

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2017年3月10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）（2017年3月10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% 06/04/2017	1,795,000	1,794,373.55	2017/4/6
		USA 0% 20/4/2017	1,265,000	1,264,289.91	2017/4/20
		6.633	1,106,000	1,159,152.70	2021/4/28
		9	893,000	995,114.55	2018/11/15
		5.125	840,000	844,273.62	2027/5/1
		0.91944	1,900,000	673,694.52	2047/4/19
カナダ		7	590,000	601,829.50	2024/3/15
アメリカ		6.5	3,000,000	571,155.61	2035/12/25
		5.75	517,000	539,716.55	2021/8/1
		6.5	520,000	535,535.00	2017/6/1
カナダ		5.875	658,000	527,233.92	2023/5/15
アメリカ		3	465,000	467,770.63	2019/2/6
		4.52317	440,000	454,974.73	2021/7/15
アイルランド		4.289	440,000	452,755.69	2021/5/15
アメリカ		—	447,680	451,552.86	2020/1/7
		6.5	415,000	450,592.01	2020/2/15
		5.75	425,000	447,327.26	2020/10/15
		3.36	435,000	437,182.25	2021/9/20
		7	390,000	417,245.83	2022/5/15
		5.45	415,000	411,658.44	2047/3/1
		5	410,000	411,025.00	2025/4/1
		6.25	410,000	410,258.30	2023/3/31
		5.125	394,000	407,432.94	2021/6/1
		5.375	400,000	404,000.00	2027/5/15
		6.625	375,000	402,097.66	2018/4/1
		—	400,000	399,813.29	2017/4/13
		8.734	990,000	388,139.96	2026/10/1
		5	381,000	385,331.55	2024/1/15
		5.375	360,000	379,868.75	2021/12/15
		5.25	355,000	356,775.00	2025/4/1

(注) 額面金額の小数点以下は四捨五入です。

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2017年3月9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）（2017年3月9日現在）

銘柄		利率	口数/額面金額	評価額	償還年月日	
		%	ユーロ	ユーロ		
フランス	投資証券	Amundi 3 M FCP	—	53,976	57,187,870.01	—
		AMUNDI TRESO COURT TERME PART I C	—	1,742,355	32,798,421.57	—
ルクセンブルク	債券	ALTICE SA 7.25% 15/05/2022	7.25	10,535,000	11,191,681.67	2022/5/15
イタリア		INTESA SANPAOLO SPA 6.625% 13/09/2023	6.625	9,200,000	11,070,513.75	2023/9/13
ルクセンブルク	投資証券	STRUCTURA GLOBAL MARCO MULTI CREDIT EUR SICAV	—	9,850	10,432,824.50	—
イタリア	債券	UNICREDIT 6.95% 31/10/2022	6.95	8,258,000	9,810,594.95	2022/10/31
フランス	投資証券	AMUNDI CASH INST SRI I C	—	44,399	9,764,188.31	—
イタリア	債券	TELECOM ITALIA SPA 3.25% 16/01/2023	3.25	9,000,000	9,556,471.23	2023/1/16
イギリス		TESCO 6.125% 24/02/22 *GBP	6.125	7,120,000	9,476,655.88	2022/2/24
		INTERNATIONAL GAME TECH 4.75% 15/02/2023	4.75	8,700,000	9,445,300.00	2023/2/15
イタリア		TELECOM ITALIA 5.875% 19/05/23	5.875	7,000,000	9,383,929.98	2023/5/19
ルクセンブルク		WIND ACQUISITION FIN SA 4% 15/07/2020	4	8,900,000	9,108,260.00	2020/7/15
		WIND ACQUISITION FIN 7% 23/04/2021	7	8,538,000	9,073,285.17	2021/4/23
日本		SOFTBANK GROUP CORP 4.75% 30/07/2025	4.75	8,000,000	8,937,326.67	2025/7/30
ルクセンブルク		UNICREDITO TF/TV PERP	8.125	7,410,000	8,553,718.27	—
		FIAT FINANCE & TRADE 6.75% 14/10/2019	6.75	7,327,000	8,542,182.95	2019/10/14
		FIAT FINANCE & TRADE 4.75% 15/07/2022	4.75	7,500,000	8,471,793.49	2022/7/15
イギリス		TESCO PLC 5% 24/03/2023	5	6,288,000	8,366,077.72	2023/3/24
ルクセンブルク		MATTERHORN TELECOM SA 3.875% 01/05/2022	3.875	7,850,000	8,082,264.06	2022/5/1
オランダ		GAS NATURAL FENOSA TF-2022 / TV PERPETUEL	4.125	7,500,000	7,811,583.90	—
イギリス		BARCLAYS BANK PERP	0	5,000,000	7,658,293.38	—
フランス		REXEL SA 3.50% 15/06/2023	3.5	7,200,000	7,525,200.00	2023/6/15
イタリア		ENEL SPA TF/TV 15/01/2075	5	7,000,000	7,505,821.92	2075/1/15
		INTESA SANPAOLO SPA VAR 31/12/2049	8.047	6,500,000	7,322,003.18	—
イギリス		VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5% 15/04/2027	5	6,300,000	7,283,770.68	2027/4/15
フランス		NUMERICABLE GROUP SA 5.625% 15/05/2024	5.625	6,724,000	7,152,655.00	2024/5/15
オランダ		PETROBRAS INTL 5.875% 07/03/2022	5.875	6,450,000	7,124,192.17	2022/3/7
フランス		HOMEVI 6.875% 15/08/2021	6.875	6,520,000	6,894,817.41	2021/8/15
イタリア		INTESA SANPAOLO SPA VAR PERPETUAL	8.375	5,850,000	6,821,100.00	—
ドイツ		UNITY MEDIA KABELKW GMBH 3.75% 15/01/2027	3.75	6,750,000	6,690,093.75	2027/1/15

TCW ファンズ- MetWest ハイ・イールド・ボンド・ファンド

決算日 2016年9月30日

(計算期間：2015年10月1日～2016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)」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2016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。

ファンドの形態	ルクセンブルク籍会社型投資信託
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。
運用会社	TCWインベストメント・マネジメント・カンパニー
信託報酬等（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 (2015年10月1日～2016年9月30日)

項目	当期
	米ドル
(a) 運用報酬	185,993
(b) 管理費用等	72,030
(c) その他の費用	86,273
合計	344,296

■純資産計算書 (2016年9月30日現在)

項目	当期末
	米ドル
資産合計	41,908,774
有価証券	38,552,823
預金	2,101,162
有価証券売却未収入金	354,621
為替未収入金	324,609
未収利息	575,480
為替予約取引評価勘定	79
負債合計	674,839
証拠金勘定	324
未払配当金	324,609
為替未払金	324,689
未払運用報酬	13,425
未払投資顧問料	5,517
未払税	1,086
未払管理費用	5,168
為替予約取引評価勘定	21
純資産	41,233,935

(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 (2016年9月30日現在)

