONSTELLATION BR	272	278	31,352	2019/11/15
	3.875%	FREEPORT-MCMORAN	584	580	65,260	2023/03/15
	3.875%	NXP BV/NXP FUNDIN	500	505	56,857	2022/09/01
3.9%	AT&T INC	1,000	1,002	112,722	2027/08/14	
4%	BALL CORP	1,000	1,017	114,417	2023/11/15	

銘柄		当作成期末(第179期末)					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		外貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	4% T-MOBILE USA INC	4.0	250	256	28,853	2022/04/15	
	4.125% AIRCASTLE LTD	4.125	924	942	105,981	2024/05/01	
	4.125% ALLY FINANCIAL	4.125	1,000	1,018	114,560	2020/03/30	
	4.125% ALLY FINANCIAL IN	4.125	1,000	1,027	115,542	2022/02/13	
	4.125% ANGLO AMERICAN CA	4.125	766	789	88,734	2022/09/27	
	4.125% ASHTEAD CAPITAL I	4.125	200	203	22,841	2025/08/15	
	4.125% LENNAR CORP	4.125	447	458	51,531	2022/01/15	
	4.125% SCHAEFFLER VE PIK	4.125	200	203	22,883	2021/09/15	
	4.125% TARGA RESOURCES	4.125	1,000	1,005	113,012	2019/11/15	
	4.25% ANDEAVOR LOGIS LP/	4.25	121	122	13,736	2027/12/01	
	4.25% CONSTELLATION BR	4.25	277	291	32,766	2023/05/01	
	4.25% ENERGY TRANSFER EQ	4.25	1,000	1,010	113,574	2023/03/15	
	4.25% HILTON DOMESTIC OP	4.25	1,231	1,243	139,810	2024/09/01	
	4.25% NEXTERA ENERGY PAR	4.25	207	210	23,684	2024/09/15	
	4.375% ASHTEAD CAPITAL I	4.375	200	204	22,996	2027/08/15	
	4.375% BALL CORP	4.375	500	518	58,263	2020/12/15	
	4.375% CONTINENTAL RESOU	4.375	605	617	69,477	2028/01/15	
	4.375% HOLOGIC INC	4.375	84	85	9,611	2025/10/15	
	4.375% QVC INC	4.375	500	509	57,254	2023/03/15	
	4.375% SANMINA CORP	4.375	1,354	1,387	156,063	2019/06/01	
	4.375% TOLL BROS FINANCE	4.375	500	518	58,333	2023/04/15	
	4.45% CENOVUS ENERGY INC	4.45	1,000	921	103,580	2042/09/15	
	4.5% CNH INDUSTRIAL NV	4.5	1,250	1,307	147,014	2023/08/15	
	4.5% CONTINENTAL RESOURC	4.5	750	780	87,791	2023/04/15	
	4.5% CROWN AMER/CAP CORP	4.5	1,000	1,030	115,823	2023/01/15	
	4.5% MGM GROWTH/MGM FINA	4.5	556	556	62,619	2026/09/01	
	4.5% MPLX LP	4.5	1,000	1,051	118,271	2023/07/15	
	4.5% PARK AEROSPACE HOLD	4.5	500	468	52,710	2023/03/15	
	4.5% SCHAEFFLER VERW PIK	4.5	200	204	22,996	2023/09/15	
	4.5% TENET HEALTHCARE CO	4.5	500	506	56,927	2021/04/01	
	4.5% ZF NA CAPITAL	4.5	364	384	43,285	2022/04/29	
	4.55% FREEPORT-MCMORAN	4.55	3,284	3,357	377,594	2024/11/14	
	4.625% AERCAP IRELAND CA	4.625	500	526	59,236	2022/07/01	
	4.625% ALLY FINANCIAL IN	4.625	2,000	2,095	235,582	2022/05/19	
	4.625% ARDAGH PKG FIN/HL	4.625	1,004	1,022	115,016	2023/05/15	
	4.625% GLENCORE FUNDING	4.625	1,000	1,059	119,134	2024/04/29	
	4.625% HANESBRANDS INC	4.625	250	255	28,745	2024/05/15	
	4.625% INTL LEASE FINANC	4.625	500	523	58,844	2021/04/15	
	4.625% UNITED AIR 2014-2	4.625	1,622	1,673	188,154	2022/09/03	
	4.75% AMC NETWORKS INC	4.75	1,000	1,021	114,839	2022/12/15	
	4.75% ANGLO AMERICAN CAP	4.75	246	256	28,810	2027/04/10	
	4.75% ARAMARK SERVICES I	4.75	571	582	65,493	2026/06/01	
	4.75% ASHLAND INC	4.75	1,000	1,047	117,791	2022/08/15	

普通社債券
(含む投資法人債券)

銘 柄		当 作 成 期 末 (第 179 期 末)					償 還 年 月 日
		利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		%	千 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円		
	4. 75% CENTENE CORP	4. 75	1, 534	1, 599	179, 829	2022/05/15	
	4. 75% CENTENE CORP	4. 75	242	246	27, 757	2025/01/15	
	4. 75% CHURCHILL DOWNS IN	4. 75	641	637	71, 720	2028/01/15	
	4. 75% CONSTELLATION BR	4. 75	100	109	12, 267	2024/11/15	
	4. 75% FMG RESOURCES AUG	4. 75	672	687	77, 266	2022/05/15	
	4. 75% GRAPHIC PACKAGING	4. 75	581	605	68, 110	2021/04/15	
	4. 75% KFC HLD/PIZZA HUT/	4. 75	854	871	97, 952	2027/06/01	
	4. 75% NCL CORP LTD	4. 75	336	347	39, 058	2021/12/15	
	4. 75% SCHAEFFLER VER PIK	4. 75	200	204	23, 012	2026/09/15	
	4. 75% SILGAN HOLDINGS IN	4. 75	792	815	91, 732	2025/03/15	
	4. 75% STANDARD INDUSTRIE	4. 75	1, 250	1, 262	141, 968	2028/01/15	
	4. 8% NUSTAR LOGISTICS LP	4. 8	500	507	57, 068	2020/09/01	
	4. 875% ANGLO AMERICAN CA	4. 875	234	246	27, 739	2025/05/14	
	4. 875% CATALENT PHARMA S	4. 875	112	113	12, 767	2026/01/15	
	4. 875% GANNETT CO	4. 875	198	202	22, 766	2021/09/15	
	4. 875% GOODYEAR TIRE & R	4. 875	396	405	45, 587	2027/03/15	
	4. 875% HILTON WORLDWIDE	4. 875	392	409	46, 036	2027/04/01	
	4. 875% LIVE NATION ENTER	4. 875	1, 068	1, 096	123, 249	2024/11/01	
	4. 875% MULTI-COLOR CORP	4. 875	519	524	58, 945	2025/11/01	
	4. 875% RANGE RESOURCES C	4. 875	750	744	83, 704	2025/05/15	
	4. 875% ROWAN COMPANIES I	4. 875	250	241	27, 154	2022/06/01	
	4. 875% SOTHEBY'S	4. 875	800	786	88, 385	2025/12/15	
	4. 875% TOLL BROS FINANCE	4. 875	962	1, 002	112, 774	2027/03/15	
	4. 875% UNITED RENTALS NO	4. 875	2, 000	2, 004	225, 394	2028/01/15	
	5% 1011778 BC / NEW RED	5. 0	1, 271	1, 283	144, 353	2025/10/15	
	5% AIRCASTLE LTD	5. 0	582	616	69, 372	2023/04/01	
	5% ALLISON TRANSMISSION	5. 0	500	515	57, 982	2024/10/01	
	5% ANTERO RESOURCES CORP	5. 0	750	770	86, 656	2025/03/01	
	5% COMMSCOPE INC	5. 0	500	510	57, 349	2021/06/15	
	5% COMMSCOPE TECH LLC	5. 0	500	507	57, 068	2027/03/15	
	5% CONTINENTAL RES	5. 0	1, 750	1, 785	200, 762	2022/09/15	
	5% DAE FUNDING LLC	5. 0	268	267	30, 061	2024/08/01	
	5% DELPHI JERSEY HOLDING	5. 0	399	406	45, 764	2025/10/01	
	5% DISH DBS CORP	5. 0	1, 500	1, 445	162, 568	2023/03/15	
	5% FIRST DATA CORPORATIO	5. 0	2, 500	2, 585	290, 790	2024/01/15	
	5% FORD MOTOR CREDIT	5. 0	500	505	56, 806	2018/05/15	
	5% HILL-ROM HOLDINGS INC	5. 0	310	316	35, 556	2025/02/15	
	5% JAMES HARDIE INTL FIN	5. 0	200	202	22, 771	2028/01/15	
	5% POST HOLDINGS INC	5. 0	1, 501	1, 504	169, 209	2026/08/15	
	5% SIRIUS XM RADIO INC	5. 0	250	254	28, 617	2027/08/01	
	5% SM ENERGY CO	5. 0	750	735	82, 650	2024/01/15	
	5% STATION CASINOS LLC	5. 0	500	507	57, 026	2025/10/01	
	5% TENNECO INC	5. 0	500	515	57, 911	2026/07/15	

普通社債券
(含む投資法人債券)

