

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成22年6月30日

【発行者名】 F I L ・インベストメント・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ
（FIL Investment Management (Luxembourg) S.A.）

【代表者の役職氏名】 取締役 マルク・ワセレット
（Marc Wathelet）

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国 ルクセンブルグ L - 1246、アルバート・ボルシェット通り 2 a
（2a, rue Albert Borschette, L-1246 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg）

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 中野 春芽

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 中野 春芽
弁護士 橋本 雅行

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03（6212）8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 フィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ -
米ドル・マンスリー・インカム
（Fidelity Global Bond Series - US Dollar Monthly Income）

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】 クラスA 受益証券 100億アメリカ合衆国ドル（約9,407億円）を上限とする。
クラスB 受益証券 100億アメリカ合衆国ドル（約9,407億円）を上限とする。
（注）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、便宜上、平成22年4月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=94.07円）による。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成22年6月30日付をもって半期報告書を提出いたしましたので、平成22年3月31日付をもって提出した有価証券届出書（平成（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また原届出書に訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

（注）_____の部分は訂正部分を示します。ただし、全文訂正の場合は下線を付しておりません。

2 【訂正の内容】

（1）半期報告書に係る訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書	半期報告書	訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況 (1) 投資状況 (3) 運用実績	1 ファンドの運用状況 (1) 投資状況 (2) 運用実績	更新または追加
第2 財務ハイライト情報	2 ファンドの経理状況 (1) 資産及び負債の状況 「純資産計算書」 「重要な会計方針」の注記	追加
第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況 1 財務諸表	2 ファンドの経理状況	追加
第5 販売及び買戻しの実績	3 販売及び買戻しの実績	追加
第四部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況 (1) 資本金の額	4 管理会社の概況 (1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況	(2) 事業の内容及び営業の状況	更新
5 その他	(3) その他	追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。（半期報告書「5 管理会社の経理の概況」は、原届出書に対する訂正に該当しないため省略します。）

1 ファンドの運用状況

F I L ・ インベストメント ・ マネジメント (ルクセンブルグ) エス ・ エイ (FIL Investment Management (Luxembourg) S.A.) (以下「管理会社」という。)により管理されるフィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ (Fidelity Global Bond Series) (以下「ファンド」という。)のサブ・ファンドであるフィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ - 米ドル・マンスリー・インカム (Fidelity Global Bond Series - US Dollar Monthly Income) (以下「サブ・ファンド」という。)の運用状況は以下のとおりである。

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(平成22年4月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	アメリカ合衆国	153,240,563.18	59.48
	イタリア	9,579,065.05	3.72
	カナダ	9,361,842.18	3.63
	ドイツ	9,027,180.87	3.50
	英国	8,645,508.25	3.36
	アルゼンチン	8,200,234.89	3.18
	ベネズエラ	5,067,660.15	1.97
	バミューダ	4,181,585.09	1.62
	オランダ	3,288,202.18	1.28
	フランス	2,574,413.51	1.00
	トルコ	2,474,759.85	0.96
	ロシア	2,445,804.12	0.95
	ルクセンブルグ	2,362,190.24	0.92
	メキシコ	1,992,377.47	0.77
	フィリピン	1,588,755.18	0.62
	日本	1,570,154.89	0.61
	インドネシア	1,358,774.60	0.53
	エジプト	1,304,423.14	0.51
	コロンビア	1,245,533.52	0.48
	ブラジル	1,131,404.85	0.44
	ケイマン諸島	859,708.04	0.33
	ベトナム	802,603.54	0.31
	ウルグアイ	619,512.00	0.24
	オーストラリア	494,537.50	0.19
	エルサルバドル	482,250.00	0.19
	コンゴ	479,370.00	0.19
	セルビア	429,957.00	0.17
	イラク	417,500.00	0.16
ドミニカ共和国	395,362.55	0.15	
アイルランド	344,269.91	0.13	
ウクライナ	323,560.00	0.13	

資産の種類	国名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
	パキスタン	286,000.00	0.11
	マーシャル諸島	278,187.50	0.11
	カザフスタン	213,000.00	0.08
	スリランカ	211,182.00	0.08
	ギリシャ	159,983.91	0.06
	ガーナ	144,170.00	0.06
	リベリア	125,737.50	0.05
	リトアニア	108,725.00	0.04
	アラブ首長国連邦	103,087.00	0.04
	インド	102,042.93	0.04
	南アフリカ	101,902.00	0.04
	カタール	94,250.00	0.04
	スペイン	81,882.18	0.03
	スイス	67,464.93	0.03
	債券小計	238,366,678.70	92.52
	現金およびその他の資産 (負債控除後)	19,277,170.63	7.48
	合計 (純資産総額)	257,643,849.33 (24,237百万円)	100.00

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいう。以下同じ。

(注2) アメリカ合衆国ドル (以下「米ドル」という。) の円貨換算は、便宜上、平成22年4月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1米ドル = 94.07円) による。以下、別段の表示がない限り、米ドルの金額表示はすべてこれによる。

(注3) ファンドおよびサブ・ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、ファンド証券は米ドル建のため、本書の金額表示は別段の記載がない限りサブ・ファンドの基準通貨である米ドル貨をもって行う。

(注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうち、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一の情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

(2) 運用実績

純資産の推移

平成22年4月末日および同月前1年間における各月末の純資産の推移は以下のとおりである。

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	円	米ドル	円
平成21年5月末日	169,519,461.81	15,946,695,772	クラス A 9.50 クラス B 9.50	894 894
6月末日	174,430,405.11	16,408,668,209	クラス A 9.63 クラス B 9.63	906 906
7月末日	179,135,406.62	16,851,267,701	クラス A 9.98 クラス B 9.98	939 939
8月末日	186,938,072.33	17,585,264,464	クラス A 10.09 クラス B 10.09	949 949
9月末日	207,548,717.93	19,524,107,896	クラス A 10.40 クラス B 10.40	978 978
10月末日	213,014,363.82	20,038,261,205	クラス A 10.41 クラス B 10.41	979 979
11月末日	224,408,849.16	21,110,140,440	クラス A 10.52 クラス B 10.52	990 990
12月末日	233,757,101.32	21,989,530,521	クラス A 10.49 クラス B 10.48	987 986
平成22年1月末日	237,281,487.95	22,321,069,571	クラス A 10.52 クラス B 10.51	990 989
2月末日	242,961,587.12	22,855,396,500	クラス A 10.49 クラス B 10.49	987 987
3月末日	252,239,999.94	23,728,216,794	クラス A 10.61 クラス B 10.60	998 997
4月末日	257,643,849.33	24,236,556,906	クラス A 10.69 クラス B 10.68	1,006 1,005