(1) 債券

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	200,000	210,101.39	アメリカ	CHARTER COMMUNICATIONS OPER E 1L 07/01//2020	USD	448,840	450,776.96
	ARDAGH PKG FIN LIBOR3+3% 15/12/2019	USD	200,000	203,580.86		CHESAPEAKE ENERGY 5.75% 15/03/2023	USD	45,000	38,582.81
	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA FRN 15/05/2021	USD	440,000	449,986.56		CHURCHILL DOWNS 5.375% 15/12/21	USD	385,000	406,435.68
	ENDO FIN LTD 6% 15/07/2023	USD	200,000	185,500.00		CIT GROUP 6.625% 01/04/2018	USD	375,000	411,259.11
	GRIFOLS WORLDWIDE OP LTD 5.25% 01/04/2022	USD	250,000	266,526.04		CIT GROUP INC 5.25% 15/03//18	USD	250,000	261,171.88
アメリカ	ACADIA HEALTHCAR CO INC 6.5% 01/03/2024	USD	76,000	80,197.94	CIT GROUP INC 5.5% 15/02/2019	USD	45,000	48,065.63	
	ALLY FINANCIAL INC 4.75% 10/09/2018	USD	160,000	166,622.22	CITIGROUP INC FRN 25/08/2036	USD	500,000	371,118.12	
	ALTICE US FINANCE I CORP 5.375% 15/07/2023	USD	200,000	209,739.58	CLEAN HARBORS INC 5.125% 01/06/2021	USD	330,000	345,490.52	
	AMER AIRLN 13-1 B PASSE T 5.625% 15/01/2021	USD	375,000	329,163.37	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE 6.50% 15/11/2022	USD	45,000	48,009.38	
	AMSI 2005-R2 M2 FRN 25/04/2035	USD	180,000	102,912.15	COMMUNITY HEALTH 31/12/2019	USD	248,116	243,928.63	
	ARAMARK SERVICES INC 5.125% 15/01/2024	USD	198,000	208,529.06	COMMUNITY HEALTH 31/12/2019	USD	628	617.54	
	ARAMARK SERVICES INC 5.75% 15/03/2020	USD	149,000	154,385.73	CONCHO RESOURCES 5.5% 01/04/2023	USD	130,000	138,267.64	
	ARC PROPERTIES OPERATING 3% 06/02/2019	USD	385,000	394,432.50	CONSTELLATION BRANDS 6% 01/05/2022	USD	45,000	53,036.25	
	ARCH COAL INC 7% 15/06/2019 DEFAULTED	USD	480,000	23,100.00	CONSTELLATION BRANDS INC 4.75% 01/12/2025	USD	200,000	220,140.28	
	ARCH COAL INC 8% 15/01/2019 DEFAULTED	USD	205,000	10,506.25	COTT BEVERAGES INC 6.75% 01/01/2020	USD	350,000	371,590.63	
	AXALTA COATING SYSTEMS 4.875% 15/08/2024	USD	150,000	155,393.75	CSC HOLDING LLC 6.75% 15/11/2021	USD	100,000	108,531.25	
	B&G FOODS 4.625% 01/06/2021	USD	25,000	26,257.20	CSC HOLDING LLC 8.625% 15/05/2019	USD	221,000	249,626.41	
	BALL CORP 4.375% 15/12/20	USD	80,000	86,665.28	CSC HOLDINGS LLC 5.5% 15/04/2027	USD	225,000	231,428.13	
	BERRY PLASTICS CORP 5.125% 15/07/2023	USD	110,000	113,503.44	CSFB 2005-11 1A1 6.50% 25/12/2035	USD	3,000,000	588,074.98	
	BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/2023	USD	130,000	144,726.56	DAVITA HEALTHCARE 5.125% 15/07/2024	USD	63,000	65,168.91	
	CABLE ONE INC 5.75% 15/06/2022	USD	175,000	186,247.40	DAVITA HEALTHCARE PARTNE 5% 01/05/2025	USD	215,000	221,341.31	
	CARMIKE CINEMAS 6% 15/06/2023	USD	270,000	286,875.00	DAVITA INC 5.75% 15/08/2022	USD	150,000	158,765.63	
	CCO HOLDINGS 6.625% 31/01/2022	USD	405,000	429,721.88	DISH DBS 7.875% 01/09/2019	USD	300,000	339,403.13	
	CENTENE CORP 5.625% 15/02/2021	USD	20,000	21,390.63	DISH DBS CORP 4.625% 15/07/2017	USD	149,000	153,788.18	
	CENTRAL GARDEN & PET CO 6.125% 15/11/2023	USD	75,000	82,347.66	DISH DBS CORP 5.125% 01/05/2020	USD	15,000	15,955.68	
	CEQUEL COM ESCROW 6.375% 15/09/2020	USD	85,000	88,200.78	DOLLAR TREE INC 5.25% 01/03/2020	USD	25,000	26,199.48	
	CEQUEL COM HLDG I /CAP CP 5.125% 15/12/2021	USD	10,000	10,174.58					

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	DOLLAR TREE INC TL-B2 09/03/2022	USD	225,000	228,212.88	アメリカ	JPM CHASE CAPITAL XXI LIB3 02/02/37	USD	580,000	468,961.33
	DOUBLE EAGLE ACQ SUB INC 7.50% 01/10/2024	USD	280,000	283,500.00		KFC HLD/PIZZA HUT/TACO 5.00% 01/06/2024	USD	150,000	159,291.67
	DS SERVICES OF AMERICA I 10% 01/09/2021	USD	250,000	282,013.89		KLX INC 5.875% 01/12/2022	USD	62,000	65,529.05
	DSLA 2007-AR1 2A1A DSLA MORTGAGE LOAN TRUST 19/04/47	USD	1,900,000	655,888.24		LAMAR MEDIA CORP 5.75% 01/02/2026	USD	100,000	109,504.86
	DUPONT FABROS 5.785% 15/09/2021	USD	190,000	200,202.60		LEVEL 3 FINANCING INC 5.250% 15/03/2026	USD	40,000	42,446.67
	ENDEAVOR ENERGY RESOURCE 7% 15/08/2021	USD	40,000	41,650.00		LEVEL 3 FINANCING INC 6.125% 15/01/2021	USD	100,000	106,682.29
	ENERGY TRANSFER PARTNERS FRN 01/11/2066	USD	525,000	360,302.25		LIFEPOINT HOSPITALS INC 5.5% 01/12/2021	USD	55,000	58,543.68
	EP ENERGY 9.375% 01/05/2020	USD	80,000	60,104.17		LIN TELEVISION 5.875% 15/11/22	USD	370,000	397,576.56
	EQUINIX INC 5.875% 15/01/2026	USD	45,000	49,150.78		MACH GEN ESCROW	USD	12,557	32,962.13
	FIRST DATA CORP 5% 15/01/2024	USD	120,000	123,500.00		METROPCS 6.625% 1120	USD	640,000	677,500.00
	FIRST DATA CORP 6.75% 01/11/20	USD	570,000	609,436.88		METROPOLITAN WEST ASSET MANAGEMENT 22/06/23	USD	80,000	81,089.64
	FIRST DATA CORPORATION 24/03/2021	USD	149,479	150,830.53		METROPOLITAN WEST ASSET MANAGEMENT 27/06/23	USD	30,000	30,279.45
	FIRST DATA CORPORATION 5.375% 15/08/2023	USD	125,000	130,221.09		MGM RESORTS 8.625% 01/02/2019	USD	200,000	229,327.08
	FRESENIUS MED CARE II 4.125% 15/10/2020	USD	305,000	326,397.66		MIDAS INT HOLDCO II/FIN 7.875% 01/10/2022	USD	38,000	40,342.94
	FRESENIUS MED CARE II 4.75% 15/10/2024	USD	125,000	134,596.35		MIDCONTINENT COMM AND FIN 6.875% 15/08/2023	USD	110,000	118,576.56
	FRONTIER COMMUNICATIONS 8.875% 15/09/2020	USD	180,000	195,290.63		MIRANT AMERICAS 8.5% 01/10/2021	USD	180,000	160,607.50
	GOODYEAR TIRE & RUBBER 7% 15/05/2022	USD	315,000	344,925.00		MIRANT TRUST 10.06% 30/12/28	USD	110,000	86,825.71
	GRAPHIC PACKAGE INTL 4.125% 15/08/2024	USD	185,000	187,888.70		MOLINA HEAL THCARE INC 5.375% 15/11/2022	USD	190,000	200,954.69
	HARVEY GULF INTERNATIONAL M TL B 1L 5.5% 14/06/20	USD	297,140	187,940.77		MPH ACQUISITION HOLDINGS 7.125% 01/06/2024	USD	35,000	38,582.76
	HCA INC 4.75% 01/05/2023	USD	480,000	512,086.67		MSCI INC 4.750% 01/08/2026	USD	180,000	185,380.00
	HCA INC 6.5% 15/02/20	USD	560,000	627,970.00		NBTY INC 7.625% 15/5/2021	USD	188,000	198,201.22
	HEALTHSOUTH 5.75% 01/11/24	USD	170,000	180,951.16		NBTY INC B 05/05/202	USD	79,800	80,283.99
	HILL - ROM HOLDINGS INC 01/09/2023	USD	102,000	109,719.56		NEP BROADCASTING LLC 22/07/20	USD	124,022	128,362.81
	HILTON W 5.625% 21	USD	390,000	411,783.16		NEP/NCP HOLDCO INC 22/01/2020	USD	83,000	82,861.81
	HOLOGIC INC 5.25% 15/07/2022	USD	40,000	43,037.50		NEXSTAR ESCROW CORP 5.625% 01/08/2024	USD	115,000	117,282.03
	HOMER CITY GENERATION 8.734% 01/10/2026 PIK	USD	990,000	369,893.08		NFR ENERGY 2ND 31/12/18 DEFAULTED	USD	250,000	9,062.50
	HOMER CITY GENERATION LP 8.137% 01/10/2019	USD	440,000	135,511.08		NGPL PIPECO 7.119% 15/12/2017	USD	320,000	342,644.40
	INTL LEASE 6.25% 15/05/2019	USD	150,000	166,453.13		ORBITAL ATK INC 5.5% 01/10/2023	USD	225,000	242,965.63
	ISLE OF CAPRI CASINOS 5.875% 15/03/2021	USD	120,000	126,293.75		OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C 5.25% 15/02/2022	USD	35,000	37,220.31