銘柄		当作成期末(第179期末)					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		外貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	5% UNITYMEDIA HESSEN	5.0	1,000	1,033	116,245	2025/01/15	
	5% WOLVERINE WORLD WIDE	5.0	429	431	48,482	2026/09/01	
	5.1% WYNDHAM WORLDWIDE C	5.1	704	735	82,679	2025/10/01	
	5.125% AECOM	5.125	745	756	85,115	2027/03/15	
	5.125% AES CORP/VA	5.125	1,000	1,065	119,759	2027/09/01	
	5.125% ALCOA INC	5.125	1,000	1,069	120,216	2024/10/01	
	5.125% ANTERO RESOURC-WI	5.125	500	513	57,771	2022/12/01	
	5.125% ARAMARK SERVICES	5.125	111	116	13,106	2024/01/15	
	5.125% BERRY PLASTICS CO	5.125	1,000	1,040	116,948	2023/07/15	
	5.125% CCO HLDGS LLC/CAP	5.125	812	828	93,135	2023/05/01	
	5.125% CCO HLDGS LLC/CAP	5.125	1,213	1,206	135,634	2027/05/01	
	5.125% CCO HOLDINGS LLC	5.125	2,857	2,921	328,498	2023/02/15	
	5.125% CHENIERE CORP CHR	5.125	1,528	1,600	179,985	2027/06/30	
	5.125% FMG RESOURCES AUG	5.125	529	542	61,047	2024/05/15	
	5.125% GOODYEAR TIRE & R	5.125	341	353	39,791	2023/11/15	
	5.125% HEALTHSOUTH CORP	5.125	1,000	1,027	115,542	2023/03/15	
	5.125% LEVEL 3 FINANCING	5.125	1,000	1,005	113,012	2023/05/01	
	5.125% OLIN CORP	5.125	1,000	1,055	118,634	2027/09/15	
	5.125% REYNOLDS GRP ISS/	5.125	500	518	58,263	2023/07/15	
	5.125% SEALED AIR CORP	5.125	1,500	1,608	180,903	2024/12/01	
	5.125% SINCLAIR TELEVISI	5.125	700	700	78,715	2027/02/15	
	5.125% STEEL DYNAMICS	5.125	449	460	51,815	2021/10/01	
	5.125% T-MOBILE USA INC	5.125	500	523	58,895	2025/04/15	
	5.125% THC ESCROW CORP I	5.125	2,000	1,980	222,651	2025/05/01	
	5.125% UNIVISION COMMUNI	5.125	1,000	1,006	113,152	2023/05/15	
	5.25% ACCO BRANDS CORP	5.25	940	967	108,741	2024/12/15	
	5.25% CHENIERE ENERGY PA	5.25	1,000	1,025	115,261	2025/10/01	
	5.25% CRC ESCROW ISSUER	5.25	1,000	1,016	114,277	2025/10/15	
	5.25% ESH HOSPITALITY	5.25	323	329	37,002	2025/05/01	
	5.25% HOLOGIC INC	5.25	401	417	46,896	2022/07/15	
	5.25% HUGHES SATELLITE S	5.25	362	372	41,915	2026/08/01	
	5.25% KFC HLD/PIZZA HUT/	5.25	343	361	40,691	2026/06/01	
	5.25% L BRANDS INC	5.25	800	802	90,184	2028/02/01	
	5.25% MEDNAX INC	5.25	157	160	18,051	2023/12/01	
	5.25% NOVA CHEMICALS COR	5.25	129	129	14,596	2027/06/01	
	5.25% PARSLEY ENERGY LLC	5.25	261	264	29,789	2025/08/15	
	5.25% TAYLOR MORRISON CO	5.25	500	510	57,366	2021/04/15	
	5.25% WELLCARE HEALTH PL	5.25	1,221	1,295	145,711	2025/04/01	
	5.25% WYNN LAS VEGAS LLC	5.25	854	872	98,072	2027/05/15	
	5.375% CCO HLDGS LLC/CAP	5.375	972	995	111,897	2025/05/01	
	5.375% CHEMOURS CO	5.375	500	525	59,036	2027/05/15	
	5.375% CYRUSONE LP/CYRUS	5.375	86	90	10,130	2027/03/15	
	5.375% DIAMONDBACK ENERG	5.375	750	784	88,238	2025/05/31	

銘 柄		当 作 成 期 末 (第 179 期 末)					償 還 年 月 日
		利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ア メ リ カ)		%	千 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円		
	5. 375% ENDO FIN LLC/ENDO	5. 375	1, 164	958	107, 822	2023/01/15	
	5. 375% EQUINIX INC	5. 375	1, 500	1, 608	180, 903	2027/05/15	
	5. 375% GLP CAPITAL LP /	5. 375	796	857	96, 447	2026/04/15	
	5. 375% HCA INC	5. 375	5, 261	5, 524	621, 179	2025/02/01	
	5. 375% LEVEL 3 FINANCING	5. 375	500	503	56, 646	2025/05/01	
	5. 375% LIVE NATION ENTER	5. 375	404	418	47, 076	2022/06/15	
	5. 375% NEWFIELD EXPLORAT	5. 375	1, 750	1, 874	210, 808	2026/01/01	
	5. 375% PARSLEY ENERGY LL	5. 375	500	510	57, 349	2025/01/15	
	5. 375% SIRIUS XM RADIO I	5. 375	1, 000	1, 051	118, 213	2025/04/15	
	5. 375% SIRIUS XM RADIO I	5. 375	1, 000	1, 043	117, 369	2026/07/15	
	5. 375% T-MOBILE USA INC	5. 375	500	537	60, 441	2027/04/15	
	5. 375% TENNECO INC	5. 375	426	446	50, 179	2024/12/15	
	5. 375% TRINSEO OP / TRIN	5. 375	535	555	62, 416	2025/09/01	
	5. 45% DIAMOND 1 FIN/DIAM	5. 45	813	876	98, 610	2023/06/15	
	5. 45% FREEPORT-MCMORAN	5. 45	1, 000	1, 021	114, 839	2043/03/15	
	5. 5% AES CORP	5. 5	2, 250	2, 390	268, 825	2025/04/15	
	5. 5% AIRCASTLE LTD	5. 5	206	220	24, 786	2022/02/15	
	5. 5% AMERIGAS PART/FIN C	5. 5	500	514	57, 841	2025/05/20	
	5. 5% BMC EAST LLC	5. 5	118	122	13, 783	2024/10/01	
	5. 5% BWAY HOLDING CO	5. 5	2, 000	2, 100	236, 145	2024/04/15	
	5. 5% CASCADES INC	5. 5	222	228	25, 650	2022/07/15	
	5. 5% COTT CORP	5. 5	431	446	50, 162	2025/04/01	
	5. 5% ENDEAVOR ENERGY RES	5. 5	75	77	8, 665	2026/01/30	
	5. 5% ENERGY TRANSFER EQU	5. 5	500	525	59, 036	2027/06/01	
	5. 5% GANNETT CO	5. 5	500	528	59, 457	2024/09/15	
	5. 5% HERTZ CORP	5. 5	341	310	34, 894	2024/10/15	
	5. 5% NABORS INDUSTRIES I	5. 5	1, 000	997	112, 168	2023/01/15	
	5. 5% NAVIENT CORP	5. 5	183	183	20, 578	2023/01/25	
	5. 5% PERFORMANCE FOOD GR	5. 5	103	106	11, 929	2024/06/01	
	5. 5% PULTEGROUP INC	5. 5	500	545	61, 324	2026/03/01	
	5. 5% TESORO LOGISTICS	5. 5	246	256	28, 843	2019/10/15	
	5. 5% UNITED RENTALS NORT	5. 5	286	304	34, 291	2027/05/15	
	5. 5% VALEANT PHARMA	5. 5	176	162	18, 306	2023/03/01	
	5. 5% VALEANT PHARMACEUTI	5. 5	598	612	68, 926	2025/11/01	
	5. 5% ZIGGO SECURED FINAN	5. 5	750	761	85, 592	2027/01/15	
	5. 625% ADVANCED DISPOSAL	5. 625	500	515	57, 911	2024/11/15	
	5. 625% BUILDERS FIRSTSOU	5. 625	237	247	27, 792	2024/09/01	
	5. 625% CENTURY LINK INC	5. 625	1, 000	1, 022	114, 980	2020/04/01	
	5. 625% CENTURYLINK INC	5. 625	1, 000	937	105, 421	2025/04/01	
	5. 625% CROWNROCK LP/CROW	5. 625	750	766	86, 235	2025/10/15	
	5. 625% HESS INF PART / F	5. 625	545	559	62, 970	2026/02/15	
	5. 625% LEVEL 3 FINANCING	5. 625	473	482	54, 252	2023/02/01	
	5. 625% MGM GROWTH/MGM FI	5. 625	201	215	24, 241	2024/05/01	

普通社債券
(含む投資法人債券)

