



























TCWファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド

<1. 補足情報>

「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド (XJ シェアクラス)」は、「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

合同運用ファンドである「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の決算日（毎年9月30日）と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年3月11日現在における「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド」の補足情報を掲載しております。

■有価証券明細（評価額上位30銘柄）

(2016年3月11日現在)

銘柄		利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	米ドル	米ドル		
アメリカ	債券	USA 0% 18/08/2016	—	2,215,000	2,206,791.21	2016/8/18
		USA 0% 21/07/2016	—	1,105,000	1,103,634.00	2016/7/21
		CITIGROUP INC FRN 25/08/2036	1.1791	1,500,000	1,044,958.49	2036/8/25
		HOMER CITY GENERATION 8.734% 01/10/2026 PIK	8.734	1,450,000	919,369.48	2026/10/1
		USA 0% 05/05/2016	—	915,000	914,354.01	2016/5/5
		HCA INC 6.5% 15/02/20	6.5	690,000	763,067.17	2020/2/15
		DSLA 2007-ARI 2A1A DSLA MORTGAGE LOAN TRUST 19/04/47	0.57005	1,900,000	694,709.93	2047/4/19
		INTL LEASE FINANCE CORP 7.125% 01/09/18	7.125	575,000	627,169.27	2018/9/1
		CSFB 2005-11 1A1 6.50% 25/12/2035	6.5	3,000,000	616,254.67	2035/12/25
		ENERGY TRANSFER PARTNERS FRN 01/11/2066	3.6331	1,070,000	614,111.37	2066/11/1
		SINCLAIR TELE 6.125% 01/10/22	6.125	545,000	591,173.61	2022/10/1
		FIRST DATA CORP 5% 15/01/2024	5	555,000	574,964.58	2024/1/15
		DELTA AIR LINES 6.718% 02/01/2023	6.718	1,365,000	550,598.99	2023/1/2
		TENET HEALTHCARE CORP 6% 01/10/2020	6	495,000	542,850.00	2020/10/1
フランス アメリカ	債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.875% 01/04/2024	5.875	500,000	525,545.14	2024/4/1
		NUMERICABLE GROUP SA 4.875% 15/05/2019	4.875	500,000	504,260.42	2019/5/15
		HCA INC 4.75% 01/05/2023	4.75	480,000	496,633.33	2023/5/1
		AMER AIRLN 13-1 B PASSE T 5.625% 15/01/2021	5.625	550,000	479,528.03	2021/1/15
		HILTON W 5.625% 21	5.625	415,000	442,104.69	2021/10/15
		DYNEGY IN 5.875% 01/06/2023	5.875	520,000	434,869.79	2023/6/1
		JPM CHASE CAPITAL XXI LIB3 02/02/37	1.5626	580,000	406,956.66	2037/2/2
		CHURCHILL DOWNS 5.375% 15/12/21	5.375	385,000	406,787.26	2021/12/15
		CIT GROUP 6.625% 01/04/2018	6.625	375,000	405,729.17	2018/4/1
		SPRINT NEXTEL CORP 9% 15/11/2018	9	370,000	401,080.00	2018/11/15
		UNITED AIR 5.375% 15/08/2021	5.375	450,000	400,792.11	2021/8/15
		REYNOLDS GROUP ISS/REYNOLD 5.75% 15/10/20	5.75	375,000	396,401.04	2020/10/15
		FRESENIUS MED 5.75% 15/02/2021	5.75	355,000	387,536.74	2021/2/15
		DUPONT FABROS 5.785% 15/09/2021	5.785	350,000	378,427.78	2021/9/15
		TREEHOUSE FOODS INC 6% 15/02/2024	6	350,000	375,200.00	2024/2/15
		COTT BEVERAGES INC 6.75% 01/01/2020	6.75	350,000	373,843.75	2020/1/1

## Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド

### <2. 補足情報>

「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」の毎月分配クラス（ユーロ建）は、「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行なわれております。

合同運用ファンドである「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」の決算日（毎年6月30日）と当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2016年3月10日現在における「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」の補足情報を掲載しております。

### ■有価証券明細（評価額上位30銘柄）

（2016年3月10日現在）

銘柄		利率	額面金額/口数	評価額	償還年月日
フランス	投資証券	AMUNDI CASH INST SRI I C	320,399	70,521,393.44	-
		AMUNDI TRESO COURT TERME PART I C	1,602,762	30,229,254.60	-
イタリア	債券	ENEL SPA TF/TV 10/01/2074	11,828,000	12,817,385.61	2074/1/10
ドイツ		COMMERZBANK AG 7.75% 16/03/2021	9,500,000	12,042,508.83	2021/3/16
イタリア		INTESA SANPAOLO SPA 6.625% 13/09/2023	9,200,000	11,188,073.60	2023/9/13
ルクセンブルク		ALTICE SA 7.25% 15/05/2022	10,535,000	10,540,693.71	2022/5/15
		WIND ACQUISITION FIN SA 4% 15/07/2020	10,500,000	10,354,222.22	2020/7/15
イタリア		TELECOM ITALIA SPA 3.25% 16/01/2023	10,000,000	10,169,410.82	2023/1/16
ルクセンブルク		FIAT FINANCE & TRADE 6.75% 14/10/2019	8,577,000	9,979,855.27	2019/10/14
イタリア		TELECOM ITALIA 5.875% 19/05/23	7,000,000	9,975,969.49	2023/5/19
ルクセンブルク		WIND ACQUISITION FIN 7% 23/04/2021	10,088,000	9,953,213.11	2021/4/23
	投資証券	STRUCTURA GLOBAL MARCO MULTI CREDIT EUR SICAV	9,850	9,792,771.50	-
イギリス	債券	LYNX I CORP 6% 15/04/2021	7,749,000	9,538,684.34	2021/4/15
		ROYAL BANK SCOTLAND GRP PLC TF/TV 25/03/2024	9,460,000	9,514,038.78	2024/3/25
フランス		NOVALIS SAS 3% 30/04/2022	9,000,000	8,991,775.00	2022/4/30
オランダ		TELEFONICA EUROP BV TF/TV PERPETUAL	8,100,000	8,946,579.60	2049/12/31
イギリス		TESCO 6.125% 24/02/22 *GBP	6,620,000	8,880,632.47	2022/2/24
		LYNX II CORP 7% 15/04/23	6,500,000	8,808,719.62	2023/4/15
		BARCLAYS BANK PERP	5,000,000	8,665,829.26	2049/12/31
ルクセンブルク		HEIDELBERGCEMENT 7.50% 03/04/20	6,815,000	8,452,019.79	2020/4/3
日本		SOFTBANK GROUP CORP 4.75% 30/07/2025	8,400,000	8,309,513.33	2025/7/30
ルクセンブルク		FIAT FINANCE & TRADE 4.75% 15/07/2022	7,500,000	8,285,983.20	2022/7/15
		UNICREDITO TF/TV PERP	7,410,000	8,283,094.39	2049/12/31
イタリア		BANCO POPOLARE 3.5% 14/03/19	7,700,000	8,063,359.04	2019/3/14
		UNICREDIT 6.95% 31/10/2022	6,408,000	7,413,028.69	2022/10/31
		INTESA SANPAOLO SPA VAR 31/12/2049	6,500,000	7,299,785.57	2049/12/31
オランダ		UPC HOLDING BV 6.375% 15/09/2022	6,555,000	7,184,211.72	2022/9/15
ドイツ		THYSSENKRUPP AG 4% 27/08/2018	6,646,000	7,101,628.26	2018/8/27
ベルギー		KBC GROEP NV TF/TV PERPETUAL	7,160,000	7,073,949.00	2049/12/31
オランダ		ABN AMRO BANK NV PERP 31/12/2049	7,000,000	7,008,430.77	2049/12/31

## TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド

決算日 2015年9月30日

(計算期間：2014年10月1日～2015年9月30日)

「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド (XJ シェアクラス)」(円建)は、「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド」にて他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド」は毎年9月30日を決算日としており、当該運用報告書の作成時点において入手可能な2015年9月30日を基準日とするデータおよび年次報告書(監査済み)に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

開示情報につきましては、各クラス別のものがないため、「TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド」を掲載しております。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ルクセンブルク籍会社型投資信託(米ドル建)	
投資方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とし、インカムゲインとキャピタルゲインを合わせたトータルリターンの最大化を目指して運用を行います。原則として、為替ヘッジを行いません。	
収益分配方針	原則として、毎月分配します。	
ファンドの関係法人	投資顧問会社	TCWインベストメント・マネジメント・カンパニー
	副投資顧問会社	アムンディ・ジャパン株式会社
	保管銀行	ソシエテ・ジェネラル・バンク・アンド・トラスト
	管理事務代行会社	ソシエテ・ジェネラル・セキュリティーズ・サービシズ・ルクセンブルク
費用	運用報酬等	年率0.70%(XJ シェアクラス)
	申込手数料	ありません。