分配の推移

平成22年4月末日前1年間における分配の推移は以下のとおりである。

	1口当たり分配金額				分配落日
	クラスA		クラスB		
	米ドル	円	米ドル	円	
平成21年5月	0.0305	2.87	0.0272	2.56	平成21年5月1日
6月	0.0384	3.61	0.0345	3.25	平成21年6月1日
7月	0.0351	3.30	0.0322	3.03	平成21年7月1日
8月	0.0363	3.41	0.0334	3.14	平成21年8月3日
9月	0.0400	3.76	0.0380	3.57	平成21年9月1日
10月	0.0441	4.15	0.0399	3.75	平成21年10月1日
11月	0.0344	3.24	0.0301	2.83	平成21年11月2日
12月	0.0383	3.60	0.0341	3.21	平成21年12月1日
平成22年1月	0.0405	3.81	0.0361	3.40	平成22年1月4日
2月	0.0355	3.34	0.0311	2.93	平成22年2月1日
3月	0.0351	3.30	0.0311	2.93	平成22年3月1日
4月	0.0441	4.15	0.0396	3.73	平成22年4月1日

収益率の推移

平成22年4月末日前1年間における収益率は以下のとおりである。

	収益率（注）
クラスA	21.19%
クラスB	20.64%

（注）収益率（%）= $100 \times (a - b) / b$

a = 平成22年4月末日の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計額を加えた額）

b = 当該期間の直前の日（平成21年4月末日）の1口当たり純資産価格（分配落の額）

2 ファンドの経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける諸法令および一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ファンドの中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、平成22年4月30日現在における株式会社三菱東京U F J銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=94.07円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

フィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ

純資産計算書

2010年3月31日現在

フィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ -
米ドル・マンスリー・インカム

	(米ドル)	(千円)
資産		
投資有価証券 時価評価額	231,536,627	21,780,651
銀行預金	16,862,365	1,586,243
投資有価証券売却未収金	2,153,407	202,571
受益証券発行未収金	2,715,605	255,457
未収利息	3,643,381	342,733
為替先渡契約未実現利益	28,336	2,666
資産合計	256,939,721	24,170,320
負債		
投資有価証券購入未払金	4,239,324	398,793
未払費用	376,070	35,377
先物未実現損失	6,475	609
為替先渡契約未実現損失	76,914	7,235
その他の未払金	938	88
負債合計	4,699,721	442,103
純資産 2010年3月31日現在	252,240,000	23,728,217
純資産 2009年9月30日現在	207,548,718	19,524,108
純資産 2008年9月30日現在	153,332,828	14,424,019
純資産 2007年9月30日現在	133,121,142	12,522,706
受益証券発行残高、2010年3月31日現在		
- クラスA 受益証券 (ファンド通貨)	6,024,710口	
- クラスB 受益証券 (ファンド通貨)	17,763,120口	
受益証券1口当たり純資産価格、2010年3月31日現在		
- クラスA 受益証券 (ファンド通貨)	10.61米ドル	998円
- クラスB 受益証券 (ファンド通貨)	10.60米ドル	997円
受益証券1口当たり純資産価格、2009年9月30日現在		
- クラスA 受益証券 (ファンド通貨)	10.40米ドル	978円
- クラスB 受益証券 (ファンド通貨)	10.40米ドル	978円
受益証券1口当たり純資産価格、2008年9月30日現在		
- クラスA 受益証券 (ファンド通貨)	9.60米ドル	903円
- クラスB 受益証券 (ファンド通貨)	9.60米ドル	903円
受益証券1口当たり純資産価格、2007年9月30日現在		
- クラスA 受益証券 (ファンド通貨)	10.17米ドル	957円
- クラスB 受益証券 (ファンド通貨)	10.16米ドル	956円

添付の財務書類に対する注記は、当財務書類の一部である。

フィデリティ ・ グローバル ・ ボンド ・ シリーズ

財務書類に対する注記

2010年3月31日

1. 一般事項

ファンドは、非法人形態の証券共有持分としてルクセンブルグ大公国の法律に基づき設定されたミューチュアル・インベストメント・ファンド (Fonds Commun de Placement) である。ファンドは、ルクセンブルグ大公国の法律に基づき設立され、ルクセンブルグに登記上の事務所を有している F I L ・ インベストメント ・ マネジメント (ルクセンブルグ) エス ・ エイ (「管理会社」) によって、共同所有者 (「受益者」) の利益のために管理運用されている。ファンドは、ルクセンブルグの2002年12月20日の投資信託に関する法律のパート に基づき登録されている。

本書におけるファンドへの言及は、文脈上適切な場合、ファンドのために行為する管理会社を意味するものとする。

2010年3月31日現在、ファンドは一つのサブ・ファンド、すなわちフィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ - ミドル・マンスリー・インカム (「サブ・ファンド」) から構成されていた。

2. 重要な会計方針

財務書類は、ルクセンブルグの投資信託に関する法令上の要件に準拠して作成されている。

有価証券評価 - 証券取引所で取引される有価証券への投資は、かかる証券が取引されている主要な証券取引所において評価が行われる時点で入手可能な直近の価格で評価されるものとする。店頭市場で取扱われる有価証券も、同様に評価される。規制された証券取引所で取引されない短期債務譲渡可能証券および短期金融商品の評価は、償却原価法により決定される。この方法に従って、償却原価は、原初原価で証券を評価し、その後満期まで定率で額面価額に対してディスカウントを付加する (またはプレミアムを償却する) ことによって算定される。その他の資産はすべて、管理会社の取締役が適切と判断する方法で評価される。サブ・ファンドの投資明細表に明記される場合を除き、ファンドが保有するものはすべて、公認の証券取引所またはその他の規制ある市場で値が付けられるものである。