銘柄		当作成期末(第179期末)					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		外貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	5.625% MICRON TECHNOLOGY	5.625	1,000	1,057	118,915	2026/01/15	
	5.625% NEXSTAR ESCROW CO	5.625	500	520	58,544	2024/08/01	
	5.625% SALLY HOLDINGS/SA	5.625	1,740	1,755	197,375	2025/12/01	
	5.625% SENSATA TECH BV	5.625	273	301	33,922	2024/11/01	
	5.625% SM ENERGY CO	5.625	1,000	995	111,887	2025/06/01	
	5.625% TEREX CORP	5.625	905	943	106,092	2025/02/01	
	5.7% CEMEX SAB	5.7	750	791	88,950	2025/01/11	
	5.75% AMC ENTERTAINMENT	5.75	260	253	28,497	2025/06/15	
	5.75% BOMBARDIER INC	5.75	172	172	19,395	2022/03/15	
	5.75% CALPINE CORP	5.75	750	727	81,807	2025/01/15	
	5.75% ENDEAVOR ENERGY RE	5.75	75	77	8,707	2028/01/30	
	5.75% FRENSENIUS MED CAR	5.75	1,000	1,078	121,227	2021/02/15	
	5.75% MALLINCKRODT FIN/S	5.75	1,176	1,087	122,323	2022/08/01	
	5.75% NETFLIX INC	5.75	687	736	82,854	2024/03/01	
	5.75% NXP BV/NXP FUNDING	5.75	644	664	74,771	2023/03/15	
	5.75% PDC ENERGY INC	5.75	488	502	56,521	2026/05/15	
	5.75% QUEBECOR MEDIA INC	5.75	1,920	2,047	230,207	2023/01/15	
	5.75% RANGE RESOURCES CO	5.75	1,000	1,043	117,369	2021/06/01	
	5.75% SABINE PASS LIQUEF	5.75	1,000	1,105	124,278	2024/05/15	
	5.75% SPECTRUM BRANDS IN	5.75	635	671	75,511	2025/07/15	
	5.75% ST MARYS CEMENT IN	5.75	750	795	89,414	2027/01/28	
	5.75% STENA INTERNATIONA	5.75	346	324	36,475	2024/03/01	
	5.75% SUMMIT MID HLDS LL	5.75	1,140	1,154	129,795	2025/04/15	
	5.75% ZAYO GROUP LLC/ZAY	5.75	250	259	29,166	2027/01/15	
	5.875% AMC ENTERTAINMENT	5.875	259	250	28,123	2026/11/15	
	5.875% CALPINE	5.875	450	462	51,994	2024/01/15	
	5.875% CCO HLDGS LLC	5.875	1,200	1,243	139,831	2027/05/01	
	5.875% CHENIERE CORP CHR	5.875	761	829	93,329	2025/03/31	
	5.875% DELL INT LLC/EM	5.875	79	82	9,238	2021/06/15	
	5.875% ENERGY TRANSFER E	5.875	1,000	1,065	119,759	2024/01/15	
	5.875% HCA INC	5.875	1,239	1,319	148,381	2026/02/15	
	5.875% JC PENNEY CORP IN	5.875	132	127	14,342	2023/07/01	
	5.875% LG FINANCECO CORP	5.875	1,000	1,060	119,197	2024/11/01	
	5.875% MINERVA LUXEMBOUR	5.875	508	496	55,879	2028/01/19	
	5.875% OWENS-BROKWAY	5.875	250	269	30,291	2023/08/15	
	5.875% PILGRIM'S PRIDE C	5.875	602	623	70,148	2027/09/30	
	5.875% SEMINOLE HARD ROC	5.875	598	606	68,253	2021/05/15	
	5.875% SS&C TECH HOLDING	5.875	372	393	44,283	2023/07/15	
	5.875% VALEANT PHARMACEU	5.875	24	22	2,546	2023/05/15	
	6% ARDAGH PKG FIN/HLDGS	6.0	1,000	1,060	119,197	2025/02/15	
	6% KOPPERS INC	6.0	194	206	23,178	2025/02/15	
	6% PEABODY SEC FIN CORP	6.0	20	20	2,324	2022/03/31	
	6% T-MOBILE USA INC	6.0	1,000	1,068	120,180	2024/04/15	

普通社債券
(含む投資法人債券)

銘 柄		当 作 成 期 末 (第 179 期 末)					償 還 年 月 日
		利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		%	千 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円		
	6. 125% AMC ENTERTAINMENT	6. 125	279	272	30, 667	2027/05/15	
	6. 125% CENTENE ESCROW CO	6. 125	243	258	29, 074	2024/02/15	
	6. 125% RIVERS PITTSBURGH	6. 125	313	312	35, 108	2021/08/15	
	6. 125% T-MOBILE USA INC	6. 125	1, 000	1, 030	115, 893	2022/01/15	
	6. 25% AMERICAN AXLE & MF	6. 25	500	531	59, 809	2025/04/01	
	6. 25% CARRIZO OIL & GAS	6. 25	1, 000	1, 037	116, 666	2023/04/15	
	6. 25% CHS/COMMUNITY HEAL	6. 25	1, 237	1, 131	127, 277	2023/03/31	
	6. 25% FRONTIER COMM	6. 25	1, 000	722	81, 245	2021/09/15	
	6. 25% HCA HOLDINGS INC	6. 25	1, 041	1, 108	124, 669	2021/02/15	
	6. 25% SENSATA TECH UK FI	6. 25	750	817	91, 927	2026/02/15	
	6. 25% SPRINGS INDUSTRIES	6. 25	659	672	75, 586	2021/06/01	
	6. 25% TRANSOCEAN PROTEUS	6. 25	900	945	106, 265	2024/12/01	
	6. 375% ICAHN ENTERPRISES	6. 375	1, 245	1, 271	142, 975	2025/12/15	
	6. 375% MEG ENERGY CORP	6. 375	1, 000	897	100, 923	2023/01/30	
	6. 5% AMERICAN AXLE & MFG	6. 5	250	265	29, 869	2027/04/01	
	6. 5% MATTAMY GROUP CORP	6. 5	121	127	14, 286	2025/10/01	
	6. 5% MDC PARTNERS INC	6. 5	1, 278	1, 284	144, 429	2024/05/01	
	6. 5% MEG ENERGY CORP	6. 5	232	230	25, 892	2025/01/15	
	6. 5% NAVIENT CORP	6. 5	1, 067	1, 121	126, 103	2022/06/15	
	6. 5% T-MOBILE USA INC	6. 5	1, 000	1, 060	119, 228	2024/01/15	
	6. 5% VALEANT PHARMACEUTI	6. 5	117	123	13, 876	2022/03/15	
	6. 625% ALTICE FINANCING	6. 625	750	783	88, 132	2023/02/15	
	6. 625% HUGHES SATELLITE	6. 625	1, 362	1, 436	161, 580	2026/08/01	
	6. 625% TRINIDAD DRILLING	6. 625	177	169	19, 107	2025/02/15	
	6. 625% WHITING PETROLEUM	6. 625	246	257	28, 907	2026/01/15	
	6. 75% CSC HOLDINGS LLC	6. 75	1, 000	1, 073	120, 743	2021/11/15	
	6. 75% DISH DBS CORP	6. 75	2, 000	2, 110	237, 269	2021/06/01	
	6. 75% L BRANDS INC	6. 75	500	511	57, 490	2036/07/01	
	6. 75% M/I HOMES INC	6. 75	1, 000	1, 035	116, 385	2021/01/15	
	6. 75% NAVIENT CORP	6. 75	1, 358	1, 418	159, 548	2025/06/25	
	6. 75% VALEANT PHARMA	6. 75	56	56	6, 344	2021/08/15	
	6. 836% T-MOBILE USA INC	6. 836	130	135	15, 290	2023/04/28	
	6. 875% REYNOLDS GROUP HO	6. 875	1, 195	1, 214	136, 579	2021/02/15	
	6. 875% SABLE INTL FINANC	6. 875	333	351	39, 505	2022/08/01	
	6. 875% VTR FINANCE BV	6. 875	848	895	100, 745	2024/01/15	
	7% KB HOME	7. 0	2, 000	2, 218	249, 499	2021/12/15	
	7% SCIENTIFIC GAMES SGMS	7. 0	1, 000	1, 053	118, 494	2022/01/01	
	7% SPRINT COMMUNICATIONS	7. 0	3, 000	3, 213	361, 386	2020/03/01	
	7% STENA AB	7. 0	425	398	44, 864	2024/02/01	
	7% VALEANT PHARMACEUTICA	7. 0	351	378	42, 615	2024/03/15	
	7. 125% DELL INT LLC / EM	7. 125	421	461	51, 898	2024/06/15	
	7. 125% MPH ACQUISITION H	7. 125	240	259	29, 147	2024/06/01	
	7. 125% PRECISION DRILLIN	7. 125	424	434	48, 870	2026/01/15	

銘柄		当作成期末(第179期末)					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		外貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	7.125% SESI LLC	7.125	500	512	57,630	2021/12/15	
	7.125% SPRINT CORP-WI	7.125	2,000	2,062	231,928	2024/06/15	
	7.25% JBS INVESTMENTS GM	7.25	1,799	1,799	202,297	2024/04/03	
	7.25% RAIN CII CARBON LL	7.25	750	817	91,927	2025/04/01	
	7.375% EXTRACTION OIL &	7.375	500	538	60,582	2024/05/15	
	7.375% NUMERICABLE-SFR S	7.375	671	684	76,966	2026/05/01	
	7.375% ROWAN COMPANIES I	7.375	250	261	29,377	2025/06/15	
	7.375% WESTERN DIGITAL C	7.375	500	540	60,723	2023/04/01	
	7.45% BOMBARDIER INC	7.45	1,000	1,002	112,731	2034/05/01	
	7.5% BOMBARDIER INC	7.5	80	83	9,378	2025/03/15	
	7.5% CENTURYLINK INC	7.5	1,738	1,769	198,926	2024/04/01	
	7.5% FIRST QUANTUM MINER	7.5	250	272	30,601	2025/04/01	
	7.5% ONEOK INC	7.5	500	595	66,978	2023/09/01	
	7.5% TRANSOCEAN INC	7.5	309	325	36,614	2026/01/15	
	7.5% VPII ESCROW CORP	7.5	694	706	79,390	2021/07/15	
	7.625% DYNEGY INC	7.625	500	540	60,793	2024/11/01	
	7.625% HERTZ CORP	7.625	500	530	59,598	2022/06/01	
	7.75% DISH DBS CORP	7.75	500	534	60,055	2026/07/01	
	7.75% MGM RESORTS	7.75	2,000	2,288	257,369	2022/03/15	
	7.8% LIBERTY MUTUAL GROUP	7.8	500	635	71,405	2037/03/15	
	7.875% AMERICAN GREETING	7.875	173	185	20,912	2025/02/15	
	7.875% FRONTIER COMMUNIC	7.875	750	480	53,976	2027/01/15	
	7.875% FXI HOLDINGS INC	7.875	975	982	110,461	2024/11/01	
	7.875% MOHEGAN TRIBAL GA	7.875	1,000	1,031	115,964	2024/10/15	
	8% CB ESCROW CORP	8.0	1,000	1,030	115,823	2025/10/15	
	8% DYNEGY INC	8.0	250	272	30,642	2025/01/15	
	8.25% INTL LEASE FIN	8.25	379	432	48,687	2020/12/15	
	8.25% RAIN CII CARBON	8.25	290	295	33,283	2021/01/15	
	8.5% LIBERTY MEDIA CORP	8.5	1,000	1,112	125,100	2029/07/15	
	8.5% TECK RESOURCES LIMI	8.5	100	113	12,706	2024/06/01	
	8.75% BEAZER HOMES USA	8.75	510	558	62,852	2022/03/15	
	8.75% BOMBARDIER INC	8.75	500	554	62,339	2021/12/01	
	8.875% TELESAT CANADA/TE	8.875	699	786	88,427	2024/11/15	
	9% FRONTIER COMMUNICATIO	9.0	1,000	657	73,981	2031/08/15	
	9% TRANSOCEAN INC	9.0	1,000	1,106	124,397	2023/07/15	
	9.25% BLUELINE RENTAL CR	9.25	329	353	39,805	2024/03/15	
	9.25% PRIME SECSRVC BRW/	9.25	521	578	65,104	2023/05/15	
	9.875% WEATHERFORD BERMU	9.875	500	530	59,598	2024/02/15	
	SOUTHWESTERN ENERG	6.7	750	780	87,711	2025/01/23	
合 計	—	—	—	—	27,294,110	—	