## ■費用の明細

項目	当期
	米ドル
(a) 運用報酬	268,864
(b) 管理費用等	104,690
(c) その他の費用	121,639
合計	495,193

## ■純資産計算書

2015年9月30日現在

項目	当期末
	米ドル
<b>資産合計</b>	57,857,651
有価証券	53,073,159
預金	2,164,090
有価証券売却未収入金	992,697
為替未収入金	542,328
未収利息	816,647
為替予約取引評価勘定	268,730
<b>負債合計</b>	3,019,982
未払解約金	124,393
未払配当金	417,718
有価証券買付未払金	1,896,519
為替未払金	542,429
未払運用報酬	18,103
未払投資顧問料	7,509
未払税	1,365
未払管理費用	7,034
為替予約取引評価勘定	4,912
<b>純資産</b>	54,837,669

(注) 各項目の金額の整数未満を四捨五入しているため、資産合計および負債合計並びに純資産が一致しない場合があります。



## ■有価証券明細

## (1) 公社債

(2015年9月30日現在)

銘柄		通貨	額面金額	米ドル 換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	米ドル 換算評価額
アイルランド	AERCAP IRELAND CAP LTD/A 4.25% 01/07/2020	USD	250,000	253,116.32	アメリカ	CCO HOLDINGS LLC / CAP CORP 5.125% 01/05/2023	USD	80,000	75,622.22
	AERCAP IRELAND CAP LTD/A 5% 01/10/2021	USD	150,000	157,104.17		CCO HOLDINGS LLC CORP 5.875% 01/05/2027	USD	180,000	172,070.63
	ARDAGH PKG FIN LIBOR3+3% 15/12/2019	USD	450,000	436,000.73		CEQUEL COM ESCROW 6.375% 15/09/2020	USD	135,000	127,933.59
アメリカ	ALLY FINANCIAL 4.125% 13/02/2022	USD	340,000	330,356.04	CHAPARRAL ENERGY 9.875% 01/10/2020	USD	190,000	72,029.13	
	ALLY FINANCIAL 7.5% 15/09/2020	USD	150,000	171,093.75	CHESAPEAKE ENERGY 5.75% 15/03/2023	USD	400,000	263,833.13	
	ALLY FINANCIAL INC 4.625% 19/05/2022	USD	110,000	110,201.28	CHURCHILL DOWNS INC 5.375% 15/12/2021	USD	170,000	175,215.10	
	ALLY FINANCIAL INC 4.75% 10/09/2018	USD	160,000	163,822.22	CIT GROUP 6.625% 01/04/2018	USD	375,000	409,852.86	
	ALTICE US FINANCE II CORP 7.75% 15/07/2025	USD	125,000	114,156.25	CIT GROUP INC 5.25% 15/03/18	USD	250,000	257,721.88	
	AMER AIRLN 13-1 B PASSE T 5.625% 15/01/2021	USD	1,000,000	906,060.51	CIT GROUP INC 5.5% 15/02/2019	USD	45,000	47,109.38	
	AMER ENERGY 8% 15/06/2020	USD	70,000	65,154.44	CITIGROUP INC FRN 25/08/2036	USD	1,500,000	1,137,179.40	
	AMERICAN AIRLINES 2013-2 A 4.95% 15/01/2023	USD	250,000	235,059.79	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE 6.50% 15/11/2022	USD	540,000	558,562.50	
	AMSI 2005-R2 M2 FRN 25/04/2035	USD	180,000	152,991.10	CNO FINANCIAL GROUP INC 4.5% 30/05/2020	USD	60,000	62,332.50	
	APPROACH RESOURCES 7% 15/06/2021	USD	85,000	53,160.42	COMMSCOPE INC 4.375% 15/06/2020	USD	70,000	70,489.76	
	ARCH COAL INC 7% 15/06/2019	USD	480,000	48,200.00	COMMUNITY HEALTH SYSTEMS 5.125% 01/08/2021	USD	405,000	416,501.72	
	ARCH COAL INC 8% 15/01/2019	USD	205,000	26,991.67	CONSTELLATION BRANDS 6% 01/05/2022	USD	70,000	78,388.33	
	AUDATEX NORTH 6% 15/06/2021	USD	187,000	191,345.88	CORRECTIONS CORP OF AMER 5% 15/10/2022	USD	60,000	60,191.67	
	BALL CORP 5% 15/03/2022	USD	195,000	195,893.75	COTT BEVERAGES INC 6.75% 01/01/2020	USD	350,000	366,778.13	
	BARRY PLASTICS 5.5% 15/05/2022	USD	70,000	69,606.25	CROWN CASTLE INTL CORP 4.875% 15/04/2022	USD	110,000	117,077.81	
	BERRY PLASTICS CORP 5.125% 15/07/2023	USD	225,000	216,027.34	CSC HOLDING LLC 6.75% 15/11/2021	USD	380,000	350,668.75	
	BERRY PLASTICS ESCROW 6% 15/10/2022	USD	88,000	87,780.00	CSC HOLDINGS LLC 5.25% 01/06/2024	USD	440,000	355,337.92	
	BOARDWALK PIPELINES LP 4.95% 15/12/2024	USD	200,000	188,421.30	CSFB 2005-11 1A1 6.50% 25/12/2035	USD	3,000,000	666,500.48	
	BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/2023	USD	170,000	177,588.02	DAVITA HEALTHCARE 5.125% 15/07/2024	USD	465,000	462,989.84	
	BWAY HOLDING CO TL B 1L FRN 14/08/2020	USD	237,818	238,680.81	DAVITA HEALTHCARE PARTNE 5% 01/05/2025	USD	275,000	271,600.69	
	BWAY HOLDING CO TL B 1L FRN 14/08/2020	USD	10,300	10,315.31	DELTA AIR LINES 6.718% 02/01/2023	USD	1,615,000	696,230.08	
	CABLE ONE INC 5.75% 15/06/2022	USD	170,000	170,756.74	DISH DBS CORP 5.875% 15/07/2022	USD	135,000	121,802.34	
	CALPINE CORP 6% 15/01/2022	USD	425,000	451,031.25	DISH DBS CORP 5.875% 15/11/2024	USD	100,000	87,390.63	
CARMIKE CINEMAS 6% 15/06/2023	USD	65,000	66,522.08						
CCO HOLDING 6.50% 30/04/2021	USD	540,000	558,337.50						

## TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド

銘柄		通貨	額面金額	米ドル 換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	米ドル 換算評価額	
アメリカ	DISH DBS CORP 6.75% 01/06/2021	USD	585,000	577,940.51	アメリカ	FRONTIER COMMUNICATIONS 8.875% 15/09/2020	USD	289,000	284,298.73
	DOLLAR TREE INC TL-B2 09/03/2022	USD	225,000	225,994.06		HARVEY GULF INTERNATIONAL M TL B 1L 5.5% 14/06/20	USD	356,250	233,845.73
	DPL PLC 6.5% 15/10/2016	USD	62,000	65,087.08		HCA INC 4.75% 01/05/2023	USD	480,000	487,036.67
	DS SERVICES OF AMERICA I 10% 01/09/2021	USD	200,000	232,361.11		HCA INC 5.25% 15/04/2025	USD	50,000	52,390.63
	DSL A 2007-ARI 2A1A DSLA MORTGAGE LOAN TRUST 19/04/47	USD	1,900,000	762,331.34		HCA INC 6.5% 15/02/20	USD	690,000	759,431.25
	DUPONT FABROS 5.785% 15/09/2021	USD	350,000	360,481.77		HEALTHSOUTH 5.75% 01/11/24	USD	170,000	172,345.76
	DYNEGY INC 6.75% 01/11/2019	USD	310,000	321,760.63		HILL - ROM HOLDINGS INC 01/09/2023	USD	90,000	91,204.38
	EL PASO ENERGY 7.8% 01/08/31	USD	340,000	352,808.25		HILTON W 5.625% 21	USD	420,000	446,578.13
	ENERGIZER SPINCO INC 5.5% 15/06/2025	USD	265,000	262,530.35		HOLOGIC INC 5.25% 15/07/2022	USD	135,000	138,588.75
	ENERGY TRANSFER EQUITY 5.5% 01/06/2027	USD	400,000	341,866.53		HOMER CITY GENERATION LP 8.137% 01/10/2019	USD	440,000	404,479.71
	ENERGY TRANSFER PARTNERS FRN 01/11/2066	USD	770,000	574,057.59		IHS INC 5% 01/11/2022	USD	250,000	246,423.61
	ENSEMBLE S MERGER SUB IN 9% 30/09/2023	USD	110,000	106,975.00		INTL LEASE 6.25% 15/05/2019	USD	150,000	163,640.63
	ENTEGRA TC LLC FRN 03/10/2017	USD	390,351	410,519.70		INTL LEASE FINANCE CORP 7.125% 01/09/18	USD	375,000	415,835.94
	ENTEGRA TC PIK THIRD 3L 02/10/20	USD	392,546	396,717.12		ISLE OF CAPRI CASINOS 5.875% 15/03/2021	USD	120,000	125,093.75
	EP ENERGY 9.375% 01/05/2020	USD	105,000	94,111.72		JPM CHASE CAPITAL XXI LIB3 02/02/37	USD	580,000	455,018.15
	ESH HOSPITALITY INC 5.25% 01/05/2025	USD	200,000	201,437.50		KLX INC 5.875% 01/12/2022	USD	220,000	218,222.43
	FAMILY TREE ESCROW LLC 5.75% 01/03/2023	USD	100,000	104,713.19		LEAR CORP 5.25% 15/01/2025	USD	190,000	189,228.13
	FANNIE DISCOUNT NOTE ZCP 05/01/2016	USD	330,000	329,894.40		LEVEL 3 FINANCING INC 5.125% 01/05/2023	USD	500,000	473,314.24
	FED HOME LN DISCOUNT NOTE ZCP 05/10/2015	USD	310,000	309,997.59		LIFEPOINT HOSPITALS INC 5.5% 01/12/2021	USD	200,000	205,836.11
	FED HOME LN DISCOUNT NT ZCP 10/07/2015	USD	310,000	309,995.61		MARKWEST ENERGY PART FIN 4.875% 01/12/2024	USD	345,000	322,952.76
	FIRST DATA CORP 6.75% 01/11/20	USD	320,000	344,140.00		MEDIA GENERAL FINAN SUB 5.875% 15/11/2022	USD	250,000	254,257.81
	FIRST DATA CORPORATION 5.375% 15/08/2023	USD	435,000	434,648.08		METROPCS 6.625% 1120	USD	355,000	370,268.10
	FREDDIE MAC DISCOUNT NT ZCP 14/01/2016	USD	315,000	314,889.75		MGM RESORTS 8.625% 01/02/2019	USD	80,000	89,330.83
	FREESCALE SEMICONDUCTOR 5% 15/05/2021	USD	170,000	175,737.50		MIDCONTINENT COMM AND FIN 6.875% 15/08/2023	USD	85,000	85,109.20
	FRESENIUS 5.625% 31/07/2019	USD	50,000	53,968.75		MIRANT AMERICAS 8.5% 01/10/2021	USD	260,000	234,588.61
	FRESENIUS MED 5.75% 15/02/2021	USD	330,000	359,596.88		MIRANT TRUST 10.06% 30/12/28	USD	135,000	141,085.38
	FRONTIER COMMUNICATION 11% 15/09/2025	USD	174,000	168,506.43		MOMENTIVE PERFORMANCE 3.88% 24/10/21	USD	250,000	200,695.83
	FRONTIER COMMUNICATIONS 1.5% 15/09/2022	USD	290,000	283,897.91		MOXIE LIBERTY 29/08/20	USD	235,000	225,600.00
						MSCI INC 5.25% 15/11/2024	USD	110,000	113,540.63
						MSCI INC 5.75% 15/08/2025	USD	95,000	97,316.29
						NATIONWIDE MUTUAL TF/TV 12/15/24	USD	875,000	839,142.21
						NAVIENT CORP 5% 26/10/2020	USD	125,000	107,773.61
						NEP BROADCASTING LLC 22/07/20	USD	64,022	64,128.74

TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド

銘柄		通貨	額面金額	米ドル 換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	米ドル 換算評価額
アメリカ	NEWFIELD EXPLORATION CO 5.625% 01/07/2024	USD	20,000	19,340.63	アメリカ	ROSE ROCK MIDSTREAM FIN 5.625% 15/07/2022	USD	285,000	255,564.84
	NEXSTAR BROADCASTING INC 6.125% 15/02/2022	USD	75,000	74,824.22		RSI HOME PRODUCTS INC 6.5% 15/03/2023	USD	220,000	221,695.83
	NFR ENERGY 2ND 31/12/18	USD	250,000	54,218.75		SABINE PASS LIQUEFACTION 6.25% 15/03/2022	USD	160,000	149,616.67
	NGPL PIPECO 7.119% 15/12/2017	USD	345,000	336,638.49		SABINE PASS LIQUEFACTION LLC TV 01/02/2021	USD	200,000	188,343.75
	ORBITAL ATK INC 5.5% 01/10/2023	USD	225,000	227,003.13		SARM 2005-15 1A1 FRN 25/07/2035	USD	450,000	105,057.94
	OUTFRONT MEDIA CAP LLC C 5.875% 15/03/2025	USD	130,000	132,918.23		SBA COMMUNICATIONS CORP 4.875% 15/07/2022	USD	125,000	123,925.78
	OWENS-BROCKWAY 5% 15/01/2022	USD	120,000	117,200.00		SBA COMMUNICATIONS CORP 5.625% 01/10/2019	USD	125,000	132,089.84
	PEABODY ENERGY 4.75% 15/12/41 CV	USD	1,255,000	155,436.98		SEALED AIR CORP 5.125% 01/12/2024	USD	45,000	45,087.34
	PEABODY ENERGY 6% 15/11/2018	USD	50,000	14,375.00		SEVENTY SEVEN ENERGY INC 6.5% 15/07/2022	USD	55,000	23,569.79
	PEACOCK ENGINEERING CO TL- 1L 30/06/2022	USD	300,000	300,468.00		SHEA HOMES LP/FNDG CP 6.125% 01/04/2025	USD	90,000	94,663.44
	PINNACLE ENTERTAINMENT INC. 6.375 01/08/2015	USD	110,000	118,524.77		SINCLAIR TELE 6.125% 01/10/22	USD	545,000	560,916.65
	PLATFORM SPECIALTY PROD 6.5% 01/02/2022	USD	250,000	218,913.19		SIRIUS XM RADIO 4.25% 15/05/20	USD	80,000	79,675.00
	POWER BUYER LLC TL 2L FRN 06/11/2020	USD	250,000	240,000.00		SOUTHERN STAR 5.125% 15/07/2022	USD	225,000	219,527.34
	PPL ENERGY SUPPLY LLC 6.5% 01/06/2025	USD	125,000	112,331.60		SPECTRUM BRANDS INC 5.75% 15/07/2025	USD	140,000	146,056.94
	PRWIRELESS IN TL B 1L 15/05/2020	USD	0	0.49		SPECTRUM BRANDS INC 6.625% 15/11/2022	USD	120,000	130,481.25
	QEP RESOURCES INC 6.875% 01/03/2021	USD	150,000	139,580.73		SPRINT CORP 7.875% 15/09/2023	USD	314,000	255,370.31
	QUINTILES TRANSNATIONAL 4.875% 15/05/2023	USD	240,000	244,485.00		SPRINT NEXTEL 6% 15/11/2022	USD	100,000	78,033.33
	QWEST CORP 6.75% 01/12/21	USD	110,000	120,699.37		SPRINT NEXTEL CORP 9.25% 215/04/202	USD	360,000	369,811.11
	QWEST CORP 7.25% 15/09/2025	USD	150,000	168,099.58		SPRINT NEXTEL CORP 9% 15/11/2018	USD	530,000	571,737.50
	RALI 2005-QA7 A1 VAR 25/07/2035	USD	890,000	146,350.37		SS&C TECH HOLDINGS INC 5.875% 15/07/2023	USD	335,000	346,182.95
	RANGE RESOURCES CORP 4.875% 15/05/2025	USD	210,000	191,817.50		SUMMIT MID 7.5% 01/07/2021	USD	120,000	118,025.00
	REGENCY ENERGY PARTNER 5.875% 01/03/2022	USD	200,000	205,945.21		SUNOCO LP FINANCE CORP 5.5% 01/08/2020	USD	60,000	60,041.67
	REGIONALCARE HOSPITAL PARTN 24/03/19	USD	246,875	244,920.98		SUNOCO LP FINANCE CORP 6.375% 01/04/2023	USD	155,000	157,588.18
	REYNOLDS GROUP ISS/REYNOLD 5.75% 15/10/20	USD	850,000	884,088.54		SVHE 2006-EQ1 A4 TV 25/10/2036	USD	425,000	298,517.30
	RFMSI 2007-SA2 1A RESIDENTIAL FUNDING MTG 25/04/37	USD	1,000,000	119,355.49		SYNAGRO INFRASTRUCTRE 19/08/20	USD	269,348	247,800.93
	RJS POWER HOLDINGS LLC VAR 15/07/2019	USD	295,000	274,979.95		SYNAGRO INFRASTRUCTRE 19/08/20	USD	16,834	15,487.56
ROCKIE EXPRESS 6% 15/01/19	USD	5,000	5,012.50	SYNAGRO INFRASTRUCTRE 19/08/20	USD	50,502	46,462.68		
ROCKIES EXPRESS 5.625% 15/04/2020	USD	240,000	238,987.50	TEMPUR SEALY INTL INC 5.625% 15/10/2023	USD	130,000	131,096.88		
ROCKIES EXPRESS PIPELINE 6.875% 15/04/2040	USD	120,000	116,281.25						

TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド

銘柄		通貨	額面金額	米ドル 換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	米ドル 換算評価額	
アメリカ	TENET HEALTHCARE CORP 4.50% 01/04/2021	USD	135,000	137,008.13	イギリス	INMARSAT FINANCE 4.875% 15/05/2022	USD	230,000	227,592.19
	TENET HEALTHCARE CORP 6% 01/10/2020	USD	730,000	792,261.67			LYNX I CORP 5.375% 15/04/2021	USD	450,000
	TENET HEALTHCARE CORP FRN 15/06/2020	USD	210,000	209,154.51	オランダ	VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.25% 15/01/2026	USD	200,000	189,750.00
	TENNECO INC 5.375% 15/12/2024	USD	215,000	225,089.32			FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 4.5% 15/04/2020	USD	200,000
	T-MOBILE USA 6.633% 28/04/2021	USD	150,000	152,463.53	カナダ	MEG ENERGY 7% 31/03/2024	USD	280,000	224,000.00
	T-MOBILE USA INC 6.836% 28/04/2023	USD	250,000	251,068.28			MEG ENERGY CORP 6.5% 15/03/2021	USD	115,000
	TRANSDIGM INC 5.5% 15/10/2020	USD	225,000	221,250.00	ケイマン諸島	VALEANT PHARMACEUTICALS 5.5% 01/03/2023	USD	455,000	435,403.40
	TRANSDIGM INC 6.5% 15/05/2025	USD	160,000	154,928.89			VRX ESCROW CORP 5.875% 15/05/2023	USD	662,000
	UNIVISION COMMUNICATIONS 5.125% 15/02/2025	USD	220,000	207,934.38	日本	VRX ESCROW CORP 6.125% 15/04/2025	USD	200,000	197,757.71
	UNIVISION COMMUNICATIONS 5.125% 15/05/2023	USD	245,000	238,683.59			NEPTUNE FINCO CORP 10.875% 15/10/2025	USD	935,000
	US AIRWAYS 2012-2B 6.75% 03/06/2021	USD	200,000	195,592.80	TRANSOCEAN INC VAR 15/10/2022	USD	113,000	72,569.54	
	USA 0% 07/01/2016	USD	955,000	954,997.14	パミューダ	SOFTBANK 4.5% 15/04/2020	USD	200,000	200,125.00
	UTILITY SERVICES ASSOCIATES 16/10/20	USD	261,116	261,443.18	フランス	INTELSAT JACKSON 7.25% 15/10/2020	USD	500,000	480,364.58
	UUNITED RENTALS INC 4.625% 15/07/2023	USD	100,000	98,588.54			NCLH CORP LTD 5.25% 15/11/2019	USD	155,000
	WALTER ENERGY INC 8.5% 15/04/2021 DEFAULTED	USD	290,000	2,175.00	マージナル諸島	NUMERICABLE GROUP SA 4.875% 15/05/2019	USD	400,000	388,437.50
	WALTER ENERGY INC 9.5% 15/10/19 DEFAULTED	USD	400,000	143,000.00	ルクセンブルク	DRILLSHIPS FIN 03/21	USD	66,649	40,672.85
	WALTER ENERGY INC VAR 01/04/2020 DEFAULTED	USD	509,850	7,647.75	ALTICE FINANCING SA 6.625% 15/02/2023	USD	200,000	202,186.11	
	WELLCARE HEALTH 5.75% 15/11/2020	USD	247,000	263,132.19		ALTICE SA 7.625% 15/02/2025	USD	120,000	112,498.33
	WHITING PETROLEUM CORP 5% 15/03/2019	USD	470,000	412,229.17	ALTICE US FINANCING SA 7.75% 15/07/2025	USD	245,000	222,521.25	
	WINDSTREAM 6.375% 01/08/2023	USD	90,000	66,131.81	COVERIS HOLDINGS SA 7.875% 01/11/2019	USD	200,000	197,018.75	
WPX ENERGY 5.25% 15/09/2024	USD	160,000	129,950.00	INTELSAT 7.5% 01/04/2019	USD	150,000	146,594.79		
WR GRACE & CO 5.125% 01/10/2021	USD	80,000	81,238.61	MALLINCKRODT FIN SB 5.625% 15/10/2023	USD	135,000	123,651.57		
ZF NA CAPITAL 4.5% 29/04/2022	USD	305,000	296,269.38	NIELSEN CO LUX 5.5% 01/10/2021	USD	325,000	335,512.85		
ZFS FINANCE USA TRUST TF/TV 15/12/2065	USD	200,000	205,412.50						

(注1) 額面金額の小数点以下は切捨てです。

(注2) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)

(2) 株式

(2015年9月30日現在)

銘柄		株数	通貨	米ドル換算評価額
アメリカ	ENTEGR EQUITY	1,175	USD	278,960.86
	MACH GEN GP LLC 15	12,557	USD	694,822.76

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。

USD (米ドル)

## Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド

決算日 2015年6月30日

(計算期間：2014年7月1日～2015年6月30日)

「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」の毎月分配クラス（ユーロ建）は、「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」にて既存の他のクラスと合わせた合同運用が行われています。

「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」は毎年6月30日を決算日としており、当該運用報告書の作成時点において入手可能な2015年6月30日を基準日とするデータおよび年次報告書（監査済み）に基づき、委託会社が抜粋・翻訳・作成したものです。

開示情報につきましては、各クラス別のものがないため、「Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド」を掲載しております。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ルクセンブルク籍会社型投資信託（ユーロ建）	
投資方針	主として欧州の高利回り社債に投資することにより、高水準の金利収入とキャピタル・ゲインの獲得を目指し、収益性を重視した運用を行います。	
収益分配方針	原則として、毎月分配します。	
ファンドの関係法人	運用会社	アムンディ アセットマネジメント（※）
	管理会社	アムンディ・ルクセンブルク・エス・エー
	保管銀行	CACEIS・バンク・ルクセンブルク・エス・エー
費用	運用報酬等	年率0.60%（毎月分配クラス）
	申込手数料	ありません。

（※）2015年11月12日付で「アムンディ」から「アムンディ アセットマネジメント」へ社名変更しました。

## ■費用の明細

項目	当期
	ユーロ
(a) 運用報酬	6,566,043
(b) 成功報酬	7,744
(c) 管理費用等	2,404,815
(d) その他の費用	1,159,489
合計	10,138,091

## ■純資産計算書

2015年6月30日現在

項目	当期末
	ユーロ
<b>資産合計</b>	<b>1,378,449,987</b>
有価証券	1,312,909,282
預金	9,898,123
未収利息	23,244,561
有価証券売却未収入金	1,067,399
未収追加設定金	26,342,146
スワップ取引評価勘定	4,988,476
<b>負債合計</b>	<b>12,973,976</b>
借入金	3,170,117
未払解約金	5,467,701
為替予約取引評価勘定	867,926
未払運用報酬	2,171,140
その他の負債	1,297,092
<b>純資産</b>	<b>1,365,476,011</b>

(注) 各項目の金額の整数未満を四捨五入しているため、資産合計および負債合計並びに純資産が一致しない場合があります。

## ■有価証券明細

## (1) 公社債

(2015年6月30日現在)