公正価額調整方針 - 公正価額調整は、マーケット・タイミング取引に対してファンドの受益者の利益を保護するために行われる場合がある。したがって、サブ・ファンドが評価される時に取引が閉鎖されている市場にサブ・ファンドが投資する場合、取締役は、市場が不安定な期間中、有価証券評価に基づく上記規定から逸脱して、評価時点のサブ・ファンドの投資有価証券の公正価額をより正確に反映するための調整を特定ポートフォリオに含まれる証券について行うことができる。2010年3月31日現在、サブ・ファンドは実質的に公正価額調整を行っていない。

銀行預金 - 銀行預金はすべて、額面価額で計上されている。

投資有価証券取引 - 投資有価証券取引は、有価証券を購入もしくは売却した日に会計処理される。有価証券の売却原価の計算は、平均原価に基づいて行われる。

為替先渡契約 - 為替先渡契約は、クロージングの日付現在の実勢為替先渡レートに基づき評価され、満期までの残存期間に適用される。為替先渡契約による未実現損益は、純資産計算書および投資明細表に含まれている。

外国為替 - ファンドの指定通貨は米ドルである。2010年3月31日現在の資産および負債は、当該日の実勢為替レートで換算されている。管理会社の取締役により各サブ・ファンドの指定通貨が決定される。当期中の外貨建取引はすべて、取引日の実勢為替レートでサブ・ファンドの指定通貨に換算される。

エスクロー対象の有価証券 - 投資明細表に含まれている有価証券は、オープン・ポジションのデリバティブに対して担保として利用できる。この場合には、有価証券は取引されないようにエスクローの対象とされる。

ファンド受益証券取引 - サブ・ファンドの受益証券1口当たりの発行価格および買戻価格は、取引日の受益証券1口当たり純資産価格である。

創立費 - ファンドの創立費は、設定から5年以内の期間にわたりファンドの資産に請求される。

収益 - 利息は、発生基準で会計処理される。

3. 管理会社またはその関連会社との取引

管理会社ならびにその株式保有会社である F I L (ルクセンブルグ) エス ・ エイ および F I L ・ リミテッドは、ファンドに対して管理事務サービス、評価、記録保持または投資運用等の一定のサービスを提供している。

投資運用会社により提供される業務に関して、管理会社は、サブ・ファンドの通貨で日々計算され発生する運用報酬を、ファンドの資産から投資運用会社に対して支払う。サブ・ファンドの純資産額の1.00%の現在適用されている年間運用報酬に加えて、0.02%の代行協会員報酬が適用されている。

クラス B 受益証券には、当該クラスの純資産価額の1.00%を上限とする年間販売報酬が課せられる。当該報酬は日々発生し、総販売会社に対して毎月支払われる。

4. 税金

ファンドは、利益もしくは実現・未実現キャピタル・ゲインに対していかなるルクセンブルグの税金も、またはいかなるルクセンブルグの源泉徴収税も課せられない。サブ・ファンドは、各歴四半期の最終日のサブ・ファンドの純資産に対し四半期毎に計算され支払われる、その純資産の0.05%の年次税を課せられる。

キャピタル・ゲインおよび利息に関して、それらの発生国で源泉徴収されることがあり、かかる税金はファンドや受益者によって回収不能である。

5. 投資変動明細表

当期中に発生した各投資対象の購入合計額および売却合計額を詳述する一覧表は、管理会社の登記上の事務所またはファンドの販売会社として登録されている会社から無料で入手可能である。

6. 分配金支払

2010年3月31日に終了した期間中に、以下の分配金支払が行われた。

サブ・ファンド名	通貨	1口当たり分配金	分配落日
フィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ - 米ドル・マンスリー・インカム			
クラスA 受益証券	米ドル	0.0441	2009年10月1日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0399	2009年10月1日
クラスA 受益証券	米ドル	0.0344	2009年11月2日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0301	2009年11月2日
クラスA 受益証券	米ドル	0.0383	2009年12月1日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0341	2009年12月1日
クラスA 受益証券	米ドル	0.0405	2010年1月4日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0361	2010年1月4日
クラスA 受益証券	米ドル	0.0355	2010年2月1日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0311	2010年2月1日
クラスA 受益証券	米ドル	0.0351	2010年3月1日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0311	2010年3月1日

7. 為替レート

2010年3月31日現在の資産および負債の米ドル (USD) への換算に用いられた為替レートは、以下のとおりであった。

通貨	為替レート	通貨	為替レート
カナダ・ドル (CAD)	1.0156	日本円 (JPY)	93.395
エジプト・ポンド (EGP)	5.506	メキシコ・ペソ (MXN)	12.30455
ユーロ (EUR)	0.739536	英ポンド (GBP)	0.65887
ガーナ・セディ (GHS)	1.42075	ザンビア・クワチャ (ZMK)	4,690

8. 後発事象

2010年3月31日に終了した期間後に、以下の分配金支払が行われた。

サブ・ファンド名	通貨	1口当たり分配金	分配落日
フィデリティ・グローバル・ボンド・シリーズ - 米ドル・マンスリー・インカム			
クラスA 受益証券	米ドル	0.0441	2010年4月1日
クラスB 受益証券	米ドル	0.0396	2010年4月1日