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

(注2) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

投資信託財産の構成

(2018年1月10日現在)

項 目	当作成期末 (第179期末)	
	評 価 額	比 率
イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド	千円 28,523,357	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,121	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	28,537,478	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産(28,138,396千円)の投資信託財産総額(28,699,630千円)に対する比率は98.0%です。

(注3) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年1月10日における邦貨換算レートは、1米ドル=112.45円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2017年8月10日)	(2017年9月11日)	(2017年10月10日)	(2017年11月10日)	(2017年12月11日)	(2018年1月10日)現在
	第174期末	第175期末	第176期末	第177期末	第178期末	第179期末
(A) 資 産	29,478,270,010円	28,813,122,293円	29,728,465,007円	29,231,397,562円	29,055,138,766円	28,537,478,276円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	619,396	582,599	16,402,320	996	551,552	52,112
イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド(評価額)	29,438,249,507	28,790,753,717	29,700,274,166	29,188,572,032	29,037,652,083	28,523,357,766
未 収 入 金	39,401,107	21,785,977	11,788,521	42,824,534	16,935,131	14,068,398
(B) 負 債	177,203,481	158,826,229	160,267,635	176,955,393	149,858,484	143,933,954
未 払 収 益 分 配 金	91,559,009	90,665,327	89,773,511	88,611,037	87,818,614	86,790,888
未 払 解 約 金	40,020,503	22,368,576	28,190,837	42,825,528	17,486,683	14,120,510
未 払 信 託 報 酬	45,427,459	45,392,968	41,720,054	44,739,129	43,576,980	41,856,156
未 払 利 息	1	1	39	-	1	-
そ の 他 未 払 費 用	196,509	399,357	583,194	779,699	976,206	1,166,400
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	29,301,066,529	28,654,296,064	29,568,197,372	29,054,442,169	28,905,280,282	28,393,544,322
元 本	45,779,504,641	45,332,663,632	44,886,755,788	44,305,518,561	43,909,307,465	43,395,444,482
次 期 繰 越 損 益 金	△16,478,438,112	△16,678,367,568	△15,318,558,416	△15,251,076,392	△15,004,027,183	△15,001,900,160
(D) 受 益 権 総 口 数	45,779,504,641口	45,332,663,632口	44,886,755,788口	44,305,518,561口	43,909,307,465口	43,395,444,482口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,400円	6,321円	6,587円	6,558円	6,583円	6,543円

(注1) 元本の状況

当ファンドの第174期首元本額は46,228,229,092円、第174～179期中追加設定元本額は123,861,841円、第174～179期中一部解約元本額は2,956,646,451円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

損益の状況

第174期（自2017年7月11日至2017年8月10日）、第175期（自2017年8月11日至2017年9月11日）
 第176期（自2017年9月12日至2017年10月10日）、第177期（自2017年10月11日至2017年11月10日）
 第178期（自2017年11月11日至2017年12月11日）、第179期（自2017年12月12日至2018年1月10日）

項目	第174期	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期
(A) 配当等収益	△ 115円	△ 125円	△ 365円	△ 114円	△ 324円	△ 60円
支払利息	△ 115	△ 125	△ 365	△ 114	△ 324	△ 60
(B) 有価証券売買損益	△ 757,808,078	△ 225,348,794	1,326,334,402	1,640,919	241,597,580	△ 45,604,681
売 買 益	3,836,326	1,538,506	1,335,236,817	4,468,088	242,562,397	1,812,736
売 買 損	△ 761,644,404	△ 226,887,300	△ 8,902,415	△ 2,827,169	△ 964,817	△ 47,417,417
(C) 信託報酬等	△ 45,623,968	△ 45,595,816	△ 41,903,891	△ 44,935,638	△ 43,773,489	△ 42,046,350
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 803,432,161	△ 270,944,735	1,284,430,146	△ 43,294,833	197,823,767	△ 87,651,091
(E) 前期繰越損益金	△ 4,134,241,331	△ 4,973,702,347	△ 5,276,995,860	△ 4,027,251,130	△ 4,115,406,078	△ 3,956,572,625
(F) 追加信託差損益金	△ 11,449,205,611	△ 11,343,055,159	△ 11,236,219,191	△ 11,091,919,392	△ 10,998,626,258	△ 10,870,885,556
(配当等相当額)	(34,457,689)	(31,798,285)	(30,440,621)	(30,578,913)	(28,948,643)	(29,068,335)
(売買損益相当額)	(△ 11,483,663,300)	(△ 11,374,853,444)	(△ 11,266,659,812)	(△ 11,122,498,305)	(△ 11,027,574,901)	(△ 10,899,953,891)
(G) 計 (D+E+F)	△ 16,386,879,103	△ 16,587,702,241	△ 15,228,784,905	△ 15,162,465,355	△ 14,916,208,569	△ 14,915,109,272
(H) 収益分配金	△ 91,559,009	△ 90,665,327	△ 89,773,511	△ 88,611,037	△ 87,818,614	△ 86,790,888
次期繰越損益金(G+H)	△ 16,478,438,112	△ 16,678,367,568	△ 15,318,558,416	△ 15,251,076,392	△ 15,004,027,183	△ 15,001,900,160
追加信託差損益金	△ 11,452,394,265	△ 11,345,146,724	△ 11,236,219,191	△ 11,094,566,731	△ 10,998,626,258	△ 10,873,327,669
(配当等相当額)	(31,298,872)	(29,746,604)	(30,475,935)	(27,955,956)	(29,009,937)	(26,644,955)
(売買損益相当額)	(△ 11,483,693,137)	(△ 11,374,893,328)	(△ 11,266,695,126)	(△ 11,122,522,687)	(△ 11,027,636,195)	(△ 10,899,972,624)
分配準備積立金	1,676,513,872	1,660,214,808	1,671,216,846	1,650,091,028	1,653,297,015	1,634,541,094
繰越損益金	△ 6,702,557,719	△ 6,993,435,652	△ 5,753,556,071	△ 5,806,600,689	△ 5,658,697,940	△ 5,763,113,585

(注1) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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引いた差額分をいいます。

(注4) マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に年10,000分の35を上限とする固定率を乗じて得た金額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注5) 分配金の計算過程

第174期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(88,370,355円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(34,487,526円)および分配準備積立金(1,676,513,872円)より、分配対象収益は1,799,371,753円(10,000口当たり393円)であり、うち91,559,009円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第175期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(88,573,762円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(31,838,169円)および分配準備積立金(1,660,214,808円)より、分配対象収益は1,780,626,739円(10,000口当たり392円)であり、うち90,665,327円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第176期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(117,496,913円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(30,475,935円)および分配準備積立金(1,643,493,444円)より、分配対象収益は1,791,466,292円(10,000口当たり399円)であり、うち89,773,511円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第177期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(85,963,698円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(30,603,295円)および分配準備積立金(1,650,091,028円)より、分配対象収益は1,766,658,021円(10,000口当たり398円)であり、うち88,611,037円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第178期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(106,219,947円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(29,009,937円)および分配準備積立金(1,634,895,682円)より、分配対象収益は1,770,125,566円(10,000口当たり403円)であり、うち87,818,614円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第179期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(84,348,775円)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定する収益調整金(29,087,068円)および分配準備積立金(1,634,541,094円)より、分配対象収益は1,747,976,937円(10,000口当たり402円)であり、うち86,790,888円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

分配金のお知らせ

決算期	第174期	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期
1万口当たり分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円

- ◇分配金のお支払いは決算日から起算して5営業日までに開始いたします。
- ◇分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となり、分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ◇元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額がその後の新たな個別元本となります。
- ◇個人の受益者については、原則として20.315%の税率で源泉徴収（申告不要）されます。
- ◇「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合、分配金は、税金を差引いた後、決算日の基準価額に基づいて自動的に無手数料で再投資いたしました。

復興特別所得税について

2013年1月1日から2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税額に対して2.1%の税率で復興特別所得税が付加されます。

上記は、当ファンドの直近決算日時点のもので、今後税法が改正された場合等には税率等が変更される場合があります。

- ※法人の受益者に対する課税は異なります。
- ※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。
- ※少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

お知らせ

該当事項はありません。

イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日：2017年1月30日）
（計算期間：2016年1月30日～2017年1月30日）

「イーストスプリング米国高利回り社債オープン マザーファンド」の第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として米国の高利回り社債に投資することにより、高い金利収入の確保とともに、証券の値上り益を追求し信託財産の成長を図ることを目指した運用を行います。
主要投資対象	米国の高利回り社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		
	円	%	%	百万円
10期(2013年1月29日)	14,982	32.1	95.2	67,306
11期(2014年1月29日)	17,791	18.7	95.5	55,837
12期(2015年1月29日)	20,959	17.8	94.5	47,783
13期(2016年1月29日)	20,272	△ 3.3	93.1	35,524
14期(2017年1月30日)	22,736	12.2	94.7	32,470