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	
アイルランド	ARDAGH PACK 9.25% 15/10/2020	EUR	1,341,000	1,447,302.19	イギリス	BOPARAN FIN 5.25% 15/07/19	GBP	1,650,000	2,235,139.22	
	ARDAGH PKG FIN/HLDGS 4.25% 15/01/2022	EUR	6,420,000	6,497,034.65		BOPARAN FINANCE 5.2% 15/07/2021	GBP	800,000	1,048,344.98	
	EIRCOM FINANCE 9.25% 15/05/2020	EUR	1,600,000	1,754,500.00		BOPARAN FINANCE PLC 4.375% 15/07/2021	EUR	2,110,000	1,963,699.34	
	SMURFIT KAPPA ACQUISITIO 2.75% 01/02/2025	EUR	1,300,000	1,230,431.94		ECO BAT FINANCE PLC 7.75% 15/02/2017	EUR	200,000	200,612.50	
	SMURFIT KAPPA ACQUISITION 3.25% 01/06/2021	EUR	2,750,000	2,809,037.15		GKN HOLDINGS PLC 5.375% 19/09/2022	GBP	570,000	913,231.45	
	SMURFIT KAPPA ACQUISITION 4.125% 30/01/2020	EUR	1,200,000	1,301,025.00		HOUSE OF FRASER 8.875% 15/08/2018	GBP	1,863,000	2,830,543.12	
	アメリカ	CEMEX FINANCE LLC 5.25% 01/04/2021	EUR	3,689,000		3,829,658.50	HSBC HOLDINGS TF/TV PERPETUAL	EUR	3,840,000	3,904,981.57
		FRESENIUS US FINANCE II INC 4.25% 01/02/2021	USD	850,000		784,880.85	INEOS FINANCE PLC 4% 01/05/2023	EUR	4,550,000	4,350,669.56
		HUNTSMAN INTERNATIONAL LLC 4.25% 01/04/2025	EUR	750,000		700,968.75	INTERNATIONAL GAME TECH 4.125% 15/02/2020	EUR	5,400,000	5,430,768.75
		HUNTSMAN INTERNATIONAL LLC 5.125% 15/04/2021	EUR	1,800,000		1,873,218.75	INTERNATIONAL GAME TECH 4.75% 15/02/2023	EUR	5,870,000	5,761,970.80
IMX HEALTH INC 4.125% 01/04/2023		EUR	3,800,000	3,709,987.50	INTERNATIONAL PERSONAL FINANCE 5.75% 07/04/2021	EUR	2,957,000	2,998,979.70		
IRON MOUNTAIN 6.125% 15/09/22		GBP	3,870,000	5,705,304.74	JAGUAR LAND ROVER AUTOMO 3.875% 01/03/2023	GBP	2,800,000	3,838,157.95		
JARDEN CORP 3.75% 01/10/2021		EUR	4,000,000	4,176,885.25	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE 5% 15/02/2022	GBP	3,500,000	5,170,633.07		
LYNX I CORP 6% 15/04/2021		GBP	7,849,000	10,494,692.99	LLOYDS BANKING TF/TV PERPETUAL	GBP	2,006,000	2,853,804.62		
LYNX II CORP 7% 15/04/23		GBP	5,000,000	7,619,333.29	LLYODS BANKING GROUP TF/TV PERPETUAL	EUR	1,665,000	1,723,074.70		
MPT OPER PARTNERSP 5.75% 01/10/2020		EUR	1,005,000	1,089,636.35	MERLIN ENTERTAINMENTS PL 2.75% 15/03/2022	EUR	1,700,000	1,629,985.97		
PSPC ESCROW CORP 6% 01/02/2023	EUR	1,650,000	1,707,860.00	MOY PARK BONDCO PLC 6.25% 29/05/2021	GBP	3,040,000	4,421,428.63			
US COAT ACQ / FLASH DUTCH 5.75% 01/02/21	EUR	750,000	803,473.96	NEW LOOK SECURED ISSUER 6.5% 01/07/2022	GBP	6,130,000	8,402,485.47			
VWR FUNDING INC 4.625% 15/04/2022	EUR	4,700,000	4,581,112.85	NEW LOOK SENIOR ISSUER PLC 8% 01/07/2023	GBP	700,000	964,688.16			
ZF NA CAPITAL 2.25% 26/04/2019	EUR	3,000,000	2,989,303.28	OLD MUTUAL TF/TV PERP EUR	EUR	1,725,000	1,786,707.98			
ZF NA CAPITAL 2.75% 27/04/2023	EUR	3,600,000	3,415,711.48	OLD MUTUAL TF/TV PERPETUAL	GBP	886,000	1,276,083.05			
イギリス	ANGLIAN WATER OSPREY FIN 7% 31/01/2018	GBP	1,100,000	1,721,566.57	OTE PLC 7.875% 07/02/2018	EUR	4,599,000	4,387,944.65		
	ANGLIAN WATER OSPREY FINANCE 5% 30/04/2023	GBP	600,000	844,436.30	PIZZAEXPRESS FINANCING 2 6.625% 01/08/2021	GBP	1,560,000	2,333,268.83		
	ARROW GLOBAL FINANCE 7.875% 01/03/2020	GBP	2,411,000	3,661,954.04	PRIORY GROUPE LTD 7% 15/02/2018	GBP	800,000	730,823.90		
	BAKKAVOR FINANCE 2 PLC 8.25% 15/02/2018	GBP	1,950,000	1,704,454.50	R&R ICE CREAM PLC 5.5% 15/05/2020	GBP	4,427,000	6,393,357.87		
	BARCLAYS PLC TF/TV PERPETUAL	EUR	6,790,000	6,804,994.58	ROYAL BANK OF SCOTLAND TF/TV 22/09/2021	EUR	4,500,000	4,762,449.74		

## Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	
イギリス	ROYAL BANK SCOTLAND GRP PLC TF/TV 25/03/2024	EUR	7,660,000	7,879,744.26	イタリア	INTESASANPAOLOSPATVPERP	EUR	4,500,000	5,049,893.85
	ROYAL BANK TF/TV PERPETUAL	EUR	3,850,000	4,323,708.94		INTESASANPAOLOSPATVPERP	EUR	1,150,000	1,229,277.92
	TESCO 6.125% 24/02/22 *GBP	GBP	6,620,000	10,310,425.37		RHINO BONDCO SPA 7.25% 15/11/2020	EUR	3,170,000	3,403,827.13
	TESCO CORP TREASURY 2.5% 01/07/2024	EUR	1,700,000	1,637,677.16		SALINI COSTRUTTORI 6.125% 01/08/2018	EUR	1,200,000	1,369,944.16
	TESCO CORP TREASURY SERV 1.375% 01/07/2019	EUR	1,600,000	1,568,592.53		SNAI SPA 7.625% 15/06/2018	EUR	3,286,000	3,386,804.90
	TESCO CORP TREASURY SERV 2.125% 12/11/2020	EUR	920,000	915,412.34		TELE ITA 5.375% 29/01/19 *EUR	EUR	1,100,000	1,252,151.52
	TESCO PLC 5% 24/0303/2023	GBP	1,400,000	2,016,920.84		TELE ITA 6.375% 24/06/19	GBP	550,000	841,784.60
	THOMAS COOK 7.75% 15/06/2020	EUR	6,948,000	7,373,392.46		TELECOM ITALIA 5.875% 19/05/23	GBP	4,800,000	7,171,223.74
	THOMAS COOK FINANCE PLC 6.75% 15/06/2021	EUR	500,000	521,406.25		TELECOM ITALIA SPA 4% 21/01/2020	EUR	6,034,000	6,554,240.90
	TWINKLE PIZZA PLC 6.625% 01/08/2021	GBP	800,000	1,196,548.11		UNICREDIT 6.95% 31/10/2022	EUR	4,408,000	5,295,200.15
	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 4.5% 15/01/2025	EUR	870,000	880,005.00		UNICREDIT SPA 6.125% 19/04/2021	EUR	2,650,000	2,953,520.88
	VIRGIN MEDIA SEC 5.5% 15/01/2025	GBP	800,000	1,045,073.05		UNICREDIT SPA TF/TV PERPETUEL	EUR	5,000,000	4,959,617.39
	VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.125% 15/01/2025	GBP	2,650,000	3,765,393.55		UNICREDIT SPA TF-2020 / TV 28/10/2025	EUR	5,900,000	6,557,660.55
	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE 6.25% 28/03/2029	GBP	1,420,000	2,129,440.44		UNIPOLSAI TF/TV PERP	EUR	2,400,000	2,350,829.39
	VOUGEOT BIDCO 7.875% 15/07/2020	GBP	1,310,000	2,020,396.94		SAPPI PAPIER HOLDING GMBH 3.375% 01/04/2022	EUR	5,680,000	5,444,812.50
	WILLIAM HILL PLC 4.25% 05/06/20	GBP	5,348,000	7,495,665.23		WIENERBERGER 4% 17/04/20	EUR	1,683,000	1,803,488.38
	ASSICURAZI TF/TV PERP	GBP	3,600,000	5,259,170.24		オーストリア	EUR	3,101,000	3,169,920.36
	ASTALDI SPA 7.125% 01/12/20	EUR	5,039,000	5,320,476.44		オランダ	EUR	4,548,000	4,811,109.38
	BANCO POPOLARE 3.5% 14/03/19	EUR	10,050,000	10,427,959.08		CABLE COMM SYST NV 7.5% 01/11/2020	EUR	2,900,000	2,845,081.25
	BUZZI UNICEM 6.25% 28/09/2018	EUR	3,448,000	4,024,181.63		DARLING GLOBAL FINANCE 4.75% 30/05/2022	EUR	1,700,000	1,732,894.77
CERVED TECHNOLOGIES 6.375% 15/01/2020	EUR	932,000	998,841.88	DEUTSCHE ANN FIN BV FRN PERP	EUR	1,100,000	1,152,453.19		
CERVED TECHNOLOGIES 8% 15/01/21	EUR	500,000	554,583.33	DEUTSCHE ANNINGTON FINANCE BV 4.625% 08/04/2074	EUR	1,100,000	1,152,453.19		
ENEL SPA TF/TV 10/01/2074	EUR	11,228,000	12,579,391.47	EDP FINANCE 8.625% 04/01/2024	GBP	1,100,000	2,119,408.40		
ENEL SPA TF/TV 15/01/2075	EUR	1,000,000	1,067,739.73	EDP FINANCE BV 5.25% 14/01/21	USD	1,850,000	1,789,343.40		
ENEL TF/TV 15/09/2076	GBP	2,600,000	3,985,873.85	FRESENIUS 4% 01/02/2024	EUR	1,000,000	1,122,761.56		
FINMECCANI 4.875% 24/03/2025 *EUR	EUR	800,000	860,685.82	FRESENIUS FINANCE 3% 01/02/21	EUR	2,357,000	2,484,081.58		
INTESA SANPAOLO 5.15% 07/20	EUR	500,000	568,363.73	FRESENIUS FINANCE 4.25% 15/04/2019	EUR	3,519,000	3,883,336.73		
INTESA SANPAOLO SPA VAR PERPETUAL	EUR	5,150,000	6,357,304.62	GAS NATURAL FENOSA TF-2022 / TV PERPETUEL	EUR	6,200,000	6,321,417.70		
INTESASANPAOLOSPA6.625%13/09/2023	EUR	8,200,000	10,173,231.49	GENER FIN TF/TV PERP	EUR	1,150,000	1,197,514.05		
				GENERALI FINANCE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	11,000,000	10,795,673.19		



銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	
オランダ	GRP ISOLUX CORSAN 6.625% 15/04/2021	EUR	4,131,000	3,361,816.41	オランダ	SCHAEFFLER FINANCE BV 3.5% 15/05/2022	EUR	2,603,000	2,620,895.63	
	GRUPO ANTOLIN DUTCH BV 4.75% 01/04/2021	EUR	4,600,000	4,723,018.06		SCHAEFFLER FINANCE BV 4.25% 15/05/2018	EUR	2,460,000	2,519,193.75	
	GRUPO ANTOLIN DUTCH BV 5.125% 30/06/2022	EUR	1,140,000	1,159,170.84		SCHAEFFLER HOLDING FINANCE BV 6.875% 15/08/2018	EUR	2,150,000	2,283,044.69	
	HERTZ HOLDGS NETHERLANDS 4.375% 15/01/19	EUR	3,120,000	3,177,882.50		SELECTA GROUP BV 6.5% 15/06/2020	EUR	500,000	482,604.17	
	ING GROEP NV 6% PERP 31/12/2049	USD	1,750,000	1,572,822.05		SM MTH AUTO GRP 4.125% 15/07/2021	EUR	5,640,000	5,797,402.53	
	KONINKLIJKE KPN VAR PERPETUAL	EUR	6,110,000	6,782,079.08		TELEFONICA EUROP BV TF/TV PERPETUAL	EUR	9,500,000	11,538,107.88	
	LGE HOLDCO VI 7.125% 15/05/2024	EUR	6,625,000	7,418,385.16		TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	4,600,000	5,269,315.75	
	OI EUROPEAN GP 6.75% 15/09/2020	EUR	4,530,000	5,353,893.75		TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	GBP	3,600,000	5,539,487.61	
	OI EUROPEAN GROUP BV 4.875% 31/03/2021	EUR	1,000,000	1,071,187.50		TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	600,000	631,515.42	
	PETROBAS 4.875% 07/03/2018	EUR	7,300,000	7,472,284.55		THYSSENKR 8.5% 25/02/16 *EUR	EUR	1,000,000	1,079,189.59	
	PETROBRAS 3.75% 14/01/2021	EUR	2,300,000	2,168,685.03		UPC HOLDING BV 6.375% 15/09/2022	EUR	6,155,000	6,715,682.03	
	PETROBRAS GBL FINANCE 2.75% 15/01/2018	EUR	4,700,000	4,570,791.59		UPC HOLDING BV 6.75% 15/03/23	EUR	2,762,000	3,051,146.88	
	PETROBRAS GLOBAL FINANCE 3.25% 01/04/2019	EUR	7,416,000	7,095,071.14		ZIGGI SECURED FINANCE BV 3.75% 15/01/2025	EUR	3,950,000	3,896,510.42	
	PETROBRAS INTL 5.875% 07/03/2022	EUR	1,000,000	1,029,547.70		ZIGGO BOND FINANCE BV 4.625% 15/01/2025	EUR	700,000	706,579.51	
	PHOENIX PIB DUTCH FINANCE 3.625% 30/07/21	EUR	1,900,000	2,014,514.04		ガーンジー	CSG GUERNSEY I LTD FRN 24/02/2041	USD	1,692,000	1,633,735.95
	PHOENIX PIB DUTCH HOLDING 3.125% 27/05/2020	EUR	1,200,000	1,214,883.61			カナダ	BOMBARDIER INC 6.125% 15/05/2021	EUR	3,531,000
	POLISH TELEV 11% 15/01/2021	EUR	1,325,000	1,633,614.58		VRX ESCROW CORP 4.5% 15/05/2023		EUR	6,800,000	6,664,170.00
	PORTUGAL TEL FIN 4.625% 08/05/20	EUR	6,498,000	6,411,559.73		クロアチア ケイマン諸島	AGROKOR 9.125% 01/02/2020	EUR	5,430,000	6,124,319.77
	PORTUGAL TELECOM 5.875% 17/04/2018	EUR	2,600,000	2,734,623.88			MEDI-PARTENAIRE 7% 15/05/20	EUR	2,933,000	3,134,643.75
	PORTUGAL TELECOM INTER 5% 04/11/2019	EUR	600,000	629,971.64		ジャージー	ASTON MARTIN 9.25% 15/07/18	GBP	2,949,000	4,401,524.89
RABOBANK NEDERLAND 5.5% PERP	EUR	4,500,000	4,545,676.23	AVIS BUDGE FINANCE PLC 6% 01/03/21	EUR		4,172,000	4,452,914.67		
REPSOL INTL FINANCE PERP 31/12/2049	EUR	2,650,000	2,583,807.79	HASTINGS INSR GR FIN 8% 21/10/2020	GBP	2,057,000	3,115,906.64			
REPSOL INTL FINANCE VAR 25/03/2075	EUR	4,650,000	4,346,988.47	HBOS CAP FUNDING TF/TV PERP	GBP	1,752,000	2,640,664.01			
SCHAEFFLER 5.75% 15/11/2021 PAY IN KIND	EUR	1,100,000	1,166,701.25	スイス	CREDIT SUISSE 5.75% 18/09/2025	EUR	1,880,000	2,176,188.85		
SCHAEFFLER FINANCE BV 2.5% 15/05/2020	EUR	1,000,000	983,167.22		UBS GROUP AG PERP 31/12/2049	EUR	2,600,000	2,692,933.39		
SCHAEFFLER FINANCE BV 3.25% 15/05/2019	EUR	5,169,000	5,215,844.06	スウェーデン	EILEME 2 AB 11.75% 31/01/2020	EUR	2,851,000	3,293,270.88		
SCHAEFFLER FINANCE BV 3.25% 15/05/2025	EUR	1,550,000	1,474,603.95		NORCELL SWEDEN HOLDING 10.75% 29/09/19	EUR	1,000,000	718,498.26		

Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額		
スウェーデン	NORDEA BANK AB PERP 31/12/2049	USD	3,000,000	2,618,120.62	ドイツ	THYSSENKRUPP AG 2.5% 25/02/2025	EUR	2,400,000	2,272,947.95	
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB PERP 31/12/2049	USD	4,100,000	3,638,774.53		THYSSENKRUPP AG 4% 27/08/2018	EUR	9,146,000	10,048,196.52	
	SWEBANK AB VAR 31/12/2049 PERP	USD	3,400,000	3,066,877.78		TRIONISTA HOLDGCO 30/04/20	EUR	1,736,000	1,806,886.67	
	TVN FINANCE CORP 7.375% 15/12/2020	EUR	5,101,000	5,591,067.95		TRIONISTA TOPCO 6.875% 30/04/21	EUR	2,400,000	2,559,500.00	
	VERISURE HOLDING AB 8.75% 01/09/2018	EUR	2,403,000	2,604,668.44		UNITY MEDIA KABELKW GMBH 3.75% 15/01/2027	EUR	5,250,000	5,123,125.00	
	VOLVO TREASURY AB VAR 10/03/2078	EUR	900,000	911,107.38		UNITYMEDIA 6.25% 15/01/29	EUR	3,580,000	4,125,577.08	
	VOLVO TREASURY AB VAR 10/06/2075	EUR	8,230,000	8,261,233.52		UNITYMEDIA HESSEN 5.5% 15/09/2022	EUR	7,012,000	6,822,237.75	
	スペイン	ABENGOA 8.875% 05/02/18	EUR	5,017,000		5,422,105.33	UNITYMEDIA HESSEN 5.625% 15/04/23	EUR	400,000	391,668.75
		ABENGOA FINANCE SAU 6% 31/03/2021	EUR	1,300,000		1,225,276.00	UNITYMEDIA HESSEN 5.75% 15/01/2023	EUR	4,739,000	4,697,385.66
		ABENGOA FINANCE SAU 7% 15/04/2020	EUR	2,300,000		2,210,108.33	UNITYMEDIA HESSEN NRW 4% 15/01/2025	EUR	1,490,000	1,551,752.22
ALMIRALL SA 04/01/2021		EUR	3,415,000	3,582,632.20	WEPA HYGIENEPRODUKTE 6.5% 15/05/2020	EUR	1,328,000	1,431,746.02		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG PERP 31/12/2049		EUR	5,800,000	5,825,735.92	日本	SOFTBANK CORP 4.625% 15/04/2020	EUR	2,886,000	3,144,745.53	
BANCO SANTANDER TF/TV PERP		EUR	4,700,000	4,632,625.50		ノルウェー	DNB BANK ASA VAR PERPETUAL 31/12/2049	USD	2,520,000	2,246,364.21
CAMPOFRIO FOOD GROUP SA 3.375% 15/03/2022		EUR	5,200,000	5,178,665.70	LOCK AS 7% 15/08/2021		EUR	3,540,000	3,827,625.00	
CELANESE US 3.25% 15/10/19		EUR	2,100,000	2,156,218.75	SILK BIDCO 7.5% 01/02/2022	EUR	1,370,000	1,440,212.50		
EMPARK FUNDING SA 6.75% 15/12/2019		EUR	700,000	759,368.75	フィンランド	STORA ENSO 5.5% 07/03/2019	EUR	2,945,000	3,318,371.28	
NH HOTELES SA 6.875% 15/11/2019		EUR	750,000	824,882.81		ブラジル	TELENET FINANCE LUX 6.375% 15/11/2020	EUR	250,000	262,567.19
OBRASCON HUARTE 7.625% 15/03/2020	EUR	1,836,000	1,748,185.07	フランス	ACCOR SA TF-2020 / TV PERPETUAL		EUR	6,000,000	5,982,000.00	
CE ENERGY 7% 01/02/2021	EUR	1,700,000	1,800,252.78		AREVA 3.25% 04/09/2020	EUR	1,200,000	1,209,171.95		
DANSKE BANK 5.875% PERP	EUR	3,560,000	3,635,187.12	AREVA 3.5% 22/03/21 *EUR	EUR	5,900,000	5,882,670.77			
TDC A/S TF-2021/TV 26/02/3015	EUR	4,050,000	3,940,408.66	AREVA 4.375% 06/11/19	EUR	650,000	691,742.79			
ドイツ	COMMERZBANK AG 7.75% 16/03/2021	EUR	8,600,000	10,446,939.05	AREVA 4.875% 23/09/2024	EUR	4,500,000	4,857,341.67		
	COMMERZBANK AG 8.125% 19/09/23	USD	3,200,000	3,408,925.18	AREVA SA 3.125% 20/03/2023	EUR	800,000	759,967.21		
	DEUTSCHE RASTSTATTEN 6.75% 30/12/20	EUR	2,171,000	2,322,970.00	ARKEMA SA TV PERPETUAL	EUR	5,100,000	5,357,842.87		
	HEIDELBERGCEMENT 8.5 31/10/19	EUR	5,289,000	6,791,957.50	BNP PARIBAS 6.125% PERP 31/12/2049	EUR	4,700,000	4,727,474.07		
	TECHEM ENERGY 7.875% 01/10/2020	EUR	3,716,000	4,111,080.48	BNP PARIBAS TF/TV PERPETUAL	EUR	2,800,000	2,766,596.00		
	TECHEM GMBH 6.125% 01/10/2019	EUR	2,021,000	2,137,495.21	BPCE TF/TV PERP	EUR	800,000	896,579.31		
	THYSEENKRUPP AG 3.125% 25/10/2019	EUR	2,020,000	2,124,500.41	CASINO GUICHARD TF/TV PERP	EUR	6,700,000	6,959,603.89		
	THYSEENKRUPP AG 1.75% 25/11/2020	EUR	3,050,000	2,973,820.61	CEGEDIM SA 6.75% 01/04/20	EUR	3,762,000	4,097,523.38		
					CERBA EUROPEAN LAB 7% 01/02/20	EUR	6,051,000	6,509,739.76		
					CMA CGM SA 7.75% 15/01/2021	EUR	1,700,000	1,703,801.39		

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	銘柄	通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額		
フランス	CNCEP TF/TV PERP	EUR	2,050,000	2,097,314.84	フランス	NUMERICABLE GROUP SA	EUR	4,324,000	4,447,639.38	
	CNCEP TF/TV PERP	EUR	500,000	522,604.32		5.625% 15/05/2024				
	CNP ASSURANCE TF/TV 05/06/2045	EUR	2,800,000	2,865,215.89		ORANGE TF/TV PERP	EUR	600,000	629,794.93	
	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES VAR 31/12/49	EUR	2,900,000	2,940,310.00		ORANGE TF/TV PERP	EUR	1,200,000	1,284,744.33	
	CREDIT AGRICOLE SA TF/TV PERPETUEL	USD	3,610,000	3,172,271.12		PAPREC HOLDING 5.25% 01/04/2022	EUR	6,000,000	6,216,375.00	
	CREDIT AGRICOLE SA VAR PERPETUAL	EUR	3,950,000	4,906,062.33		PEUGEOT 7.375% 06/03/2018	EUR	2,750,000	3,195,231.37	
	CREDIT AGRICOLE TF/TV PERPETUAL	EUR	4,176,000	4,215,489.98		PEUGEOT SA 6.5% 18/01/2019	EUR	3,800,000	4,453,574.91	
	CROWN EURO HOLDINGS 4% 15/07/2022	EUR	6,350,000	6,577,600.14		RENAULT SA 3.125% 05/03/2021	EUR	4,318,000	4,695,780.76	
	CROWN EURO HOLDINGS SA 3.375% 15/05/2025	EUR	2,250,000	2,081,601.56		REXEL SA 3.25% 15/06/2022	EUR	4,000,000	3,929,916.67	
	DARTY FIN 5.875% 01/03/21	EUR	2,753,000	2,928,972.14		REXEL SA 5.125% 15/06/2020	EUR	5,178,000	5,485,497.69	
	EDF TF/TV PERPETUAL	GBP	1,100,000	1,620,527.50		SG TF 8.875% 160618/TV PERP	GBP	1,718,000	2,722,427.52	
	EUROPCAR GROUPE SA 5.75% 15/06/2022	EUR	2,800,000	2,864,944.44		SGD GROUP 5.625% 15/04/2019	EUR	1,012,000	1,030,658.75	
	FAURECIA 3.125% 15/06/2022	EUR	6,745,000	6,463,747.55		SOCIETE GENERALE TF/TV PERPETUAL	EUR	4,450,000	5,813,025.86	
	GROUPAMA SA TF/TV PERP 31/12/2049	EUR	2,500,000	2,664,523.84		SOCIETE GENERALE TF/TV PERPETUAL	EUR	3,923,000	3,981,459.77	
	GROUPAMA SA TF/TV PERPETUAL	EUR	3,900,000	4,000,417.01		SOGECAP SA VAR 29/12/2049	EUR	3,400,000	3,265,046.55	
	GROUPAMA TV 27/10/39	EUR	6,850,000	8,005,754.90		SOLVAY FINANCE TF-2019/TV PERP	EUR	1,818,000	1,883,978.15	
	GROUPE SMC P SAS 8.875% 15/06/2020	EUR	4,107,000	4,544,858.11		SOLVAY FINANCE TV PERPETUAL	EUR	1,500,000	1,669,222.40	
	HOMEVI 6.875% 15/08/2021	EUR	5,020,000	5,382,851.88		SPCM SA 2.875% 15/06/2023	EUR	6,750,000	6,353,085.94	
	ITALCEMENTI MULTICPON 19/03/20	EUR	4,375,000	5,013,251.80		THOM EUROPE SAS 7.375% 15/07/2019	EUR	5,010,000	5,379,748.44	
	LA FINANCIERE ATALIAN SA 7.25% 15/01/2020	EUR	1,676,000	1,849,012.08		VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN PERPETUAL	GBP	1,000,000	1,430,989.51	
LABCO SAS 8.5% 15/01/2018	EUR	1,604,000	1,726,639.17	VEOLIA ENVIRONNEMENT TF/TV PERPETUAL	EUR	5,900,000	6,189,801.23			
LABEYRIE FINE 5.625% 15/03/2021	EUR	4,234,000	4,466,473.06	ベルギー	EUR	4,060,000	4,001,176.23			
LAFARGE MULTICPON 29/11/18	EUR	6,300,000	7,409,851.84	KBC GROEP NV TF/TV PERPETUAL	EUR	1,000,000	1,053,937.50			
LAFARGE SA 4.75% 30/09/2020	EUR	7,995,000	9,526,925.13	ONTEX GROUP 4.75% 15/11/2021	EUR	1,200,000	1,243,078.49			
LAFARGE SA 5.875% 09/07/2019	EUR	5,597,000	6,891,330.71	ポルトガル	EUR	2,500,000	2,531,485.62			
LOXAM SAS 7.375% 24/01/2020	EUR	1,770,000	1,901,591.49	BANCO ESPERITO SANTO 4.75% 15/01/2018	EUR	1,600,000	1,562,081.97			
NATIXIS TF/TV PERP	EUR	1,200,000	1,355,328.72	BANCO ESPIRITO 4% 21/01/19	EUR	1,100,000	1,158,628.63			
NEXANS 5.75% 02/05/17 *EUR	EUR	1,150,000	1,223,817.49	BANCO ESPIRITO SANTO S. A 2.625% 08/05/2017	EUR	1,600,000	1,562,081.97			
NOVAFIVES SAS 4.5% 30/06/2021	EUR	4,050,000	3,943,181.25	PORTUCEL 5.375% 15/05/2020	EUR	1,100,000	1,158,628.63			
NOVALIS SAS 3% 30/04/2022	EUR	8,600,000	8,335,263.33	メキシコ	EUR	2,000,000	1,950,451.39			
NUMERICABLE 5.375% 15/05/2022	EUR	4,943,000	5,116,777.34	CEMEX SAB DE CV 4.375% 05/03/2023	EUR	1,300,000	1,332,823.19			
				CEMEX SAB DE CV 4.75% 11/01/2022	EUR	600,000	542,410.32			
				CEMEX SAB DE CV 6.125% 05/05/2025	USD	600,000	542,410.32			
				ルクセンブルク	EUR	2,262,000	2,452,212.21			
				ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA 8.75% 01/11/19	EUR	2,262,000	2,452,212.21			