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

フィデリティ ・ グローバル ・ ボンド ・ シリーズ

投資明細表

2010年3月31日現在

フィデリティ ・ グローバル ・ ボンド ・ シリーズ - 米ドル ・ マンスリー ・ インカム

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所またはその他の規制ある市場で取引される証券					
US Treasury 1.375% 15/01/2013	US	USD	7,833,000	7,804,253	3.09
Argentina 7.00% 28/03/2011	AR	USD	6,040,000	5,949,400	2.36
Canada 1.25% 01/12/2011	CA	CAD	4,590,000	4,495,407	1.78
US Treasury 3.125% 31/10/2016	US	USD	4,262,000	4,244,519	1.68
US Treasury 1.375% 15/02/2013	US	USD	4,178,000	4,156,776	1.65
US Treasury 0.875% 31/01/2012	US	USD	4,112,000	4,104,611	1.63
Germany 1.00% 16/03/2012	DE	EUR	2,650,000	3,585,257	1.42
Germany 3.25% 04/01/2020**	DE	EUR	2,595,000	3,552,622	1.41
United Kingdom Gilt 4.75% 07/03/2020	GB	GBP	2,200,000	3,545,358	1.41
US Treasury 3.125% 31/01/2017	US	USD	2,975,000	2,951,765	1.17
US Treasury 6.25% 15/08/2023	US	USD	2,295,000	2,752,207	1.09
Venezuela 1.249% FRN 20/04/2011 Reg S	VE	USD	2,490,000	2,308,230	0.92
US Treasury 2.50% 31/03/2015	US	USD	2,192,000	2,184,810	0.87
European Investment Bank 1.25% 20/09/2012	99	JPY	196,200,000	2,154,534	0.85
US Treasury 3.125% 30/09/2013	US	USD	1,930,000	2,011,497	0.80
France 3.50% 25/04/2020	FR	EUR	1,450,000	1,972,631	0.78
US Treasury 5.125% 15/05/2016	US	USD	1,639,000	1,838,433	0.73
US Treasury 4.25% 15/05/2039	US	USD	1,842,000	1,701,979	0.67
Argentina 7.00% 12/09/2013	AR	USD	1,765,000	1,565,790	0.62
Germany 3.75% 04/01/2015**	DE	EUR	1,050,000	1,524,473	0.60
US Treasury 1.00% 31/07/2011	US	USD	1,500,000	1,507,324	0.60
Sprint Capital 6.90% 01/05/2019	US	USD	1,635,000	1,498,069	0.59
US Treasury 2.75% 30/11/2016	US	USD	1,520,000	1,476,953	0.59
Russia Foreign Bond 7.50% 31/03/2030 Reg S	RU	USD	1,260,400	1,452,170	0.58
European Investment Bank 1.40% 20/06/2017	99	JPY	125,000,000	1,366,240	0.54
United Kingdom Gilt 4.50% 07/09/2034**	GB	GBP	900,000	1,361,581	0.54
US Treasury 1.375% 15/05/2012	US	USD	1,343,000	1,350,974	0.54
Citibank 1.875% 07/05/2012	US	USD	1,250,000	1,267,768	0.50
Italy 5.00% 01/09/2040	IT	EUR	900,000	1,263,507	0.50
US Treasury 2.625% 30/06/2014	US	USD	1,200,000	1,217,297	0.48
Time Warner Cable 8.25% 01/04/2019	US	USD	1,000,000	1,204,967	0.48
Italy 4.00% 01/09/2020	IT	EUR	850,000	1,154,875	0.46
US Treasury 0.875% 31/03/2011	US	USD	1,140,000	1,144,676	0.45
Canada 5.00% 01/06/2037	CA	CAD	1,000,000	1,134,305	0.45
US Treasury 3.125% 15/05/2019	US	USD	1,171,000	1,114,691	0.44
MGM Mirage 13.00% 15/11/2013	US	USD	900,000	1,050,750	0.42

** 財務書類に対する注記に記述されているように期末日現在全部または一部がエスクローの対象となっている証券。

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
US Treasury 2.375% 30/09/2014	US	USD	1,000,000	999,961	0.40
US Treasury 0.875% 29/02/2012	US	USD	1,000,000	997,148	0.40
Freddie Mac 1.625% 15/04/2013	US	USD	1,000,000	994,803	0.39
Development Bank Japan 2.30% 19/03/2026	JP	JPY	90,000,000	992,269	0.39
US Treasury 2.625% 30/04/2016	US	USD	1,008,000	986,029	0.39
US Treasury 2.625% 31/07/2014	US	USD	935,000	947,345	0.38
GMAC 8.00% 31/12/2018	US	USD	970,000	945,750	0.37
US Treasury 4.375% 15/11/2039	US	USD	1,000,000	942,852	0.37
CSFB (EXIM Ukraine) 7.65% 07/09/2011 Reg S	GB	USD	940,000	933,890	0.37
HCA 8.75% 01/09/2010	US	USD	910,000	928,200	0.37
Energy Future Holdings 10.875% 01/11/2017	US	USD	1,240,000	917,600	0.36
Avaya 10.125% 01/11/2015	US	USD	969,000	886,332	0.35
HCA 9.25% 15/11/2016	US	USD	815,000	872,050	0.35
Germany 4.75% 04/07/2040	DE	EUR	550,000	864,707	0.34
Intelsat Jackson Holdings 9.50% 15/06/2016	BM	USD	790,000	843,325	0.33
GMAC 7.50% 31/12/2013	US	USD	825,000	837,375	0.33
US Treasury 8.75% 15/05/2020	US	USD	584,000	822,413	0.33
Ford Motor Credit 8.125% 15/01/2020	US	USD	785,000	821,169	0.33
Calpine Construction 8.00% 01/06/2016 144A	US	USD	790,000	813,700	0.32
Cengage Learn Acquisitions 10.50% 15/01/2015 Reg S	US	USD	855,000	810,112	0.32
ServiceMaster Company 10.75% 15/07/2015 144A	US	USD	745,000	778,525	0.31
Italy 3.50% 01/06/2014	IT	EUR	550,000	776,018	0.31
Egypt 9.45% 03/08/2010	EG	EGP	4,250,000	747,694	0.30
US Treasury 4.00% 15/08/2018	US	USD	723,000	744,182	0.30
Charter Communications 8.00% 30/04/2012 144A	US	USD	700,000	742,840	0.29
NRG Energy 7.375% 01/02/2016	US	USD	740,000	740,000	0.29
Realogy 10.50% 15/04/2014	US	USD	855,000	739,575	0.29
US Treasury 4.375% 15/08/2012	US	USD	682,000	732,377	0.29
Venezuela 7.00% 31/03/2038 Reg S	VE	USD	1,240,000	725,400	0.29
Charter Communications 8.375% 30/04/2014 144A	US	USD	685,000	703,838	0.28
Kazakhstan Temir Zholy Finance 6.50% 11/05/2011	NL	USD	690,000	702,386	0.28
GMAC 8.00% 01/11/2031	US	USD	716,000	683,780	0.27
Rite Aid 10.375% 15/07/2016	US	USD	635,000	681,831	0.27
Clearwire A 12.00% 01/12/2015 144A	US	USD	650,000	667,030	0.26
Digicel Group 8.875% 15/01/2015 144A	BM	USD	675,000	663,188	0.26
Venezuela 8.25% 13/10/2024 Reg S	VE	USD	950,000	657,875	0.26
Citigroup Funding 1.875% 22/10/2012	US	USD	650,000	655,037	0.26
Ford Motor Credit 8.00% 15/12/2016	US	USD	625,000	653,409	0.26
Italy 4.25% 01/08/2013	IT	EUR	450,000	652,193	0.26
Canada 3.75% 01/06/2019	CA	CAD	650,000	648,330	0.26
Wynn Las Vegas 7.875% 01/11/2017 144A	US	USD	640,000	643,200	0.25
Matahari International 10.75% 07/08/2012	NL	USD	614,000	638,163	0.25
Intelsat Jackson Holdings 11.25% 15/06/2016	BM	USD	590,000	637,200	0.25
Tenet Healthcare 8.875% 01/07/2019 144A	US	USD	585,000	633,262	0.25
TMK Capital (OAO TMK) 10.00% 29/07/2011	LU	USD	600,000	628,530	0.25
Chesapeake Energy 6.50% 15/08/2017	US	USD	630,000	612,675	0.24