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	PARSLEY ENERGY LLC 6.25% 01/06/2024	USD	175,000	185,299.48	アメリカ	SEALED AIR CORP 5.125% 01/12/2024	USD	80,000	86,255.28
	PDC ENERGY INC 6.125% 15/09/2024	USD	115,000	119,605.99		SHEA HOMES LP/FNDG CP 6.125% 01/04/2025	USD	90,000	92,909.69
	PEABODY ENERGY 4.75% 15/12/41 CV	USD	825,000	36,179.69		SIRIUS XM RADIO 4.25% 15/05/20	USD	80,000	82,975.00
	PEABODY ENERGY 6% 15/11/2018	USD	225,000	60,187.50		SIRIUS XM RADIO INC 5.75% 01/08/2021	USD	470,000	496,648.35
	PEACOCK ENGINEERING CO TL-1L 30/06/2022	USD	1,211	1,229.07		SIRIUS XM RADIO INC 5.875% 01/10/20	USD	100,000	105,796.18
	PEACOCK ENGINEERING CO TL-1L 30/06/2022	USD	273,684	277,133.77		SPECTRUM BRANDS INC 6.625% 15/11/2022	USD	20,000	22,196.88
	PEACOCK ENGINEERING CO TL-1L 30/06/2022	USD	22,105	22,383.88		SPRINT NEXTEL CORP 9.25% 15/04/2022	USD	360,000	400,462.50
	PINNACLE FOODS INC 5.875% 15/01/2024	USD	15,000	16,271.09		SPRINT NEXTEL CORP 9% 15/11/2018	USD	483,000	550,644.15
	POWER BUYER LLC TL 2L FRN 06/11/2020	USD	250,000	249,375.00		SS&C TECH HOLDINGS INC 5.875% 15/07/2023	USD	63,000	67,393.59
	PTC INC 6% 15/05/2024	USD	50,000	54,775.00		STANDARD INDUSTRIES INC 5.125% 15/02/2021	USD	15,000	15,911.72
	QUINTILES TRANSNATIONAL 4.875% 15/05/2023	USD	122,000	128,424.06		SUMMIT MID 7.5% 01/07/2021	USD	120,000	127,025.00
	QWEST CORP 6.75% 01/12/21	USD	150,000	171,346.88		SUNOCO LP FINANCE CORP 5.5% 01/08/2020	USD	155,000	158,915.90
	QWEST CORP 7.25% 15/09/2025	USD	113,000	124,183.95		SVHE 2006-EQ1 A4 TV 25/10/2036	USD	425,000	314,638.31
	RALI 2005-QA7 A1 VAR 25/07/2035	USD	890,000	132,879.56		SYNAGRO INFRASTRUCTRE 19/08/20	USD	269,349	226,926.40
	RANGE RESOURCES CORP 4.875% 15/05/2025	USD	78,000	76,695.94		SYNAGRO INFRASTRUCTRE 19/08/20	USD	16,834	14,182.90
	REGIONALCARE HOSPITAL PR 8.25% 01/05/2023	USD	70,000	75,047.29		SYNAGRO INFRASTRUCTRE 19/08/20	USD	50,503	42,548.70
	REYNOLDS GP 21/01/23	USD	42,887	43,081.21		TEGNA INC 5.125% 15/10/2019	USD	42,000	44,456.56
	REYNOLDS GROUP 21/01/23	USD	40,930	41,115.70		TELEFLEX INC 4.875% 01/06/2026	USD	32,000	33,680.67
	REYNOLDS GROUP HOLDINGS INC 21/01/23	USD	26,183	26,301.39		TENET HEALTHCARE CORP 6% 01/10/2020	USD	460,000	501,323.33
	REYNOLDS GROUP ISS/REYNOLD 5.75% 15/10/20	USD	375,000	398,007.81		TENET HEALTHCARE CORP FRN 15/06/2020	USD	325,000	328,871.60
	REYNOLDS GRP ISS FRN 15/07/2021	USD	440,000	452,492.02		TENNECO INC 5% 15/07/2026	USD	5,000	5,149.31
	RFMSI 2007-SA2 1A RESIDENTIAL FUNDING MTG 25/04/37	USD	1,000,000	102,725.95		TENNECO INC 5.375% 15/12/2024	USD	100,000	107,067.71
	RIVERS PITTSBURGH LP/FIN 6.125% 15/08/2021	USD	105,000	109,836.20		TEXAS COMPETITIVE ELECTRIC 27/07/23	USD	18,571	18,735.60
	ROCKIES EXPRESS 5.625% 15/04/2020	USD	85,000	92,078.91		TEXAS COMPETITIVE ELECTRIC HOLDING 27/07/23	USD	81,429	82,148.40
	RSI HOME PRODUCTS INC 6.5% 15/03/2023	USD	100,000	106,270.83		T-MOBILE USA 6.633% 28/04/2021	USD	150,000	160,151.03
	SABINE PASS LNG 7.5% 30/11/2016	USD	390,000	402,918.75		T-MOBILE USA INC 6.542% 28/04/2020	USD	150,000	156,940.02
	SARM 2005-15 1A1 FRN 25/07/2035	USD	450,000	83,448.90		T-MOBILE USA INC 6.731% 28/04/2022	USD	235,000	250,649.19
	SBA COMMUNICATIONS CORP 4.875% 01/09/2024	USD	375,000	381,972.66		TRANSDIGM INC 5.5% 15/10/2020	USD	100,000	105,583.33
	SBA COMMUNICATIONS CORP 5.625% 01/10/2019	USD	125,000	132,477.34		TRANSDIGM INCE 14/05/22	USD	60,000	60,150.00