(注1) 純資産総額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当ファンドは公表されている適切な指数が存在しないためベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

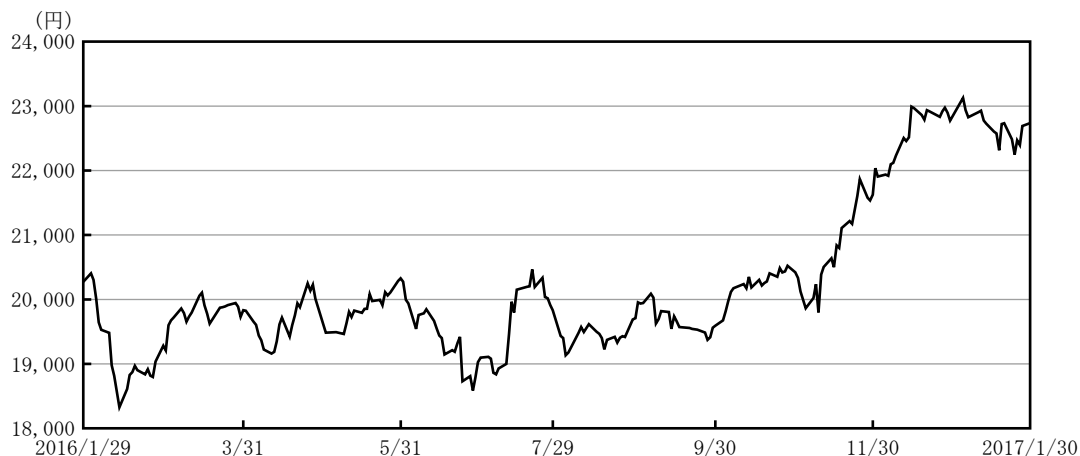
当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率
		騰落率	
(期首) 2016年1月29日	円 20,272	% —	% 93.1
2月末	19,281	△ 4.9	93.6
3月末	19,833	△ 2.2	96.3
4月末	20,012	△ 1.3	95.8
5月末	20,328	0.3	94.4
6月末	19,027	△ 6.1	95.1
7月末	19,832	△ 2.2	93.9
8月末	19,954	△ 1.6	95.6
9月末	19,591	△ 3.4	96.8
10月末	20,420	0.7	97.3
11月末	21,625	6.7	96.3
12月末	22,775	12.3	96.7
(期末) 2017年1月30日	22,736	12.2	94.7

(注) 騰落率は期首比です。

運用経過

基準価額の推移について（第14期：2016年1月30日から2017年1月30日まで）



当期首20,272円であった基準価額は、当期末時点で22,736円となり、騰落率は12.2%となりました。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

期初から2016年2月中旬にかけて、地政学的リスクや世界的な株安を背景にリスク回避姿勢が強まり為替市場で円高となったため、基準価額は下落しました。その後は原油価格の持ち直しを好感し高利回り社債市場は堅調となりましたが、米国の利上げ観測後退などから為替市場で円高傾向となり基準価額は横ばいでの推移が続きました。11月中旬以降は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて財政支出拡大や規制緩和などへの期待から米国長期金利が急上昇し、それを受けて為替市場で米ドル高円安が進行したため、基準価額は大幅に上昇しました。

投資環境について

○海外債券市況

期初から2016年2月中旬にかけて、地政学的リスクの高まりや原油価格の下落などからリスク回避姿勢が強まり、社債スプレッドが拡大し、米国高利回り社債市場は下落（利回りは上昇）しました。しかし、その後は3月に欧州中央銀行（ECB）が追加緩和を決定したことや原油価格が反転したこと、米国の経済指標が好調だったことなどを背景に社債スプレッドは縮小傾向となり、同市

場は上昇（利回りは低下）しました。11月の米国大統領選挙以降はトランプ新政権による積極的な経済政策への期待から株高および債券安が進みましたが、高利回り社債市場では、企業収益の改善期待から社債スプレッドが大幅に縮小し、結果として期末にかけて米国債利回りの上昇にもかかわらず高利回り社債の利回りは低下（価格は上昇）しました。

○為替市況

2016年1月末の日銀のマイナス金利導入を受けて期初には1米ドル120円台であった為替は、欧州の金融不安と原油安を背景に2月中旬には円高傾向が強まりました。その後も米国景気に対する不透明感などからリスク回避姿勢が続き円高となりました。特に6月末には英国国民投票で欧州連合（EU）離脱が選択され、リスク回避の円買いから一時円は対米ドルで100円を割り込みました。10月以降は、好調な米国の経済指標を背景に米国の利上げ観測の高まりから米ドルは底堅い動きとなり、特に11月の米国大統領選挙でトランプ氏が勝利すると財政支出拡大による景気回復期待が強まったことや米国の金利上昇などを背景として円安米ドル高が進みました。

ポートフォリオについて

主として米国の高利回り社債に投資することにより、高い金利収入の確保とともに証券の値上り益の獲得を目指しました。クレジット・アナリスト・チームによる徹底した個別銘柄の調査・分析とバリュエーションを重視し、業種や個別銘柄の分散に配慮した銘柄選択及びポートフォリオ構築を行いました。

当期はすべてのセクターでプラスのパフォーマンスとなりましたが、特にエネルギー、基礎産業セクターの保有などが大きくプラスに寄与しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用の基本方針に適合した、公表されている指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

今後の運用方針について

市場ではトランプ大統領の政策を見極めたいと債券安の流れに一服感が生じています。米国高利回り社債市場は2017年も良好な市場環境に支えられ堅調に推移するものと予想していますが、大幅に上昇した2016年よりも上昇幅は抑えられるとみています。一方で、予想を上回るインフレ率の加速による金利の大幅上昇や為替市場の動向には注意が必要です。社債スプレッドは、2016年からの好調な市場環境を背景に既に大幅に縮小しており、今後のパフォーマンスには個別の銘柄選択が最も重要な要因となってくると考えています。引き続きマクロ経済環境を注視しながら、企業のクレジット分析を徹底して行っていく方針です。

1 万口当たりの費用明細

項目	当期 2016/1/30 ～2017/1/30		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用	4円	0.019%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 期中の平均基準価額は、20,245円です。
（保管費用）	(4)	(0.019)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他1）	(0)	(0.000)	信託管理事務に係る手数料
（その他）	(0)	(0.000)	余資運用に係る費用（マイナス金利相当額）
合計	4	0.019	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約によ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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 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

(2016年1月30日から2017年1月30日まで)

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	社債券 (投資法人債券を含む)	千米ドル 137,831 (1,548)	千米ドル 165,737 (11,528)

(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) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

利害関係人との取引状況等

(2016年1月30日から2017年1月30日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(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

公社債

(A) 種類別開示

外国（外貨建）公社債

組入有価証券明細表

(2017年1月30日現在)

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年 以上	2年 以上	2年 未満
ア メ リ カ	千米ドル 261,009	千米ドル 268,115	千円 30,760,925	% 94.7	% 83.7	% 67.5	% 25.8	% 1.4
合 計	261,009	268,115	30,760,925	94.7	83.7	67.5	25.8	1.4

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注4) BB格以下組入比率の計算においては、S&Pおよびムーディーズの格付けをもとに、当社が独自の基準で採用した格付けを用いています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

組入有価証券明細表

(2017年1月30日現在)

銘 柄	当 期 末						償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円			
普通社債券 (含む投資法人債券)	10.5% FRONTIER COMMUNICA	10.5	288	304	34,942	2022/09/15	
	10.5% QUAPAW DOWNSTREAM	10.5	2,500	2,496	286,466	2019/07/01	
	10.5% WESTERN DIGITAL CO	10.5	1,000	1,185	136,012	2024/04/01	
	11.5% CALUMET SPECIALTY	11.5	750	864	99,169	2021/01/15	
	3.1% FREEPORT-MCMORAN	3.1	1,250	1,237	141,978	2020/03/15	
	3.15% NEWELL RUBBERMAID	3.15	1,125	1,142	131,080	2021/04/01	
	3.25% GILEAD SCIENCES IN	3.25	597	610	70,021	2022/09/01	
	3.36% SPRINT SPECTRUM /	3.36	727	728	83,617	2021/09/20	
	3.5% ALLY FINANCIAL INC	3.5	2,000	2,017	231,467	2019/01/27	
	3.5% MASCO CORP	3.5	811	819	93,998	2021/04/01	
	3.75% CONSTELLATION BR	3.75	330	341	39,129	2021/05/01	
	3.75% TECK RESOURCES LIM	3.75	1,000	975	111,861	2023/02/01	
	3.8% CONTINENTAL RESOURC	3.8	1,000	943	108,276	2024/06/01	
	3.875% CIT GROUP INC	3.875	2,500	2,553	292,963	2019/02/19	
	3.875% CNH INDUSTRIAL CA	3.875	757	770	88,343	2018/07/16	
	3.875% CONSTELLATION BR	3.875	272	282	32,467	2019/11/15	
	3.875% NXP BV/NXP FUNDIN	3.875	500	508	58,368	2022/09/01	
	4% BALL CORP	4.0	1,000	996	114,299	2023/11/15	
	4% GM FINANCIAL	4.0	500	491	56,381	2025/01/15	
	4% ZF NA CAPITAL	4.0	667	694	79,681	2020/04/29	
4.1% BARRICK GOLD CORP	4.1	314	329	37,794	2023/05/01		
4.125% ALLY FINANCIAL	4.125	2,000	2,036	233,613	2020/03/30		
4.125% ALLY FINANCIAL IN	4.125	500	498	57,221	2022/02/13		
4.125% ANGLO AMERICAN CA	4.125	766	775	88,981	2022/09/27		