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
First Data 9.875% 24/09/2015	US	USD	705,000	611,588	0.24
Rite Aid 7.50% 01/03/2017	US	USD	645,000	606,300	0.24
France 4.00% 25/04/2060	FR	EUR	450,000	605,752	0.24
Russian Railways 5.739% 03/04/2017 EMTN	RU	USD	600,000	604,398	0.24
Fannie Mae 1.75% 07/05/2013	US	USD	598,000	596,550	0.24
Qwest Communications 7.125% 01/04/2018 144A	US	USD	580,000	595,950	0.24
Toys "R" Us 7.875% 15/04/2013	US	USD	580,000	591,600	0.23
Cellco Verizon Wirelss 8.50% 15/11/2018	US	USD	475,000	591,343	0.23
Colombia 10.375% 28/01/2033	CO	USD	415,000	588,567	0.23
GMAC 1.75% 30/10/2012	US	USD	585,000	587,886	0.23
US Treasury 5.25% 15/02/2029	US	USD	528,000	572,859	0.23
Icahn Enterprises 7.75% 15/01/2016 144A	US	USD	595,000	572,688	0.23
Icahn Enterprises 8.00% 15/01/2018 144A	US	USD	595,000	572,688	0.23
Intergen 9.00% 30/06/2017 Reg S	NL	USD	550,000	572,000	0.23
Japan Finance for Municipal Ent. 2.00% 09/05/2016	JP	JPY	50,000,000	569,816	0.23
Nextel Communications 7.375% 01/08/2015	US	USD	590,000	559,025	0.22
Freescale Semiconductor 9.125% 15/12/2014	US	USD	605,654	558,548	0.22
US Treasury 1.00% 31/12/2011	US	USD	554,000	554,974	0.22
DaVita 6.625% 15/03/2013	US	USD	550,000	554,785	0.22
CCH II Capital 13.50% 30/11/2016	US	USD	454,188	548,432	0.22
Kabel Deutschland 10.625% 01/07/2014	DE	USD	520,000	546,650	0.22
US Treasury 3.00% 28/02/2017	US	USD	550,000	540,952	0.21
US Treasury 4.75% 15/08/2017	US	USD	494,000	540,023	0.21
Affinion Group 11.50% 15/10/2015	US	USD	525,000	538,125	0.21
Digicel Group 8.875% 15/01/2015 Reg S	BM	USD	540,000	530,550	0.21
Sprint Capital 6.875% 15/11/2028	US	USD	655,000	528,912	0.21
Orascom Telecom Finance 7.875% 08/02/2014 144A	LU	USD	555,000	526,972	0.21
NXP Funding 7.875% 15/10/2014	NL	USD	530,000	519,400	0.21
Kansas City Southern Mexico 8.00% 01/02/2018 144A	MX	USD	500,000	505,000	0.20
GMAC 6.625% 15/05/2012	US	USD	495,000	497,475	0.20
Tenneco 8.625% 15/11/2014	US	USD	485,000	494,700	0.20
Pemex Project FMT 6.625% 15/06/2038	US	USD	500,000	489,412	0.19
US Treasury 4.625% 15/02/2040	US	USD	493,000	484,525	0.19
Turkey 7.375% 05/02/2025	TR	USD	430,000	474,849	0.19
US Treasury 7.50% 15/11/2016	US	USD	375,000	473,115	0.19
Ford Motor Credit 12.00% 15/05/2015	US	USD	395,000	472,499	0.19
Petrohawk Energy 9.125% 15/07/2013	US	USD	445,000	467,250	0.19
Congo 3.00% 30/06/2029	CD	USD	826,500	466,972	0.19
Venezuela 13.625% 15/08/2018	VE	USD	460,000	461,150	0.18
Colombia 7.375% 18/09/2037	CO	USD	410,000	457,150	0.18
US Treasury 4.50% 15/08/2039	US	USD	475,000	456,668	0.18
CIT Group 7.00% 01/05/2017	US	USD	495,000	454,162	0.18
Federal Home Loan Banks 1.50% 16/01/2013	US	USD	455,000	453,250	0.18
Citi (Indonesia Loan 1995) SLP 1.25% 14/12/2019*	ID	USD	516,497	451,935	0.18