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	TREEHOUSE FOODS INC 6% 15/02/2024	USD	31,000	33,751.25	カナダ	OPEN TEXT CORP 5.875% 01/06/2026	USD	90,000	96,150.00	
	UNIVISION COMMUNICATIONS 5.125% 15/05/2023	USD	220,000	228,078.13		VALEANT PHARMACEUTICALS 5.625% 01/12/2021	USD	80,000	72,987.50	
	USA 0% 05/01/2017	USD	1,500,000	1,498,962.00		VRX ESCROW CORP 5.875% 15/05/2023	USD	604,000	538,031.88	
	USA 0% 12/01/2017	USD	395,000	394,748.94		VRX ESCROW CORP 6.125% 15/04/2025	USD	265,000	237,326.82	
	USA 0% 23/2/2017	USD	945,000	943,727.09		日本	SOFTBANK 4.5% 15/04/2020	USD	200,000	211,875.00
	UNITED RENTALS INC 4.625% 15/07/2023	USD	100,000	103,838.54			パミューダ IHS MARKIT LTD 5% 01/11/2022	USD	185,000	198,266.56
	VALVOLINE FINCO TWO LLC 5.5% 15/07/2024	USD	405,000	428,568.75		NCLH CORP LTD 5.25% 15/11/2019	USD	240,000	248,325.00	
	VEREIT OPERATING PARTNER 4.125% 01/06/2021	USD	130,000	136,632.71		フランス	LULLY FINANCE S.A.R.L TL 1L 11/07/2022	USD	168,823	169,878.01
	WALTER ENERGY INC 8.5% 15/04/2021 DEFAULTED	USD	290,000	65.25		NUMERICABLE SFR SA 7.375% 01/05/2026	USD	200,000	211,612.31	
	WALTER ENERGY INC VAR 01/04/2020 DEFAULTED	USD	509,850	114.72		マーシャル諸島 DRILLSHIPS FIN 03/21	USD	65,970	34,161.33	
	WELLCARE HEALTH 5.75% 15/11/2020	USD	275,000	290,039.06		ルクセンブルク ALTICE FINANCING SA 7.5% 15/05/2026	USD	200,000	214,875.00	
	WHITING PETROLEUM CORP 5% 15/03/2019	USD	50,000	48,729.17		COVERIS HOLDINGS SA 7.875% 01/11/2019	USD	100,000	106,009.38	
	WINDSTREAM 6.375% 01/08/2023	USD	45,000	41,532.66		INTELSAT 7.5% 01/04/2019	USD	120,000	101,153.83	
	WPX ENERGY 5.25% 15/09/2024	USD	110,000	103,090.63		INTELSAT JACKSON HLDG 5.5% 01/08/2023	USD	290,000	204,889.03	
	イギリス	LYNX I CORP 5.375% 15/04/2021	USD	380,000		366,242.81	NIELSEN CO LUX 5.5% 01/10/2021	USD	325,000	350,137.85
オランダ	NXP BV/NXP FUNDING LLC 3.875% 01/09/2022	USD	200,000	211,770.96	(注1) 額面金額の小数点以下は四捨五入です。 (注2) 通貨欄の表記は以下の通りです。 USD (米ドル)					
	NXP BV/NXP FUNDING LLC 4.125% 01/06/2021	USD	200,000	217,648.96						
カナダ	MEG ENERGY CORP 6.5% 15/03/2021	USD	115,000	94,760.96						

(2) 株式等

銘柄		株数	通貨	米ドル換算評価額
アメリカ	ENTEGR EQUITY	1,175	USD	248,435.77
	SEVENTY SEVEN ENERGY INC	87	USD	1,639.95
	SEVENTY SEVEN ENERGY INC WRT 01/08/2021	474	USD	2,528.08

(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 2016年6月30日

(計算期間：2015年7月1日～2016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2016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外国投資信託
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。
運用会社	アムンディ アセットマネジメント
信託報酬等（年率）	0.60%（毎月分配クラス）
申込手数料	ありません。

■費用の明細 (2015年7月1日～2016年6月30日)

項目	当期
	ユーロ
(a) 運用報酬	8,754,723
(b) 成功報酬	41,380
(c) 管理費用等	3,319,097
(d) その他の費用	1,200,800
合計	13,316,000

■純資産計算書 (2016年6月30日現在)

項目	当期末
	ユーロ
資産合計	1,284,731,386
有価証券	1,117,649,626
預金	121,781,349
未収利息	17,950,821
有価証券売却未収入金	15,436,256
未収追加設定金	321,561
為替予約取引評価勘定	9,453,232
スワップ取引評価勘定	2,138,541
負債合計	69,180,820
借入金	2
未払解約金	66,455,011
未払運用報酬	2,101,189
為替未払金	89
その他の負債	624,529
純資産	1,215,550,566

(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 (2016年6月30日現在)

(1) 債券

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	ALLIED IRISH BANKS PLC VAR 26/11/2025	EUR	300,000	286,292.09	イギリス	ANGLIAN WATER OSPREY FIN 7% 31/01/2018	GBP	200,000	263,789.13	
	ARDAGH PKG FIN/HLDGS 4.25% 15/01/2022	EUR	5,920,000	6,138,916.67		ANGLIAN WATER OSPREY FINANCE 5% 30/04/2023	GBP	800,000	982,714.55	
	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA 4.125% 15/05/2023	EUR	1,200,000	1,222,550.00		ANGLO AMERICAN 2.875% 20/11/2020	EUR	3,170,000	3,020,832.72	
	ARDAGH PKG/HLDGS USA 6.75% 15/05/2024	EUR	2,000,000	2,046,500.00		ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.5% 01/04/2020	EUR	4,130,000	3,761,342.28	
	EIRCOM FINANCE DAC 4.50% 31/05/2022	EUR	2,400,000	2,373,424.80		ARROW GLOBAL FINANCE 7.875% 01/03/2020	GBP	1,146,000	1,436,249.09	
	SMURFIT KAPPA ACQUISITIO 2.75% 01/02/2025	EUR	3,000,000	3,041,645.83		BAKKAVOR FINANCE 2 PLC 8.25% 15/02/2018	GBP	1,650,000	728,014.19	
	SMURFIT KAPPA ACQUISITION 3.25% 01/06/2021	EUR	1,950,000	2,069,974.66		BARCLAYS BANK PERP	GBP	5,000,000	7,314,562.45	
	THE GOVERNOR AND COMPANY OF THE BANK OF IRELAND TV 11/06/24	EUR	1,380,000	1,342,089.09		BARCLAYS PLC TF/TV PERPETUAL	EUR	3,890,000	3,469,562.32	
	アメリカ	BALL CORP 3.5% 15/12/20	EUR	2,100,000		2,297,643.19	BOPARAN FIN 5.25% 15/07/19	GBP	950,000	1,094,191.84
		BALL CORP 4.375% 15/12/2023	EUR	3,200,000		3,524,222.22	BOPARAN FINANCE 5.2% 15/07/2021	GBP	500,000	537,347.33
		CELANESE US 3.25% 15/10/19	EUR	1,300,000		1,375,427.08	BOPARAN FINANCE PLC 4.375% 15/07/2021	EUR	1,210,000	1,127,312.47
		CEMEX FINANCE LLC 4.625% 15/06/2024	EUR	1,400,000		1,374,541.78	DEBENHAMS PLC 5.25% 15/07/2021	GBP	200,000	233,802.66
		CEMEX FINANCE LLC 5.25% 01/04/2021	EUR	3,189,000		3,303,354.88	EPHIOS BONDCO 6.25% 01/07/2022	EUR	4,100,000	4,452,913.19
		FRESENIUS US FINANCE II INC 4.25% 01/02/2021	USD	850,000		817,303.20	EPHIOS HOLDCO II PLC 8.25% 01/07/2023	EUR	1,300,000	1,372,827.08
		HUNTSMAN INTERNATIONAL L 4.25% 01/04/2025	EUR	1,000,000		915,006.94	HSBC HOLDINGS TF/TV PERPETUAL	EUR	2,040,000	1,877,457.46
		HUNTSMAN INTERNATIONAL LLC 5.125% 15/04/2021	EUR	2,500,000		2,557,942.71	INEOS FINANCE PLC 4% 01/05/2023	EUR	2,550,000	2,462,319.67
IMX HEALTH INC 4.125% 01/04/2023		EUR	2,000,000	2,050,395.83	INNS ENT 6.50% 06/12/18 *GBP	GBP	707,000	894,089.61		
MPT OPER PARTINERSP / FINL 4% 19/08/2022		EUR	1,650,000	1,765,228.61	INOVYN FINANCE PLC 6.25% 15/05/2021	EUR	2,000,000	2,046,319.44		
MPT OPER PARTINERSP 5.75% 01/10/2020		EUR	805,000	855,888.30	INTERNATIONAL GAME TECH 4.125% 15/02/2020	EUR	4,800,000	5,078,250.00		
PSPC ESCROW CORP 6% 01/02/2023		EUR	1,350,000	1,174,275.00	INTERNATIONAL GAME TECH 4.75% 15/02/2023	EUR	6,870,000	7,232,821.88		
PVH CORP 3.625% 15/07/2024		EUR	2,300,000	2,343,053.57	IRON MOUNTAIN 6.125% 15/09/22	GBP	3,290,000	4,063,220.60		
SEALED AIR CORP 4.5% 15/09/2023		EUR	2,000,000	2,136,250.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMO 3.875% 01/03/2023	GBP	3,000,000	3,434,121.99		
US COAT ACQ / FLASH DUTCH 5.75% 01/02/21		EUR	900,000	953,872.75	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE 5% 15/02/2022	GBP	2,700,000	3,342,307.92		
VWR FUNDING INC 4.625% 15/04/2022		EUR	4,810,000	4,875,586.35	LLOYDS BANKING TF/TV PERPETUAL	GBP	406,000	462,729.41		
ZF NA CAPITAL 2.25% 26/04/2019	EUR	2,700,000	2,778,318.49	LLYODS BANKING GROUP TF/TV PERPETUAL	EUR	1,065,000	1,000,833.43			
ZF NA CAPITAL 2.75% 27/04/2023	EUR	5,500,000	5,671,720.55	LYNX I CORP 6% 15/04/2021	GBP	7,749,000	8,727,590.40			