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	4. 125% LENNAR CORP	4. 125	447	449	51,604	2022/01/15
	4. 125% SCHAEFFLER VE PIK	4. 125	200	201	23,094	2021/09/15
	4. 125% TARGA RESOURCES	4. 125	1,000	1,016	116,594	2019/11/15
	4. 2% GENERAL MOTORS FINL	4. 2	500	516	59,251	2021/03/01
	4. 25% AERCAP IRELAND CAP	4. 25	121	125	14,395	2020/07/01
	4. 25% CONSTELLATION BR	4. 25	277	288	33,057	2023/05/01
	4. 25% HILTON DOMESTIC LL	4. 25	107	105	12,138	2024/09/01
	4. 25% SCHAEFFLER FINANCE	4. 25	1,346	1,371	157,322	2021/05/15
	4. 375% BALL CORP	4. 375	787	826	94,807	2020/12/15
	4. 375% COMMSCOPE INC	4. 375	864	889	102,100	2020/06/15
	4. 375% NETFLIX INC	4. 375	1,500	1,471	168,782	2026/11/15
	4. 375% QVC INC	4. 375	500	504	57,826	2023/03/15
	4. 375% SANMINA CORP	4. 375	1,354	1,391	159,616	2019/06/01
	4. 375% TENET HEALTHCARE	4. 375	500	501	57,508	2021/10/01
	4. 375% TOLL BROS FINANCE	4. 375	2,000	2,012	230,894	2023/04/15
	4. 4% ENLINK MIDSTREAM PA	4. 4	500	502	57,699	2024/04/01
	4. 45% CENOVUS ENERGY INC	4. 45	1,000	892	102,344	2042/09/15
	4. 5% CNH INDUSTRIAL NV	4. 5	1,250	1,250	143,412	2023/08/15
	4. 5% CONTINENTAL RESOURC	4. 5	750	745	85,509	2023/04/15
	4. 5% CROWN AMER/CAP CORP	4. 5	1,000	1,025	117,598	2023/01/15
	4. 5% ENSCO PLC	4. 5	750	670	76,904	2024/10/01
	4. 5% MGM GROWTH LP/MGP E	4. 5	556	535	61,397	2026/09/01
	4. 5% MPLX LP	4. 5	1,000	1,042	119,623	2023/07/15
	4. 5% PVH CORP	4. 5	863	875	100,497	2022/12/15
	4. 5% SCHAEFFLER VERW PIK	4. 5	200	198	22,716	2023/09/15
	4. 55% FREEPORT-MCMORAN	4. 55	3,750	3,534	405,498	2024/11/14
	4. 625% AERCAP IRELAND CA	4. 625	500	522	59,937	2022/07/01
	4. 625% ALLY FINANCIAL IN	4. 625	2,000	2,032	233,188	2022/05/19
	4. 625% ARDAGH PKG FIN/HL	4. 625	1,004	1,014	116,340	2023/05/15
	4. 625% B&G FOODS INC	4. 625	769	788	90,433	2021/06/01
	4. 625% GLENCORE FUNDING	4. 625	1,500	1,548	177,708	2024/04/29
	4. 625% HANESBRANDS INC	4. 625	250	248	28,467	2024/05/15
	4. 625% INTL LEASE FINANC	4. 625	1,500	1,569	180,059	2021/04/15
	4. 625% NCL CORP LTD	4. 625	1,000	1,027	117,885	2020/11/15
	4. 625% NOBLE HOLDING INT	4. 625	139	132	15,150	2021/03/01
	4. 625% UNITED AIR 2014-2	4. 625	1,808	1,835	210,596	2022/09/03
	4. 75% AMC NETWORKS INC	4. 75	1,000	1,021	117,168	2022/12/15
	4. 75% ARAMARK SERVICES I	4. 75	571	568	65,265	2026/06/01
	4. 75% ASHLAND INC	4. 75	2,000	2,045	234,622	2022/08/15
	4. 75% CENTENE CORP	4. 75	1,534	1,560	179,075	2022/05/15
	4. 75% CONSTELLATION BR	4. 75	100	106	12,242	2024/11/15
	4. 75% CONSTELLATION BRAN	4. 75	312	333	38,272	2025/12/01
	4. 75% FRESENIUS MED CARE	4. 75	571	579	66,493	2024/10/15
	4. 75% GRAPHIC PACKAGING	4. 75	581	610	70,074	2021/04/15
	4. 75% NCL CORP LTD	4. 75	336	340	39,043	2021/12/15
	4. 75% NUSTAR LOGISTICS L	4. 75	500	500	57,365	2022/02/01
	4. 75% SCHAEFFLER VER PIK	4. 75	200	197	22,601	2026/09/15
	4. 8% NUSTAR LOGISTICS LP	4. 8	500	510	58,512	2020/09/01

普通社債券
(含む投資法人債券)

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	4.875% ANGLO AMERICAN CA	4.875	234	237	27,249	2025/05/14
	4.875% GANNETT CO	4.875	198	202	23,284	2021/09/15
	4.875% LIVE NATION ENTER	4.875	568	569	65,290	2024/11/01
	4.875% MPLX LP	4.875	1,000	1,049	120,389	2024/12/01
	4.875% RANGE RESOURCES C	4.875	250	242	27,857	2025/05/15
	5% AIRCASTLE LTD	5.0	157	159	18,282	2023/04/01
	5% ALLISON TRANSMISSION	5.0	500	505	57,938	2024/10/01
	5% ANTERO RESOURCES CORP	5.0	1,111	1,087	124,795	2025/03/01
	5% COMMSCOPE INC	5.0	500	515	59,157	2021/06/15
	5% CONTINENTAL RES	5.0	1,750	1,793	205,796	2022/09/15
	5% DISH DBS CORP	5.0	1,500	1,473	169,083	2023/03/15
	5% FIRST DATA CORPORATIO	5.0	2,500	2,534	290,768	2024/01/15
	5% FORD MOTOR CREDIT	5.0	1,000	1,037	119,073	2018/05/15
	5% HUNTINGTON INGALLS	5.0	466	486	55,870	2021/12/15
	5% HUNTINGTON INGALLS IN	5.0	428	447	51,314	2025/11/15
	5% KFC HLD/PIZZA HUT/TAC	5.0	356	365	41,967	2024/06/01
	5% NIELSEN CO LUX SARL/T	5.0	530	529	60,730	2025/02/01
	5% NIELSEN FINANCE LLC/C	5.0	750	765	87,768	2022/04/15
	5% POST HOLDINGS INC	5.0	746	722	82,903	2026/08/15
	5% SM ENERGY CO	5.0	750	720	82,605	2024/01/15
	5% TENNECO INC	5.0	500	499	57,290	2026/07/15
	5% UNITYMEDIA HESSEN	5.0	1,000	1,018	116,881	2025/01/15
	5% WOLVERINE WORLD WIDE	5.0	429	408	46,881	2026/09/01
	5.1% WYNDHAM WORLDWIDE C	5.1	704	741	85,034	2025/10/01
	5.125% ALCOA INC	5.125	1,000	1,040	119,319	2024/10/01
	5.125% ANTERO RESOURC-WI	5.125	750	759	87,123	2022/12/01
	5.125% ARAMARK SERVICES	5.125	111	115	13,244	2024/01/15
	5.125% BERRY PLASTICS CO	5.125	1,000	1,030	118,171	2023/07/15
	5.125% CCO HLDGS LLC/CAP	5.125	812	844	96,887	2023/05/01
	5.125% CCO HOLDINGS LLC	5.125	2,857	2,971	340,894	2023/02/15
	5.125% CSH/COMMUNITY HEA	5.125	661	622	71,475	2021/08/01
	5.125% GOODYEAR TIRE & R	5.125	341	349	40,101	2023/11/15
	5.125% GRAY TELEVISION I	5.125	383	375	43,062	2024/10/15
	5.125% HEALTHSOUTH CORP	5.125	1,000	1,000	114,802	2023/03/15
	5.125% LEVEL 3 FINANCING	5.125	1,000	1,017	116,737	2023/05/01
	5.125% REYNOLDS GRP ISS/	5.125	500	512	58,799	2023/07/15
	5.125% SEALED AIR CORP	5.125	1,500	1,556	178,548	2024/12/01
	5.125% SINCLAIR TELEVISI	5.125	700	660	75,743	2027/02/15
	5.125% STEEL DYNAMICS	5.125	449	465	53,445	2021/10/01
	5.125% TESORO CORP	5.125	632	658	75,591	2024/04/01
	5.125% UNIVISION COMMUNI	5.125	1,500	1,503	172,525	2023/05/15
	5.2% ENSCO PLC	5.2	1,789	1,616	185,496	2025/03/15
	5.25% ACCO BRANDS CORP	5.25	360	362	41,565	2024/12/15
	5.25% ESH HOSPITALITY	5.25	323	325	37,335	2025/05/01
	5.25% GRIFOLS WORLDWIDE	5.25	1,000	1,037	118,975	2022/04/01
	5.25% HOLOGIC INC	5.25	401	419	48,134	2022/07/15
	5.25% HUGHES SATELLITE S	5.25	362	363	41,688	2026/08/01

普通社債券
(含む投資法人債券)