* 取締役会により価格が決定された証券。

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
Brazil 8.25% 20/01/2034	BR	USD	355,000	451,738	0.18
Georgia-Pacific 7.125% 15/01/2017 Reg S	US	USD	430,000	447,200	0.18
Venezuela 7.75% 13/10/2019 Reg S	VE	USD	620,000	445,780	0.18
Toys "R" Us Property I 10.75% 15/07/2017 144A	US	USD	395,000	441,412	0.17
CIT Group 7.00% 01/05/2015	US	USD	465,000	432,450	0.17
DISH DBS 6.625% 01/10/2014	US	USD	425,000	430,865	0.17
US Treasury 4.375% 15/02/2038	US	USD	450,000	426,762	0.17
Ameristar Casinos 9.25% 01/06/2014	US	USD	405,000	421,200	0.17
Reader's Digest Association 9.50% FRN 15/02/2017 144A	US	USD	410,000	418,815	0.17
Edgen Murray 12.25% 15/01/2015 144A	US	USD	445,000	416,609	0.17
Venezuela 8.50% 08/10/2014	VE	USD	475,000	413,250	0.16
Education Management 8.75% 01/06/2014	US	USD	400,000	412,000	0.16
Intergas Finance 6.375% 14/05/2017 Reg S	NL	USD	400,000	410,313	0.16
Petroleos Venezuela 5.375% 12/04/2027	VE	USD	805,000	409,544	0.16
AES 7.75% 01/03/2014	US	USD	400,000	407,000	0.16
DuPont Fabros Technology 8.50% 15/12/2017 144A	US	USD	385,000	396,550	0.16
Iraq 5.80% 15/01/2028 Reg S	IQ	USD	500,000	396,250	0.16
Vitro 8.625% 01/02/2012 (Defaulted)	MX	USD	875,000	395,938	0.16
Uruguay 7.625% 21/03/2036	UY	USD	350,000	395,500	0.16
Apria Healthcare Group 11.25% 01/11/2014 144A	US	USD	360,000	395,100	0.16
Netherlands 3.25% 15/07/2015	NL	EUR	275,000	388,496	0.15
Freescale Semiconductor 4.132% FRN 15/12/2014	US	USD	440,000	387,200	0.15
Charter Communications 8.75% 15/11/2013	US	USD	375,000	386,700	0.15
Teck Resources 10.75% 15/05/2019	CA	USD	310,000	380,525	0.15
ARAMARK 8.50% 01/02/2015	US	USD	370,000	378,325	0.15
Nortek 11.00% 01/12/2013	US	USD	356,577	377,972	0.15
Graphic Packaging International 9.50% 15/06/2017	US	USD	355,000	376,300	0.15
Turkey 6.75% 30/05/2040	TR	USD	380,000	374,315	0.15
Bank of America 7.40% 15/01/2011	US	USD	355,000	371,521	0.15
American International Group 5.45% 18/05/2017 MTN	US	USD	400,000	366,275	0.15
El Salvador 7.75% 24/01/2023 Reg S	SV	USD	330,000	365,805	0.15
Perusahaan Penerbit SBSN 8.80% 23/04/2014 144A	ID	USD	310,000	364,056	0.14
Central Garden & Pet 8.25% 01/03/2018	US	USD	360,000	363,600	0.14
Owens-Brockway Glass Container 7.375% 15/05/2016	US	USD	345,000	363,526	0.14
American International Group 8.25% 15/08/2018	US	USD	345,000	361,131	0.14
HCA 7.25% 15/09/2020 144A	US	USD	355,000	360,769	0.14
Clearwire B 12.00% 01/12/2015 144A	US	USD	350,000	359,170	0.14
US Treasury 6.375% 15/08/2027	US	USD	293,000	358,902	0.14
Wind Acquisition Finance 11.75% 15/07/2017 144A	LU	USD	325,000	358,312	0.14
European Investment Bank 22.00% 14/10/2011 EMTN	99	GHS	455,000	353,624	0.14
Eastman Kodak 9.75% 01/03/2018 144A	US	USD	360,000	352,800	0.14
Nielsen Finance 10.00% 01/08/2014	US	USD	335,000	350,912	0.14
Sally Holdings 9.25% 15/11/2014	US	USD	330,000	349,800	0.14
ACCO Brands 7.625% 15/08/2015	US	USD	375,000	349,688	0.14
International Paper 9.375% 15/05/2019	US	USD	280,000	349,140	0.14
Vietnam 4.00% 12/03/2028	VN	USD	420,000	347,025	0.14

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
Berry Plastics 8.875% 15/09/2014	US	USD	355,000	345,238	0.14
US Treasury 3.625% 15/02/2020	US	USD	350,000	343,819	0.14
Wind Acquisition Holding 12.25% 15/07/2017 144A	LU	USD	360,000	343,415	0.14
NII Capital 10.00% 15/08/2016 144A	US	USD	310,000	339,450	0.13
Ceridian 11.25% 15/11/2015	US	USD	355,000	339,025	0.13
Freescale Semiconductor 10.125% 15/12/2016	US	USD	375,000	337,500	0.13
Freescale Semiconductor 8.875% 15/12/2014	US	USD	355,000	337,250	0.13
NII Capital 8.875% 15/12/2019 144A	US	USD	325,000	337,188	0.13
Qwest 8.375% 01/05/2016	US	USD	295,000	334,088	0.13
Bio-Rad Laboratories 8.00% 15/09/2016	US	USD	310,000	330,150	0.13
Michaels Stores 10.00% 01/11/2014	US	USD	310,000	327,050	0.13
Nova Chemicals 8.625% 01/11/2019 144A	CA	USD	315,000	326,025	0.13
Cascades 7.875% 15/01/2020 144A	CA	USD	325,000	325,812	0.13
Liberty Media 5.70% 15/05/2013	US	USD	325,000	325,812	0.13
Corrections of America 7.75% 01/06/2017	US	USD	310,000	325,500	0.13
Basell Finance 8.10% 15/03/2027 144A	NL	USD	350,000	325,500	0.13
Intelsat 9.25% 15/08/2014	US	USD	315,000	324,072	0.13
Cablemas 9.375% 15/11/2015 Reg S	MX	USD	300,000	322,944	0.13
Nextel Communications 5.95% 15/03/2014	US	USD	340,000	320,025	0.13
Peru 7.35% 21/07/2025	PE	USD	275,000	319,688	0.13
CSN Islands 6.875% 21/09/2019 144A	KY	USD	305,000	319,512	0.13
Forest Oil 7.25% 15/06/2019	US	USD	315,000	319,316	0.13
TRW Automotive 7.25% 15/03/2017 144A	US	USD	330,000	318,450	0.13
Digicel Group 12.00% 01/04/2014 144A	BM	USD	280,000	317,800	0.13
CSC Holdings 8.625% 15/02/2019 144A	US	USD	290,000	317,550	0.13
Intelsat Jackson Holdings 11.50% 15/06/2016	BM	USD	293,000	316,440	0.13
Norcraft 10.50% 15/12/2015 144A	US	USD	300,000	315,750	0.13
TransDigm 7.75% 15/07/2014 144A	US	USD	310,000	315,425	0.13
Teck Resources 10.25% 15/05/2016	CA	USD	265,000	315,350	0.13
PSALM 7.39% 02/12/2024 144A	PH	USD	300,000	315,150	0.12
International Lease Finance 6.625% 15/11/2013 MTN	US	USD	327,000	314,329	0.12
City of Buenos Aires 12.50% 06/04/2015 144A	AR	USD	300,000	311,700	0.12
Hugues Network Systems 9.50% 15/04/2014	US	USD	305,000	310,338	0.12
Reddy Ice 11.25% 15/03/2015 144A	US	USD	290,000	308,125	0.12
US Treasury 1.875% 30/04/2014	US	USD	310,000	306,161	0.12
Scotts Miracle-Gro 7.25% 15/01/2018	US	USD	300,000	305,250	0.12
Severstal Columbus 10.25% 15/02/2018 144A	US	USD	290,000	305,225	0.12
Momentive Performance 9.75% 01/12/2014	US	USD	305,000	305,000	0.12
US Treasury 4.75% 15/02/2037	US	USD	300,000	303,211	0.12
FTI Consulting 7.625% 15/06/2013	US	USD	300,000	303,000	0.12
GMAC 6.75% 01/12/2014	US	USD	305,000	302,712	0.12
Level 3 Financing 10.00% 01/02/2018 144A	US	USD	315,000	302,400	0.12
Turkey 6.875% 17/03/2036	TR	USD	300,000	302,400	0.12
Range Resources 6.375% 15/03/2015	US	USD	300,000	301,860	0.12
US Treasury 0.75% 30/11/2011	US	USD	299,000	298,544	0.12
Opti Canada 8.25% 15/12/2014	CA	USD	315,000	297,675	0.12