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	LYNX II CORP 7% 15/04/23	GBP	6,500,000	8,091,921.87	イタリア	BANCO POPOLARE SC 2.75% 27/07/2020	EUR	3,640,000	3,748,806.98	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PL 2.75% 15/03/2022	EUR	1,400,000	1,369,229.17		BUZZI UNICEM 6.25% 28/09/2018	EUR	248,000	288,108.08	
	MOY PARK BONDCO PLC 6.25% 29/05/2021	GBP	1,740,000	2,094,536.53		BUZZI UNICEM SPA 2.125% 28/04/2023	EUR	800,000	798,754.25	
	NEW LOOK SECURED ISSUER 6.5% 01/07/2022	GBP	4,830,000	5,386,637.09		ENEL SPA TF/TV 10/01/2074	EUR	10,328,000	11,469,161.96	
	NEW LOOK SENIOR ISSUER PLC 8% 01/07/2023	GBP	700,000	739,125.20		ENEL SPA TF/TV 15/01/2075	EUR	2,500,000	2,686,810.52	
	OLD MUTUAL PLC 7.875% 03/11/2025	GBP	900,000	1,124,293.01		ENEL TF/TV 15/09/2076	GBP	3,600,000	4,645,843.90	
	OLD MUTUAL TF/TV PERPETUAL	GBP	886,000	1,020,788.76		FINMEC FINANCE SA 4.5% 19/01/2021	EUR	4,039,000	4,543,939.56	
	R&R ICE CREAM PLC 5.5% 15/05/2020	GBP	4,327,000	5,333,578.76		FINMECCANI 4.875% 24/03/2025 *EUR	EUR	2,000,000	2,315,682.08	
	REXAM TF/TV 29/06/67 *EUR	EUR	2,000,000	2,003,409.86		FINNECCANICA FINANCE 5.25% 21/01/2022	EUR	2,800,000	3,280,917.53	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND TF/TV 22/09/2021	EUR	4,000,000	4,099,220.98		INTESA SANPAOLO 5.15% 07/20	EUR	500,000	572,214.82	
	ROYAL BANK SCOTLAND GRP PLC TF/TV 25/03/2024	EUR	6,060,000	5,953,692.82		INTESA SANPAOLO SPA 6.625% 13/09/2023	EUR	9,700,000	11,736,099.65	
	ROYAL BANK TF/TV PERPETUAL	EUR	3,850,000	3,938,896.96		INTESA SANPAOLO SPA VAR 31/12/2049	EUR	6,500,000	7,034,850.27	
	SANTANDER UK GROUP 7.375% PERP 31/12/2049	GBP	760,000	854,004.28		INTESA SANPAOLO SPA VAR 31/12/2049 PERP	USD	700,000	566,736.03	
	TESCO 6.125% 24/02/22 *GBP	GBP	6,620,000	8,871,273.29		INTESA SANPAOLO SPA VAR PERP 31/12/2049	EUR	2,750,000	2,658,166.92	
	TESCO CORP TREASURY 2.5% 01/07/2024	EUR	1,200,000	1,200,881.63		INTESA SANPAOLO SPA VAR PERPETUAL	EUR	5,850,000	6,958,543.03	
	TESCO CORP TREASURY SERV 1.375% 01/07/2019	EUR	2,200,000	2,203,032.55		LKQ ITALIA BONDCO SPA 3.875% 01/04/2024	EUR	3,600,000	3,719,450.00	
	TESCO PLC 5% 24/0303/2023	GBP	2,500,000	3,138,420.24		SALINI COSTRUTTORI 6.125% 01/08/2018	EUR	700,000	803,106.37	
	THOMAS COOK 7.75% 15/06/2020	EUR	4,048,000	3,978,488.42		SNAI SPA 7.625% 15/06/2018	EUR	1,886,000	1,948,571.98	
	THOMAS COOK FINANCE PLC 6.75% 15/06/2021	EUR	1,500,000	1,391,718.75		TELE ITA 6.375% 24/06/19	GBP	550,000	729,025.77	
	TWINKLE PIZZA PLC 6.625% 01/08/2021	GBP	2,060,000	2,391,437.13		TELECOM ITALIA 5.875% 19/05/23	GBP	7,000,000	9,478,324.91	
	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 4.5% 15/01/2025	EUR	2,370,000	2,335,931.25		TELECOM ITALIA SPA 3.25% 16/01/2023	EUR	9,000,000	9,701,868.93	
	VIRGIN MEDIA SEC 5.5% 15/01/2025	GBP	800,000	870,886.23		TELECOM ITALIA SPA 3.625% 19/01/2024	EUR	2,350,000	2,538,538.34	
	VIRGIN MEDIA SECURED FIN 5.125% 15/01/2025	GBP	2,650,000	3,183,920.82		TELECOM ITALIA SPA 4% 21/01/2020	EUR	5,234,000	5,802,389.52	
	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE 6.25% 28/03/2029	GBP	1,420,000	1,723,454.76		TELECOM ITALIA SPA 4.5% 25/01/2021	EUR	2,600,000	2,994,022.92	
	VOUGEOT BIDCO 7.875% 15/07/2020	GBP	1,610,000	2,044,041.80		TELECOM ITALIA SPA 4.875% 25/09/2020	EUR	1,100,000	1,294,671.27	
	WILLIAM HILL PLC 4.25% 05/06/20	GBP	2,498,000	3,042,601.54		TELECOM ITALITA SPA 3.625% 25/05/2026	EUR	1,800,000	1,863,700.82	
	WILLIAM HILL PLC 4.875% 07/09/2023	GBP	1,250,000	1,477,600.75		UNICREDIT 6.95% 31/10/2022	EUR	6,258,000	7,316,749.98	
	イタリア	BANCO POPOLARE 3.5% 14/03/19	EUR	5,500,000		5,698,341.90	UNICREDIT SPA 6.125% 19/04/2021	EUR	2,350,000	2,673,865.70