## Amundi Funds ボンド・ユーロ・ハイ・イールド

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額	銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額
ルクセンブルク	ALTICE FINANCING 8% 15/12/2019	EUR	1,000,000	1,063,333.33	ルクセンブルク	GATEGROUP FIN 6.75% 01/03/2019	EUR	1,329,000	1,013,184.51
	ALTICE FINANCING SA 5.25% 15/02/2023	EUR	3,200,000	3,284,133.33		GAZ CAPITA 6.605% 02/18 *EUR	EUR	3,109,000	3,347,713.28
	ALTICE FINANCING SA 6.5% 15/01/2022	EUR	1,500,000	1,638,437.50		GAZPROM 3.389% LPN 20/03/20	EUR	800,000	755,155.80
	ALTICE SA 7.25% 15/05/2022	EUR	11,035,000	11,445,364.06		GAZPROM CAPITAL 3.7% 25/07/2018	EUR	2,900,000	2,931,365.68
	ARCELORMITTAL 2.875% 06/07/2020	EUR	1,500,000	1,512,652.40		GAZPROM OAO 3.6% 26/02/2021	EUR	2,600,000	2,441,998.36
	ARCELORMITTAL 3% 09/04/2021	EUR	4,900,000	4,785,777.63		GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA 3.755% 15/03/2017	EUR	4,450,000	4,493,288.41
	ARCELORMITTAL 3% 25/03/2019	EUR	3,500,000	3,536,577.87		GCS HOLDCO 6.5% 15/11/2018	EUR	1,365,000	1,420,453.13
	ARCELORMITTAL 3.125% 14/01/2022	EUR	3,000,000	2,937,983.84		GESTAMP FUND LUX 5.875% 31/05/2020	EUR	5,189,000	5,434,936.98
	ARDAGH FINANCIAL HOLDINGS SA 8.375% PIK 15/06/2019	EUR	417,030	425,816.65		HEIDELBERGCEMENT 7.50% 03/04/20	EUR	11,315,000	14,280,944.38
	CIRSA FUNDING LUX 8.75% 15/05/18	EUR	2,020,000	1,476,063.84		HELLAS II TV 15/01/15 DEFAULTED	EUR	7,474,000	112,110.00
	CIRSA FUNDING LUXEMBOURG 5.875% 15/05/2023	EUR	5,980,000	5,823,996.75		INEOS GROUP HOLDINGS SA 5.75% 15/02/2019	EUR	4,166,000	4,297,489.38
	CNH 2.875% 27/09/2021	EUR	2,540,000	2,560,582.28		INEOS GRP 6.5% 15/08/2018	EUR	2,800,000	2,927,050.00
	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 2.75% 18/03/2019	EUR	3,100,000	3,138,949.04		KION FINANCE SA 6.75% 15/02/2020	EUR	1,473,000	1,591,300.31
	CONVATEC HEALTHCARE 10.875% 15/12/18	EUR	1,000,000	1,057,031.25		MAGNOLIA BC 9% 01/08/2020	EUR	4,050,000	4,453,987.50
	DUPRY FINANCE SCA 4.5% 15/07/2022	EUR	4,170,000	4,361,190.33		MATTERHORN TELECOM SA 3.875% 01/05/2022	EUR	6,850,000	6,539,775.87
	ELIOR FINANCE & CO SCA 6.5% 01/05/2020	EUR	2,966,000	2,088,210.24		MATTHORN TEL HLD 4.875% 01/05/2018	EUR	1,250,000	1,211,341.15
	FIAT FINANCE & TRADE 4.75% 15/07/2022	EUR	7,900,000	8,635,078.77		ONEX WIZARD AC II 7.75% 15/02/2023	EUR	2,600,000	2,784,181.11
	FIAT FINANCE & TRADE 6.75% 14/10/2019	EUR	10,877,000	12,851,689.55		PICARD BONDCO 7.75% 01/02/2020	EUR	6,200,000	6,818,983.89
	FIAT FINANCE & TRADE 7.75% 17/10/2016	EUR	1,000,000	1,119,606.16		PLAY FINANCE 2 5.25% 01/02/2019	EUR	4,857,000	5,093,191.86
	FIAT FINANCE & TRADE LTD SA 6.25% 09/03/2018	EUR	7,535,000	8,453,610.30		PLAY FINANCE 2 SA 6.5% 01/08/2019	EUR	2,400,000	2,566,014.67
	FIAT FINANCE & TRADE LTD SA 7.375% 08/07/2018	EUR	5,348,000	6,390,600.66		PLAY TOPCO 7.75% 28/02/20	EUR	1,900,000	1,992,651.39
	FIAT FINANCE AND TRADE LTD S.A 4.75% 22/03/2021	EUR	2,700,000	2,872,821.98		TELENET FI 6.625% 02/21 *EUR	EUR	4,045,000	4,339,410.27
	FIAT FINANCE&TRADE 6.625% 15/03/2018	EUR	6,200,000	6,919,498.65		TELENET FIN 6.75% 15/08/2024	EUR	4,095,000	4,581,946.69
	FINDUS BONDCO SA 9.125% 01/07/2018	EUR	2,489,000	2,720,157.23		TELENET FINANCE V 6.25% 15/08/2022	EUR	2,225,000	2,446,804.69
	FINMEC FINANCE SA 4.5% 19/01/2021	EUR	6,672,000	7,245,322.31		TELITA FIN 7.75% 24/01/33 *EUR	EUR	2,364,000	3,140,894.60
	FINNECCANICA FINANCE 5.25% 21/01/2022	EUR	2,000,000	2,246,027.40		UNICREDITO LUXEMB 6% 31/10/17	USD	1,000,000	956,327.41
	FMC FIN 6.5% 15/09/18	EUR	842,000	980,473.92		UNICREDITO TF/TV PERP	EUR	5,410,000	6,191,419.81
	FMC FIN 7 5.25% 15/02/21 *EUR	EUR	4,425,000	5,195,779.69		WIND ACQUISITION FIN 7% 23/04/2021	EUR	10,288,000	10,761,533.78

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額
ルクセンブルク	WIND ACQUISITION FIN SA 4% 15/07/2020	EUR	10,450,000	10,615,458.33
	ZINC CAPITAL 8.875% 15/05/2018	EUR	2,389,000	2,523,963.57

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。  
EUR (ユーロ)、USD (米ドル)、GBP (英ポンド)

## (2) 投資証券

(2015年6月30日現在)

銘柄		口数	現地通貨	ユーロ換算評価額
フランス	Amundi 3 M FCP	0.001	EUR	1,059.99
	AMUNDI TRESO COURT TERME PART I C	328.541	EUR	6,198,320.21
	AMUNDI TRESO EONIA ISR I C	371.951	EUR	81,845,716.03
ルクセンブルク	AMUNDI ABSOLUTE HIGH YIELD	1,531.639	EUR	1,538,439.48
	STRUCT T HYB BD IEC C.	30,000	EUR	3,066,300.00

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。  
EUR (ユーロ)