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	5.25% KFC HLD/PIZZA HUT/	5.25	412	419	48,095	2026/06/01
	5.25% MEDNAX INC	5.25	157	162	18,598	2023/12/01
	5.25% MICRON TECHNOLOGY	5.25	500	501	57,508	2024/01/15
	5.25% PARK AEROSPACE HOL	5.25	354	363	41,680	2022/08/15
	5.25% QEP RESOURCES INC	5.25	500	498	57,221	2023/05/01
	5.25% RSP PERMIAN INC	5.25	142	145	16,658	2025/01/15
	5.25% SCOTTS MIRACLE-GRO	5.25	71	71	8,206	2026/12/15
	5.25% SUN MERGER SUB INC	5.25	68	68	7,887	2018/08/01
	5.25% TAYLOR MORRISON CO	5.25	1,152	1,186	136,134	2021/04/15
	5.25% TESORO LOGISTICS L	5.25	364	378	43,432	2025/01/15
	5.375% CCO HLDGS LLC/CAP	5.375	972	1,014	116,396	2025/05/01
	5.375% CHURCHILL DOWNS	5.375	1,351	1,401	160,812	2021/12/15
	5.375% DIAMONDBACK ENERG	5.375	1,202	1,238	142,042	2025/05/31
	5.375% GLP CAPITAL LP /	5.375	280	293	33,650	2026/04/15
	5.375% HCA INC	5.375	4,500	4,601	527,901	2025/02/01
	5.375% LEVEL 3 FINANCING	5.375	500	511	58,655	2025/05/01
	5.375% LIVE NATION ENTER	5.375	404	420	48,204	2022/06/15
	5.375% NEWFIELD EXPLORAT	5.375	1,750	1,806	207,302	2026/01/01
	5.375% PARSLEY ENERGY LL	5.375	434	447	51,348	2025/01/15
	5.375% SIRIUS XM RADIO I	5.375	1,000	1,021	117,239	2025/04/15
	5.375% SIRIUS XM RADIO I	5.375	1,000	1,021	117,168	2026/07/15
	5.375% TENNECO INC	5.375	426	441	50,707	2024/12/15
	5.375% WEST CORP	5.375	1,562	1,507	172,935	2022/07/15
普通社債券 (含む投資法人債券)	5.45% DIAMOND 1 FIN/DIAM	5.45	813	871	99,961	2023/06/15
	5.45% FREEPORT-MCMORAN	5.45	1,000	861	98,885	2043/03/15
	5.5% AES CORP	5.5	3,250	3,306	379,397	2025/04/15
	5.5% AIRCASTLE LTD	5.5	206	216	24,875	2022/02/15
	5.5% AMERIGAS PART/FIN C	5.5	1,000	1,023	117,454	2025/05/20
	5.5% BMC EAST LLC	5.5	118	119	13,758	2024/10/01
	5.5% CASCADES INC	5.5	913	926	106,319	2022/07/15
	5.5% CONCHIO RESOURCES IN	5.5	2,250	2,340	268,468	2023/04/01
	5.5% ENERGIZER SPINCO IN	5.5	580	591	67,874	2025/06/15
	5.5% ENERGY TRANSFER EQU	5.5	150	155	17,811	2027/06/01
	5.5% GANNETT CO	5.5	550	559	64,205	2024/09/15
	5.5% HERTZ CORP	5.5	341	289	33,181	2024/10/15
	5.5% NABORS INDUSTRIES I	5.5	423	442	50,714	2023/01/15
	5.5% PARK AEROSPACE HOLD	5.5	430	441	50,628	2024/02/15
	5.5% PERFORMANCE FOOD GR	5.5	103	105	12,112	2024/06/01
	5.5% PULTEGROUP INC	5.5	500	508	58,368	2026/03/01
	5.5% SALLY HOLDINGS/SALL	5.5	740	773	88,720	2023/11/01
	5.5% TEMPUR SEALY INTL I	5.5	571	580	66,575	2026/06/15
	5.5% TESORO LOGISTICS	5.5	246	261	29,952	2019/10/15
	5.5% VALEANT PHARMA	5.5	200	152	17,438	2023/03/01
	5.5% ZIGGO SECURED FINAN	5.5	1,250	1,243	142,695	2027/01/15
	5.625% ADVANCED DISPOSAL	5.625	500	509	58,440	2024/11/15
	5.625% BUILDERS FIRSTSOU	5.625	237	242	27,870	2024/09/01
	5.625% CENTURY LINK INC	5.625	1,000	1,060	121,613	2020/04/01

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	5.625% CENTURYLINK INC	5.625	1,000	952	109,280	2025/04/01	
	5.625% HILTON WORLDWIDE	5.625	1,000	1,028	118,028	2021/10/15	
	5.625% INTL GAME TECH	5.625	564	597	68,577	2020/02/15	
	5.625% LEVEL 3 FINANCING	5.625	473	486	55,759	2023/02/01	
	5.625% MGP ESCROW ISSUER	5.625	201	210	24,160	2024/05/01	
	5.625% MICRON TECHNOLOGY	5.625	1,000	1,002	115,016	2026/01/15	
	5.625% NEXSTAR ESCROW CO	5.625	254	252	28,959	2024/08/01	
	5.625% PENN NATIONAL GAM	5.625	222	223	25,597	2027/01/15	
	5.625% SABINE PASS LIQU	5.625	2,000	2,176	249,753	2025/03/01	
	5.625% SALLY HOLDINGS/SA	5.625	1,500	1,567	179,839	2025/12/01	
	5.625% SENSATA TECH BV	5.625	273	286	32,848	2024/11/01	
	5.625% SM ENERGY CO	5.625	1,000	985	113,009	2025/06/01	
	5.625% TEREX CORP	5.625	905	921	105,777	2025/02/01	
	5.7% CEMEX SAB	5.7	1,250	1,251	143,591	2025/01/11	
	5.75% ALLY FINANCIAL INC	5.75	1,000	1,017	116,737	2025/11/20	
	5.75% ENDO FINANCE CO	5.75	1,164	1,012	116,184	2022/01/15	
	5.75% FRENSIENUS MED CAR	5.75	1,000	1,080	123,908	2021/02/15	
	5.75% MALLINCKRODT FIN/S	5.75	1,176	1,078	123,791	2022/08/01	
	5.75% NXP BV/NXP FUNDING	5.75	644	679	77,912	2023/03/15	
	5.75% QUEBECOR MEDIA INC	5.75	1,920	2,016	231,295	2023/01/15	
	5.75% RANGE RESOURCES	5.75	1,000	1,047	120,179	2021/06/01	
	5.75% SABINE PASS LIQUEF	5.75	1,000	1,097	125,916	2024/05/15	
	5.75% SPECTRUM BRANDS IN	5.75	635	665	76,314	2025/07/15	
	5.75% ST MARYS CEMENT IN	5.75	750	731	83,896	2027/01/28	
	5.875% AMC ENTERTAINMENT	5.875	259	265	30,457	2026/11/15	
	5.875% CALPINE	5.875	450	472	54,193	2024/01/15	
	5.875% CCO HLDGS LLC	5.875	1,200	1,278	146,624	2027/05/01	
	5.875% CHENIERE CORP CHR	5.875	1,500	1,590	182,420	2025/03/31	
	5.875% ENERGY TRANSFER E	5.875	1,000	1,070	122,761	2024/01/15	
	5.875% GRAY TELEVISION I	5.875	804	799	91,781	2026/07/15	
	5.875% HCA INC	5.875	2,000	2,135	244,948	2023/05/01	
	5.875% HCA INC	5.875	500	520	59,731	2026/02/15	
	5.875% JC PENNEY CORP IN	5.875	132	135	15,522	2023/07/01	
	5.875% LG FINANCECO CORP	5.875	1,000	1,015	116,450	2024/11/01	
	5.875% OWENS-BROKWAY	5.875	250	263	30,242	2023/08/15	
	5.875% REGENCY ENERGY PA	5.875	500	553	63,489	2022/03/01	
	5.875% SABINE PASS LIQUE	5.875	1,000	1,115	127,923	2026/06/30	
	5.875% SEMINOLE HARD ROC	5.875	598	606	69,637	2021/05/15	
	5.875% SS&C TECH HOLDING	5.875	372	387	44,493	2023/07/15	
	5.875% SUN MERGER SUB IN	5.875	301	314	36,094	2021/08/01	
	5.875% UNITED RENTALS NO	5.875	286	296	34,043	2026/09/15	
	5.875% US FOODS INC	5.875	742	775	88,960	2024/06/15	
	6% ARDAGH PKG FIN/HLDGS	6.0	1,000	1,002	115,016	2025/02/15	
	6% ENTEGRIS INC	6.0	955	995	114,258	2022/04/01	
	6% KOPPERS INC	6.0	194	199	22,925	2025/02/15	
	6% POST HOLDINGS INC	6.0	594	623	71,557	2022/12/15	
	6% SCOTTS MIRACLE-GRO CO	6.0	344	364	41,785	2023/10/15	
	6% T-MOBILE USA INC	6.0	811	865	99,268	2024/04/15	