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	
イタリア	UNICREDIT SPA TF/TV PERPETUEL	EUR	1,300,000	1,081,874.67	オランダ	PHOENIX PIB DUTCH FINANCE 3.625% 30/07/21	EUR	1,500,000	1,689,478.03
	UNICREDIT SPA TF-2020 / TV 28/10/2025	EUR	4,600,000	4,939,238.69		PHOENIX PIB DUTCH HOLDING 3.125% 27/05/2020	EUR	200,000	214,432.19
オーストリア	UNIPOLSAI TF/TV PERP	EUR	2,400,000	2,206,829.79	RABOBANK NEDERLAND 5.5% PERP	EUR	4,600,000	4,402,017.26	
	SAPPI PAPIER HOLDING GMBH 3.375% 01/04/2022	EUR	3,000,000	3,043,331.25	REPSOL INTL FINANCE PERP 31/12/2049	EUR	1,900,000	1,749,926.50	
	SAPPI PAPIER HOLDING GMBH 4.00% 01/04/2023	EUR	4,000,000	4,129,562.84	REPSOL INTL FINANCE VAR 25/03/2075	EUR	1,550,000	1,336,036.30	
オランダ	WIENERBER TF/TV PERP	EUR	500,000	532,809.29	SCHAEFFLER 5.75% 15/11/2021 PAY IN KIND	EUR	440,000	284,377.50	
	WIENERBERGER 4% 17/04/20	EUR	983,000	1,079,441.73	SCHAEFFLER FINANCE BV 3.25% 15/05/2019	EUR	5,169,000	5,254,611.56	
	ABN AMRO BANK NV PERP 31/12/2049	EUR	5,000,000	4,746,078.12	SCHAEFFLER FINANCE BV 3.25% 15/05/2025	EUR	2,850,000	2,950,341.38	
	CABLE COMM SYST NV 7.5% 01/11/2020	EUR	2,800,000	2,964,056.67	SCHAEFFLER FINANCE BV 3.5% 15/05/2022	EUR	2,903,000	2,984,211.43	
	COOPERATIVE RABOBANK UA VAR PERP 31/12/2049	EUR	400,000	403,880.40	SCHAEFFLER FINANCE BV 4.25% 15/05/2018	EUR	3,960,000	4,030,537.50	
	DARLING GLOBAL FINANCE 4.75% 30/05/2022	EUR	1,600,000	1,626,333.33	SCHAEFFLER HOLDING FINANCE BV 6.875% 15/08/2018	EUR	2,150,000	844,209.26	
	EDP FINANCE BV 5.25% 14/01/21	USD	1,550,000	1,521,940.16	SM MTH AUTO GRP 4.125% 15/07/2021	EUR	4,440,000	4,551,986.79	
	FRESENIUS 4% 01/02/2024	EUR	1,000,000	1,187,605.56	SNS BANK NV VAR 05/11/2025	EUR	2,300,000	2,318,021.07	
	GAS NATURAL FENOSA TF-2022 / TV PERPETUEL	EUR	4,400,000	4,440,570.67	TELEFONICA EUROP BV TF/TV PERPETUAL	EUR	7,000,000	8,167,234.67	
	GAS NATURAL FENOSA FINAN VAR 29/12/2049	EUR	500,000	448,697.60	TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	5,000,000	5,491,461.75	
	GENERALI FINANCE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	400,000	385,146.95	TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	2,000,000	2,039,595.51	
	GOODYEAR DUNLOP TIRES 3.75% 15/12/2023	EUR	1,600,000	1,657,348.00	TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	EUR	1,500,000	1,551,859.89	
	GRUPO ANTOLIN DUTCH BV 4.75% 01/04/2021	EUR	3,500,000	3,663,600.69	TELEFONICA EUROPE BV TF/TV PERPETUAL	GBP	2,800,000	3,554,608.48	
	GRUPO ANTOLIN DUTCH BV 5.125% 30/06/2022	EUR	3,040,000	3,169,200.00	UPC HOLDING BV 6.375% 15/09/2022	EUR	6,255,000	6,729,402.66	
	HERTZ HOLDGS NETHERLANDS 4.375% 15/01/19	EUR	1,520,000	1,588,479.17	UPC HOLDING BV 6.75% 15/03/23	EUR	4,662,000	5,085,950.63	
	ING BANK NV VAR 11/04/2028	EUR	500,000	512,212.01	ZIGGI SECURED FINANCE BV 3.75% 15/01/2025	EUR	3,000,000	2,976,531.25	
	ING GROEP NV 6% PERP 31/12/2049	USD	2,150,000	1,836,045.88	ZIGGO BOND FINANCE BV 4.625% 15/01/2025	EUR	1,700,000	1,655,286.46	
	KONINKLIJKE KPN VAR PERPETUAL	EUR	5,310,000	5,906,617.90	CSG GUERNSEY I LTD FRN 24/02/2041	USD	1,992,000	1,854,548.50	
	KONINKLIJKE TV 14/03/2073	GBP	1,100,000	1,393,570.43	カナダ	BOMBARDIER INC 6.125% 15/05/2021	EUR	2,131,000	2,147,315.47
	LGE HOLDCO VI 7.125% 15/05/2024	EUR	5,725,000	6,362,800.78	ENTERTAINMENT ONE LTD 6.875% 15/12/2022	GBP	1,170,000	1,467,555.57	
OI EUROPEAN GP 6.75% 15/09/2020	EUR	3,430,000	4,102,708.75	クロアチア	AGROKOR 9.125% 01/02/2020	EUR	4,100,000	4,508,129.23	
OI EUROPEAN GROUP BV 4.875% 31/03/2021	EUR	2,050,000	2,285,453.55						
PETROBRAS 3.75% 14/01/2021	EUR	1,600,000	1,429,910.58						
PETROBRAS GLOBAL FINANCE 3.25% 01/04/2019	EUR	3,750,000	3,522,583.87						

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	
ケイマン諸島	MEDI-PARTENAIRES 7% 15/05/20	EUR	3,583,000	3,757,671.25	ドイツ	COMMERZBANK AG 8.125% 19/09/23	USD	2,800,000	2,997,382.77
ジャージー	ASTON MARTIN 9.25% 15/07/18	GBP	970,000	1,216,682.46		DEUTSCHE RASTSTATTEN 6.75% 30/12/20	EUR	1,771,000	1,868,405.00
	AVIS BUDGE FINANCE PLC 6% 01/03/21	EUR	3,872,000	4,055,274.67		HEIDELBERGCEMENT AG 2.25% 30/03/2023	EUR	2,950,000	3,025,907.14
	HBOS CAP FUNDING TF/TV PERP	GBP	1,752,000	2,172,045.51		RWE AG VAR 21/04/2075	EUR	2,200,000	1,918,157.04
	LINCOLN FINANCE LTD 6.875% 15/04/2021	EUR	4,800,000	5,231,333.33		TECHEM ENERGY 7.875% 01/10/2020	EUR	3,416,000	3,653,305.25
	MERCURY BONDCO 8.25% 30/05/2021	EUR	4,700,000	4,677,322.50		TECHEM GMBH 6.125% 01/10/2019	EUR	2,021,000	2,132,563.97
	TVL FINANCE PLC 8.5% 15/05/2023	GBP	1,300,000	1,526,941.50		THYSENKRUPP AG 3.125% 25/10/2019	EUR	2,020,000	2,137,047.38
スイス	CREDIT SUISSE 5.75% 18/09/2025	EUR	1,580,000	1,748,130.48		THYSENKRUPP AG 2.5% 25/02/2025	EUR	1,600,000	1,567,828.09
	UBS GROUP AG PERP 31/12/2049	EUR	2,900,000	2,988,588.34		THYSENKRUPP AG 2.750% 08/03/2021	EUR	2,550,000	2,602,629.55
	UBS GROUP AG VAR PERP 31/12/2049	USD	1,300,000	1,170,118.48		THYSENKRUPP AG 4% 27/08/2018	EUR	4,346,000	4,709,591.58
スウェーデン	HOIST KREDIT AB 3.125% 09/12/2019	EUR	1,100,000	1,102,770.68		TRIONISTA HOLDGCO 30/04/20	EUR	1,736,000	1,791,696.67
	NORDEA BANK AB PERP 31/12/2049	USD	3,100,000	2,720,516.60		TRIONISTA TOPCO 6.875% 30/04/21	EUR	2,400,000	2,547,500.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB PERP 31/12/2049	USD	4,800,000	4,187,482.79		UNITY MEDIA KABELKW GMBH 3.75% 15/01/2027	EUR	6,250,000	5,826,171.88
	SWEBANK AB VAR 31/12/2049 PERP	USD	2,400,000	2,157,950.11		UNITYMEDIA 6.25% 15/01/29	EUR	3,780,000	4,294,631.25
	TVN FINANCE CORP 7.375% 15/12/2020	EUR	4,901,000	4,150,060.61		UNITYMEDIA HESSEN / NRW 4.625% 15/02/2026	EUR	400,000	421,609.72
	VERISURE HOLDING AB 6% 01/11/2022	EUR	5,600,000	6,016,266.67		UNITYMEDIA HESSEN 5.5% 15/09/2022	EUR	6,212,000	5,364,928.88
	VOLVO TREASURY AB VAR 10/03/2078	EUR	1,700,000	1,726,999.73		UNITYMEDIA HESSEN 5.625% 15/04/23	EUR	40,000.00	34,135.00
	VOLVO TREASURY AB VAR 10/06/2075	EUR	4,390,000	4,414,590.01		UNITYMEDIA HESSEN 5.75% 15/01/2023	EUR	4,739,000	4,150,414.66
スペイン	ALMIRALL SA 04/01/2021	EUR	189,000	198,736.34		UNITYMEDIA HESSEN NRW 4% 15/01/2025	EUR	3,190,000	3,265,836.94
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG VAR 31/12/2049 PERP	EUR	1,400,000	1,415,699.65		WEPA HYGIENEPRODUKTE GMB 3.75% 15/05/2024	EUR	1,500,000	1,505,738.75
	BANCO SANTANDER TF/TV PERP	EUR	400,000	341,484.22	日本	SOFTBANK CORP 4.625% 15/04/2020	EUR	1,286,000	1,407,701.15
	CAIXABANK TV 14/11/2023	EUR	2,400,000	2,555,369.17		SOFTBANK GROUP CORP 4% 30/07/2022	EUR	2,600,000	2,796,083.33
	CAMPOFRIO FOOD GROUP SA 3.375% 15/03/2022	EUR	3,500,000	3,561,655.13		SOFTBANK GROUP CORP 4.75% 30/07/2025	EUR	8,500,000	9,311,254.17
	CELLNEX TELECOM 3.125% 27/07/2022	EUR	1,000,000	1,051,444.67		SOFTBANK GROUP CORP 5.25% 30/07/2027	EUR	3,000,000	3,305,625.00
	EMPARK FUNDING SA 6.75% 15/12/2019	EUR	1,100,000	1,159,193.75	ノルウェー	LOCK AS 7% 15/08/2021	EUR	4,240,000	4,425,500.00
	ENCE ENERGIA Y CELULOSA 5.375% 01/11/2022	EUR	900,000	953,787.63		SILK BIDCO 7.5% 01/02/2022	EUR	1,670,000	1,740,627.08
	NH HOTELES SA 6.875% 15/11/2019	EUR	1,000,000	1,089,679.75	フィンランド	STORA ENSO 5.5% 07/03/2019	EUR	945,000	1,065,325.68
デンマーク	DANSKE BANK 5.875% PERP	EUR	4,660,000	4,661,790.03		STORA ENSO OYJ 2.125% 16/06/2023	EUR	1,250,000	1,250,156.34
	TDC A/S TF-2021/TV 26/02/3015	EUR	1,250,000	1,186,816.94	ブラジル	VALE 4.375% 24/03/18	EUR	1,500,000	1,552,221.86