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
LINN Energy 8.625% 15/04/2020 144A	US	USD	305,000	297,534	0.12
Virgin Media Finance 9.125% 15/08/2016	GB	USD	275,000	291,500	0.12
Atlas Pipeline Partners 8.125% 15/12/2015	US	USD	300,000	290,250	0.12
Navistar International 8.25% 01/11/2021	US	USD	285,000	289,988	0.11
Edison Mission Energy 7.20% 15/05/2019	US	USD	417,000	287,730	0.11
Indonesia 11.625% 04/03/2019 144A	ID	USD	200,000	287,500	0.11
Rite Aid 9.75% 12/06/2016	US	USD	265,000	286,200	0.11
Wynn Las Vegas 6.625% 01/12/2014	US	USD	280,000	281,400	0.11
MGM Mirage 11.125% 15/11/2017 144A	US	USD	250,000	281,250	0.11
Quicksilver Resources 8.25% 01/08/2015	US	USD	275,000	281,188	0.11
HCA 6.50% 15/02/2016	US	USD	290,000	276,950	0.11
Merck Financial Services 4.50% 24/03/2020 EMTN	DE	EUR	200,000	275,960	0.11
McJunkin Red Man 9.50% 15/12/2016 144A	US	USD	270,000	275,400	0.11
Citigroup Funding 2.125% 12/07/2012	US	USD	270,000	274,635	0.11
VWR Funding 10.25% 15/07/2015	US	USD	258,781	274,308	0.11
Antero Resources Finance 9.375% 01/12/2017 144A	US	USD	265,000	272,950	0.11
Avis Budget Car Rental 7.625% 15/05/2014	US	USD	275,000	272,250	0.11
Energy Future Holdings 10.00% 15/01/2020 144A	US	USD	260,000	272,025	0.11
VIP Finance (Vimpel) 8.375% 30/04/2013 144A	IE	USD	250,000	271,062	0.11
Equinix 8.125% 01/03/2018	US	USD	260,000	270,400	0.11
FMG Finance 10.625% 01/09/2016 144A	AU	USD	235,000	267,900	0.11
Berry Plastics 5.001% FRN 15/02/2015	US	USD	280,000	267,400	0.11
Burlington Coat Factory 11.125% 15/04/2014	US	USD	250,000	264,375	0.10
Dominican Republic 9.04% 23/01/2018 144A	DO	USD	240,455	263,899	0.10
Intelsat Bermuda 11.25% 04/02/2017	BM	USD	250,000	263,750	0.10
Turkey 7.25% 05/03/2038	TR	USD	250,000	262,900	0.10
MGM Mirage 10.375% 15/05/2014 144A	US	USD	240,000	262,800	0.10
EI Paso 7.25% 01/06/2018	US	USD	255,000	262,650	0.10
IPALCO Enterprises 8.625% 14/11/2011	US	USD	245,000	261,231	0.10
RSHB (Russian Agri Bank) 6.97% VRN 21/09/2016	LU	USD	250,000	257,375	0.10
NXP Funding 3.001% FRN 15/10/2013	NL	USD	275,000	257,125	0.10
Steel Dynamics 7.75% 15/04/2016	US	USD	250,000	256,250	0.10
Mirant Americas Generation 8.50% 01/10/2021	US	USD	270,000	254,475	0.10
Vietnam 1.207% VRN 12/03/2016	VN	USD	286,957	252,522	0.10
Ceridian 12.25% 15/11/2015	US	USD	260,000	252,200	0.10
Teck Resources 9.75% 15/05/2014	CA	USD	210,000	249,900	0.10
Sprint Capital 8.375% 15/03/2012	US	USD	240,000	249,600	0.10
Indonesia 8.50% 12/10/2035 144A	ID	USD	200,000	249,250	0.10
International Lease Finance 5.65% 01/06/2014 MTN	US	USD	270,000	248,419	0.10
Rite Aid 10.25% 15/10/2019	US	USD	230,000	246,962	0.10
US Treasury 3.625% 15/08/2019	US	USD	250,000	246,836	0.10
GMAC 8.30% 12/02/2015 144A	US	USD	235,000	246,750	0.10
Turkey 6.75% 03/04/2018	TR	USD	225,000	245,430	0.10
Goodyear Tire & Rubber 8.75% 15/08/2020	US	USD	248,000	243,660	0.10
HCA 8.50% 15/04/2019 144A	US	USD	225,000	243,000	0.10
Biomet 10.00% 15/10/2017	US	USD	220,000	242,000	0.10