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	6. 125% CENTENE ESCROW CO	6. 125	485	515	59, 121	2024/02/15	
	6. 125% RIVERS PITTSBURGH	6. 125	313	321	36, 898	2021/08/15	
	6. 125% T-MOBILE USA INC	6. 125	1, 000	1, 057	121, 326	2022/01/15	
	6. 125% TESORO LOGISTICS	6. 125	1, 100	1, 150	132, 039	2021/10/15	
	6. 125% UNITED RENTALS NO	6. 125	1, 000	1, 053	120, 896	2023/06/15	
	6. 25% CARRIZO OIL & GAS	6. 25	1, 000	1, 025	117, 598	2023/04/15	
	6. 25% FRONTIER COMM	6. 25	3, 500	3, 307	379, 469	2021/09/15	
	6. 25% HCA HOLDINGS INC	6. 25	1, 041	1, 120	128, 540	2021/02/15	
	6. 25% INTL GAME TECH	6. 25	443	472	54, 256	2022/02/15	
	6. 25% REVLON CONSUMER PR	6. 25	612	633	72, 637	2024/08/01	
	6. 25% SENSATA TECH UK FI	6. 25	750	802	92, 070	2026/02/15	
	6. 25% SPRINGS INDUSTRIES	6. 25	659	681	78, 158	2021/06/01	
	6. 25% TESORO LOGISTICS	6. 25	589	628	72, 052	2022/10/15	
	6. 25% TRANSOCEAN PROTEUS	6. 25	1, 000	1, 037	119, 032	2024/12/01	
	6. 375% MEG ENERGY CORP	6. 375	1, 000	931	106, 842	2023/01/30	
	6. 5% MDC PARTNERS INC	6. 5	1, 278	1, 108	127, 197	2024/05/01	
	6. 5% MEG ENERGY CORP	6. 5	232	235	27, 049	2025/01/15	
	6. 5% PLATFORM SPECIALTY	6. 5	500	512	58, 834	2022/02/01	
	6. 5% T-MOBILE USA INC	6. 5	1, 000	1, 077	123, 621	2024/01/15	
	6. 5% T-MOBILE USA INC	6. 5	2, 000	2, 205	252, 979	2026/01/15	
	6. 625% ALTICE FINANCING	6. 625	750	790	90, 651	2023/02/15	
	6. 625% HUGHES SATELLITE	6. 625	362	375	43, 089	2026/08/01	
	6. 625% LIMITED BRANDS	6. 625	2, 000	2, 192	251, 545	2021/04/01	
	6. 625% NEPTUNE FINCO COR	6. 625	1, 500	1, 643	188, 547	2025/10/15	
	6. 625% NRG ENERGY INC	6. 625	455	452	51, 941	2027/01/15	
	6. 625% TRINIDAD DRILLING	6. 625	177	177	20, 307	2025/02/15	
	6. 75% CSC HOLDINGS LLC	6. 75	1, 000	1, 092	125, 398	2021/11/15	
	6. 75% DISH DBS CORP	6. 75	2, 000	2, 156	247, 392	2021/06/01	
	6. 75% DYNEGY INC	6. 75	255	263	30, 280	2019/11/01	
	6. 75% M/I HOMES INC	6. 75	1, 000	1, 046	120, 076	2021/01/15	
	6. 75% MERITOR INC	6. 75	750	776	89, 059	2021/06/15	
	6. 75% TRINSEO OP/TRINSEO	6. 75	292	306	35, 176	2022/05/01	
	6. 836% T-MOBILE USA INC	6. 836	130	139	15, 958	2023/04/28	
	6. 875% QEP RESOURCES INC	6. 875	1, 000	1, 065	122, 187	2021/03/01	
	6. 875% REYNOLDS GROUP HO	6. 875	1, 195	1, 227	140, 884	2021/02/15	
	6. 875% SABLE INTL FINANC	6. 875	333	351	40, 306	2022/08/01	
	6. 875% VIASAT INC	6. 875	1, 000	1, 027	117, 885	2020/06/15	
	6. 875% VTR FINANCE BV	6. 875	848	888	101, 912	2024/01/15	
	6. 9% SPRINT CAPITAL CORP	6. 9	3, 000	3, 195	366, 562	2019/05/01	
	7% KB HOME	7. 0	2, 000	2, 150	246, 669	2021/12/15	
	7% SCIENTIFIC GAMES SGMS	7. 0	1, 399	1, 502	172, 344	2022/01/01	
	7% STENA AB	7. 0	1, 000	945	108, 419	2024/02/01	
	7. 125% ARGOS MERGER SUB	7. 125	1, 197	1, 199	137, 589	2023/03/15	
	7. 125% MPH ACQUISITION H	7. 125	240	253	29, 049	2024/06/01	
	7. 125% SESI LLC	7. 125	750	772	88, 628	2021/12/15	
	7. 125% SPRINT CORP-WI	7. 125	2, 000	2, 111	242, 195	2024/06/15	
	7. 25% ARCELORMITTAL MTNA	7. 25	237	268	30, 759	2022/02/25	
	7. 25% JBS INVESTMENTS GM	7. 25	1, 867	1, 946	223, 304	2024/04/03	

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	7.25% RICE ENERGY INC	7.25	205	220	25,342	2023/05/01
	7.25% ZEBRA TECH CORP	7.25	214	231	26,516	2022/10/15
	7.375% FIRSTENERGY CORP	7.375	1,000	1,294	148,500	2031/11/15
	7.375% NUMERICABLE-SFR S	7.375	671	696	79,870	2026/05/01
	7.375% WESTERN DIGITAL C	7.375	500	552	63,388	2023/04/01
	7.45% BOMBARDIER INC	7.45	1,000	935	107,272	2034/05/01
	7.5% BOMBARDIER INC	7.5	250	250	28,754	2025/03/15
	7.5% CENTURYLINK INC	7.5	1,738	1,842	211,364	2024/04/01
	7.5% MICRON TECHNOLOGY I	7.5	232	257	29,545	2023/09/15
	7.5% ONEOK INC	7.5	750	873	100,245	2023/09/01
	7.5% ROYAL CARIBBEAN CR	7.5	1,500	1,800	206,514	2027/10/15
	7.5% SEMGROUP LP	7.5	1,000	1,040	119,390	2021/06/15
	7.5% TENET HEALTHCARE CO	7.5	153	164	18,826	2022/01/01
	7.5% VPII ESCROW CORP	7.5	1,000	873	100,187	2021/07/15
	7.5% WINDSTREAM CORP	7.5	1,000	957	109,853	2023/04/01
	7.625% AIRCASTLE LTD	7.625	2,177	2,467	283,096	2020/04/15
	7.625% DYNEGY INC	7.625	580	554	63,632	2024/11/01
	7.625% HUGHES SATELLITE	7.625	1,000	1,105	126,825	2021/06/15
	7.75% DISH DBS CORP	7.75	500	560	64,248	2026/07/01
	7.75% MGM RESORTS	7.75	2,000	2,335	267,894	2022/03/15
	7.75% PRECISION DRILLING	7.75	226	244	28,068	2023/12/15
	7.8% LIBERTY MUTUAL GROUP	7.8	500	571	65,611	2037/03/15
	7.875% CALPINE CORP	7.875	1,369	1,427	163,787	2023/01/15
	7.875% MOHEGAN TRIBAL GA	7.875	1,000	1,045	119,892	2024/10/15
	8% DYNEGY INC	8.0	1,402	1,356	155,623	2025/01/15
	8% EP ENER/EVEREST ACQ F	8.0	1,000	1,082	124,195	2024/11/29
	8% POST HOLDINGS INC	8.0	617	698	80,167	2025/07/15
	8% TECK RESOURCES LIMITE	8.0	100	110	12,663	2021/06/01
	8.25% INTL LEASE FIN	8.25	379	446	51,266	2020/12/15
	8.25% RAIN CII CARBON	8.25	500	506	58,082	2021/01/15
	8.5% FRONTIER COMMUNICAT	8.5	1,000	1,068	122,545	2020/04/15
	8.5% LIBERTY MEDIA CORP	8.5	1,000	1,110	127,350	2029/07/15
	8.5% TECK RESOURCES LIM	8.5	100	116	13,337	2024/06/01
	8.75% BEAZER HOMES USA	8.75	510	555	63,778	2022/03/15
	8.75% BOMBARDIER INC	8.75	750	808	92,716	2021/12/01
	8.875% TELESAT CANADA/TE	8.875	699	747	85,810	2024/11/15
	9% CONCORDIA INTERNATION	9.0	134	115	13,202	2022/04/01
	9% FRONTIER COMMUNICATIO	9.0	1,750	1,532	175,780	2031/08/15
	9% TRANSOCEAN INC	9.0	1,000	1,072	123,047	2023/07/15
	9.25% PRIME SECSRVC BRW/	9.25	521	567	65,154	2023/05/15
	9.875% ALTICE FINCO SA	9.875	662	700	80,366	2020/12/15
	9.875% WEATHERFORD INTL	9.875	500	543	62,384	2024/02/15
	AES CORP	3.93067	327	327	37,563	2019/06/01
	DCP MIDSTREAM LLC	5.85	1,000	910	104,404	2043/05/21
	SOUTHWESTERN ENERG	6.7	750	761	87,338	2025/01/23
合 計	—	—	—	—	30,760,925	—

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

(注2) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

投資信託財産の構成

(2017年1月30日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 30,760,925	% 93.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,139,301	6.5
投 資 信 託 財 産 総 額	32,900,226	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注2) 外貨建純資産 (32,179,854千円) の投資信託財産総額 (32,900,226千円) に対する比率は97.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2017年1月30日における邦貨換算レートは、1米ドル=114.73円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2017年1月30日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	32,900,226,171円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,092,183,645
公 社 債(評価額)	30,760,925,163
未 収 入 金	623,063,453
未 収 利 息	413,332,505
前 払 費 用	10,721,405
(B) 負 債	430,192,469
未 払 金	411,811,575
未 払 解 約 金	18,377,497
未 払 利 息	751
そ の 他 未 払 費 用	2,646
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	32,470,033,702
元 本	14,281,236,482
次 期 繰 越 損 益 金	18,188,797,220
(D) 受 益 権 総 口 数	14,281,236,482口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,736円

(注1) 元本の状況

期首元本額 17,523,801,670円

期中追加設定元本額 13,812,540円

期中一部解約元本額 3,256,377,728円

期末における元本の内訳

イーストスプリング米国高利回り社債オープン

14,281,236,482円

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

損益の状況

当期(自2016年1月30日 至2017年1月30日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,916,948,277円
受 取 利 息	1,909,474,426
そ の 他 収 益 金	7,647,348
支 払 利 息	△ 173,497
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,606,113,736
売 買 益	4,002,950,784
売 買 損	△ 2,396,837,048
(C) 信 託 報 酬 等	△ 6,096,007
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,516,966,006
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	18,001,155,685
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,781,738
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 3,343,106,209
(H) 計 (D+E+F+G)	18,188,797,220
次 期 繰 越 損 益 金(H)	18,188,797,220

(注1) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(C)信託報酬等は保管費用等です。

(注3) 損益の状況の中で(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引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、一部解約の際、元本から解約価額を差引いた差額分をいいます。

お知らせ

該当事項はありません。