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	
フランス	ACCOR SA TF-2020 / TV PERPETUAL	EUR	6,800,000	6,783,000.00	フランス	GROUPAMA SA TF/TV PERPETUAL	EUR	3,400,000	3,011,596.58
	AREVA 3.25% 04/09/2020	EUR	1,200,000	1,027,967.21		GROUPAMA TV 27/10/39	EUR	4,050,000	4,387,014.64
	AREVA 3.50% 22/03/2021	EUR	3,600,000	3,018,920.55		GROUPE SMCP SAS 8.875% 15/06/2020	EUR	3,107,000	3,367,778.71
	AREVA 4.875% 23/09/2024	EUR	2,050,000	1,754,447.97		HOLDIKKS SAS 6.75% 15/07/21	EUR	1,200,000	1,180,990.20
	AREVA SA 3.125% 20/03/2023	EUR	800,000	632,866.30		HOMEVI 6.875% 15/08/2021	EUR	6,400,000	6,941,640.00
	ARKEMA SA TV PERPETUAL	EUR	4,500,000	4,788,429.52		ITALCEMENTI MULTICPON 19/03/20	EUR	3,775,000	4,504,892.63
	BISOHO SAS 5.875% 01/05/2023	EUR	2,100,000	2,166,834.95		LA FINANCIERE ATALIAN SA 7.25% 15/01/2020	EUR	3,576,000	3,908,984.72
	BNP PARIBAS 6.125% PERP 31/12/2049	EUR	1,400,000	1,345,673.77		LABEYRIE FINE 5.625% 15/03/2021	EUR	4,184,000	4,420,003.75
	BNP PARIBAS TF/TV PERPETUAL	EUR	1,600,000	1,574,813.12		LOXAM SAS 3.5% 03/05/2023	EUR	1,400,000	1,418,258.33
	BPCE TF/TV PERP	EUR	800,000	872,624.00		LOXAM SAS 4.875% 23/07/2021	EUR	1,700,000	1,765,078.13
	BUT SAS 7.375% 15/09/2019	EUR	1,200,000	1,267,812.50		LOXAM SAS 7% 23/07/2022	EUR	800,000	854,333.33
	CASINO GUICARD PERRACHO 3.311 25/01/2023	EUR	1,500,000	1,628,182.39		NEXANS SA 3.25% 26/05/2021	EUR	1,000,000	1,015,420.44
	CASINO GUICHARD PERRACHO 2.33% 07/02/2025	EUR	2,400,000	2,393,023.71		NOVAFIVES SAS 4.5% 30/06/2021	EUR	570,000	519,056.25
	CASINO GUICHARD PERRACHON 2.798% 05/08/2026	EUR	3,000,000	3,147,896.61		NOVALIS SAS 3% 30/04/2022	EUR	8,700,000	8,663,216.40
	CASINO GUICHARD TF/TV PERP	EUR	1,400,000	1,316,128.91		NUMERICABLE 5.375% 15/05/2022	EUR	4,743,000	4,903,105.89
	CERBA EUROPEAN LAB 7% 01/02/20	EUR	5,551,000	5,908,885.31		NUMERICABLE GROUP SA 5.625% 15/05/2024	EUR	5,724,000	5,878,283.26
	CREDIT AGRICOLE ASSURNCES VAR 31/12/49	EUR	2,600,000	2,554,918.00		PAPREC HOLDING 5.25% 01/04/2022	EUR	5,333,000	5,442,215.40
	CREDIT AGRICOLE SA TF/TV PERPETUEL	USD	3,610,000	2,967,801.14		PEUGEOT SA 6.5% 18/01/2019	EUR	2,800,000	3,273,551.91
	CREDIT AGRICOLE SA VAR PERP 31/12/2049	USD	1,800,000	1,620,197.94		REXEL SA 3.25% 15/06/2022	EUR	3,870,000	3,894,590.63
	CREDIT AGRICOLE SA VAR PERPETUAL	EUR	3,000,000	3,655,081.97		REXEL SA 3.50% 15/06/2023	EUR	4,200,000	4,249,700.00
	CREDIT AGRICOLE TF/TV PERPETUAL	EUR	5,576,000	5,277,440.96		SG TF 8.875% 160618/TV PERP	GBP	1,718,000	2,229,801.12
	CREDIT MUTUEL ARKEA 3.25% 01/06/2026	EUR	900,000	925,264.97		SGD GROUP 5.625% 15/04/2019	EUR	712,000	729,933.50
	CROWN EURO HOLDINGS 4% 15/07/2022	EUR	5,250,000	5,674,375.00		SOCIETE GENERALE TF/TV PERPETUAL	EUR	4,450,000	5,681,956.97
	CROWN EURO HOLDINGS SA 3.375% 15/05/2025	EUR	3,250,000	3,260,785.93		SOCIETE GENERALE TF/TV PERPETUAL	EUR	5,023,000	4,841,377.38
	DARTY FIN 5.875% 01/03/21	EUR	2,903,000	3,105,978.16		SOGECAP SA VAR 29/12/2049	EUR	2,100,000	1,990,927.99
	EUROPCAR GROUPE SA 5.75% 15/06/2022	EUR	3,100,000	3,217,477.08		SOLVAY FINANCE TF-2019/TV PERP	EUR	2,118,000	2,158,095.89
	EUROPCAR GROUPE SA 5.75% 15/06/2022	EUR	900,000	934,106.25		SOLVAY FINANCE TV PERPETUAL	EUR	3,000,000	3,173,534.26
	FAURECIA 3.125% 15/06/2022	EUR	6,200,000	6,223,572.92		SOLVAY FINANCE VAR 31/12/2049 PERP	EUR	2,080,000	2,151,198.68
	FAURECIA 3.625% 15/06/2023	EUR	1,000,000	1,012,610.42					

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	SOLVAY FINANCE VAR 31/12/2049 PERP	EUR	2,000,000	2,091,044.90	ルクセンブルク	DUFREY FINANCE SCA 4.5% 01/08/2023	EUR	3,000,000	3,183,375.00
	SPCM SA 2.875% 15/06/2023	EUR	5,450,000	5,238,528.64		DUFREY FINANCE SCA 4.5% 15/07/2022	EUR	5,070,000	5,389,268.04
	TEREOS FINANCE GROUPE I 4.125% 16/06/2023	EUR	1,400,000	1,394,804.87		FIAT FINANCE & TRADE 4.75% 15/07/2022	EUR	8,000,000	8,936,426.23
	THOM EUROPE SAS 7.375% 15/07/2019	EUR	3,010,000	3,244,184.27		FIAT FINANCE & TRADE 6.75% 14/10/2019	EUR	8,827,000	10,343,044.49
	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN PERPETUAL	GBP	1,500,000	1,863,820.62		FIAT FINANCE & TRADE LTD SA 7.375% 08/07/2018	EUR	3,248,000	3,791,852.91
	VEOLIA ENVIRONNEMENT TF/TV PERPETUAL	EUR	2,500,000	2,643,014.59		FIAT FINANCE AND TRADE LTD S.A 4.75% 22/03/2021	EUR	2,500,000	2,718,909.25
	ベルギー	KBC GROEP NV TF/TV PERPETUAL	EUR	5,960,000		5,665,150.23	FIAT FINANCE&TRADE 6.625% 15/03/2018	EUR	3,800,000
ONTEX GROUP 4.75% 15/11/2021		EUR	1,500,000	1,598,156.25	FMC FIN 7 5.25% 15/02/21 *EUR	EUR	3,225,000	3,830,292.19	
ポルトガル	ENERGIAS DE PORTUGAL SA VAR 16/09/2075	EUR	3,800,000	3,828,080.44	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA 7.5% 01/08/2022	EUR	500,000	505,020.83	
メキシコ	CEMEX SAB DE CV 4.375% 05/03/2023	EUR	1,500,000	1,477,313.54	GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA 8.5% 01/11/2022	GBP	2,700,000	3,118,395.40	
	CEMEX SAB DE CV 4.75% 11/01/2022	EUR	2,600,000	2,657,976.39	GAZ CAPITA 6.605% 02/18 *EUR	EUR	2,609,000	2,876,172.29	
ルクセンブルク	CEMEX SAB DE CV 6.125% 05/05/2025	USD	400,000	354,679.38	GAZPROM 3.389% LPN 20/03/20	EUR	800,000	834,648.50	
	ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA 8.75% 01/11/19	EUR	2,062,000	2,208,175.75	GAZPROM CAPITAL 3.7% 25/07/2018	EUR	2,000,000	2,146,545.36	
	ALTICE FINANCING SA 5.25% 15/02/2023	EUR	3,000,000	3,061,437.50	GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA 3.755% 15/03/2017	EUR	2,500,000	2,572,519.52	
	ALTICE FINANCING SA 6.5% 15/01/2022	EUR	2,700,000	2,915,437.50	GESTAMP FUND LUX SA 3.50% 15/05/2023	EUR	3,200,000	3,273,324.44	
	ALTICE SA 7.25% 15/05/2022	EUR	10,135,000	10,473,889.06	HANESBRANDS FINANCE LUX 3.50% 15/06/2024	EUR	2,600,000	2,619,825.00	
	ARCELORMITTAL 2.875% 06/07/2020	EUR	400,000	409,311.48	HEIDELBERGCEMENT 7.50% 03/04/20	EUR	5,000,000	6,228,125.00	
	ARCELORMITTAL 3% 09/04/2021	EUR	4,000,000	3,925,754.90	INEOS GROUP HOLDINGS SA 5.75% 15/02/2019	EUR	2,366,000	2,422,931.88	
	ARDAGH FINANCIAL HOLDINGS SA 8.375% PIK 15/06/2019	EUR	452,687	461,736.02	INEOS GRP 6.5% 15/08/2018	EUR	2,000,000	2,073,750.00	
	BMBG BOND FINANCE SCA 3.00% 15/06/2021	EUR	2,300,000	2,280,545.47	MATTERHORN TELECOM SA 3.875% 01/05/2022	EUR	7,450,000	7,215,851.67	
	CIRSA FUNDING LUXEMBOURG 5.75% 15/05/2021	EUR	1,500,000	1,551,093.75	MATTHORN TEL HLD 4.875% 01/05/2018	EUR	1,250,000	1,170,924.48	
	CIRSA FUNDING LUXEMBOURG 5.875% 15/05/2023	EUR	2,200,000	2,228,256.25	ONEX WIZARD AC II 7.75% 15/02/2023	EUR	1,300,000	1,406,551.25	
	CNH 2.875% 27/09/2021	EUR	1,540,000	1,608,158.67	PICARD BONDCO 7.75% 01/02/2020	EUR	5,700,000	6,196,335.42	
	CNH INDUSTRIAL FIN EUR 6.25% 09/03/2018	EUR	2,835,000	3,109,000.81	PLAY FINANCE 2 5.25% 01/02/2019	EUR	4,200,000	4,386,098.50	
	CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 2.875% 17/05/2023	EUR	3,100,000	3,110,743.84	PLAY FINANCE 2 SA 6.5% 01/08/2019	EUR	2,600,000	2,754,447.22	
	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 2.75% 18/03/2019	EUR	2,300,000	2,375,521.92	PLAY TOPCO 7.75% 28/02/20	EUR	1,900,000	1,980,842.36	
	CONVATEC HEALTHCARE 10.875% 15/12/18	EUR	1,000,000	1,031,731.25					

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
ルクセンブルク	SES SA VAR PERP 31/12/2049	EUR	1,000,000	994,584.25
	TELENET FIN 6.75% 15/08/2024	EUR	2,895,000	3,250,542.19
	TELENET FINANCE V 6.25% 15/08/2022	EUR	2,925,000	3,190,992.19
	UNICREDITO LUXEMB 6% 31/10/17	USD	1,000,000	942,049.60

銘柄		通貨	額面金額	ユーロ 換算評価額
ルクセンブルク	UNICREDITO TF/TV PERP	EUR	7,410,000	8,258,089.73
	WIND ACQUISITION FIN 7% 23/04/2021	EUR	9,338,000	9,226,203.39
	WIND ACQUISITION FIN SA 4% 15/07/2020	EUR	10,200,000	10,234,000.00

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

(2) 投資証券

銘柄		口数	通貨	ユーロ換算評価額
フランス	Amundi 3 M FCP	6,892	EUR	7,306,980.54
	AMUNDI CASH INST SRI I C	280,399	EUR	61,708,491.84
	AMUNDI TRESO COURT TERME PART I C	1,742,355	EUR	32,846,163.14
ルクセンブルク	AMUNDI FDS-BD EURO H.YLD SH.TERM OE CAP	1,479,418	EUR	1,590,359.56
	AMUNDI FUNDS BOND GLOBAL HYBRID IE CAP FCP	30,000,000	EUR	3,043,800.00
	STRUCTURA GLOBAL MARCO MULTI CREDIT EUR SICAV	9,850,000	EUR	10,089,847.50

(注) 通貨欄の表記は以下の通りです。
EUR (ユーロ)