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
UPC Germany 8.125% 01/12/2017 144A	DE	USD	230,000	237,199	0.09
Plains Exploration & Production 7.625% 01/06/2018	US	USD	235,000	236,762	0.09
Pemex Project FMT 6.625% 15/06/2035	US	USD	240,000	236,364	0.09
Healthsouth 8.125% 15/02/2020	US	USD	235,000	234,412	0.09
Oshkosh 8.50% 01/03/2020 144A	US	USD	225,000	234,000	0.09
LBI Escrow 8.00% 01/11/2017 144A	US	USD	225,000	232,875	0.09
Videotron 9.125% 15/04/2018	CA	USD	210,000	232,575	0.09
Philippines 6.375% 23/10/2034	PH	USD	235,000	231,781	0.09
CB Richard Ellis 11.625% 15/06/2017	US	USD	205,000	230,112	0.09
Serbia 6.75% 01/11/2024 144A	RS	USD	230,000	229,425	0.09
Sensus Metering Systems 8.625% 15/12/2013	US	USD	220,000	224,400	0.09
Cenveo 10.50% 15/08/2016 144A	US	USD	220,000	223,850	0.09
Clear Channel Communications 4.40% 15/05/2011	US	USD	235,000	222,075	0.09
MGM Mirage 7.50% 01/06/2016	US	USD	265,000	221,275	0.09
Nextel Communications 6.875% 31/10/2013	US	USD	225,000	220,500	0.09
Severn Trent Utilities Finance 5.25% 11/03/2016 EMTN	GB	EUR	150,000	219,933	0.09
Indonesia 6.625% 17/02/2037 144A	ID	USD	215,000	219,838	0.09
Mexico 8.30% 15/08/2031 MTN	MX	USD	170,000	219,470	0.09
Venezuela 9.00% 07/05/2023 Reg S	VE	USD	295,000	219,421	0.09
Intelsat Bermuda 11.50% 04/02/2017	BM	USD	217,812	218,841	0.09
Argentina 8.28% 31/12/2033	AR	USD	291,847	218,646	0.09
Southwestern Energy 7.50% 01/02/2018	US	USD	200,000	218,000	0.09
National Power 6.875% 02/11/2016 144A	PH	USD	200,000	216,500	0.09
Cloud Peak Energy Resources 8.25% 15/12/2017 144A	US	USD	210,000	215,250	0.09
FMG Finance 10.00% 01/09/2013 144A	AU	USD	200,000	215,000	0.09
Eurasian Development Bank 7.375% 29/09/2014 144A	99	USD	200,000	214,286	0.08
Venezuela 10.75% 19/09/2013	VE	USD	220,000	213,950	0.08
Dynegy Holdings 7.50% 01/06/2015 144A	US	USD	255,000	213,562	0.08
CIT Group 7.00% 01/05/2016	US	USD	230,000	211,600	0.08
Starwood Hotels & Resort 5.75% 15/10/2014	US	USD	195,000	211,331	0.08
Texas Competitive Electric 10.25% 01/11/2015	US	USD	295,000	209,450	0.08
IASIS Healthcare 8.75% 15/06/2014	US	USD	205,000	209,100	0.08
Sri Lanka 7.40% 22/01/2015 144A	LK	USD	200,000	208,626	0.08
Levi Strauss 8.875% 01/04/2016	US	USD	200,000	208,000	0.08
Sprint Capital 8.75% 15/03/2032	US	USD	220,000	206,250	0.08
Rabobank Nederland 4.125% 14/01/2020	NL	EUR	150,000	206,165	0.08
Netherlands 3.50% 15/07/2020	NL	EUR	150,000	205,938	0.08
Mirant Americas Generation 8.30% 01/05/2011	US	USD	200,000	205,500	0.08
Affinion Group 10.125% 15/10/2013	US	USD	200,000	205,000	0.08
United Rentals North America 9.25% 15/12/2019	US	USD	200,000	204,500	0.08
Ventas Realty 6.50% 01/06/2016	US	USD	200,000	203,500	0.08
Vedanta Resources 9.50% 18/07/2018 144A	GB	USD	185,000	202,575	0.08
Toys "R" Us Property II 8.50% 01/12/2017 144A	US	USD	195,000	202,312	0.08
Senior Housing Property Trust 7.875% 15/04/2015	US	USD	200,000	201,500	0.08
GMAC 6.00% 15/12/2011	US	USD	200,000	200,000	0.08
Clear Channel Worldwide B 9.25% 15/12/2017 144A	US	USD	190,000	198,550	0.08

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
Tenet Healthcare 9.875% 01/07/2014	US	USD	190,000	198,550	0.08
Philippines 6.375% 15/01/2032	PH	USD	200,000	197,607	0.08
Seneca Gaming 7.25% 01/05/2012	US	USD	200,000	197,500	0.08
Chesapeake Energy 6.625% 15/01/2016	US	USD	200,000	196,500	0.08
Clear Channel Communication 10.75% 01/08/2016	US	USD	250,000	196,250	0.08
Nova Chemicals 8.375% 01/11/2016 144A	CA	USD	190,000	196,175	0.08
Texas Electric 10.50% 01/11/2016	US	USD	301,718	195,865	0.08
Charter Communications 10.875% 15/09/2014 144A	US	USD	175,000	195,562	0.08
Avaya 9.75% 01/11/2015	US	USD	200,000	195,000	0.08
Vietnam 6.75% 29/01/2020 144A	VN	USD	190,000	193,562	0.08
Navios Maritime Holdings 9.50% 15/12/2014	MH	USD	190,000	192,850	0.08
B&G Foods 7.625% 15/01/2018	US	USD	190,000	192,850	0.08
Ukraine 6.75% 14/11/2017 144A	UA	USD	200,000	191,000	0.08
Colombia 6.125% 18/01/2041	CO	USD	200,000	190,099	0.08
PolyOne 8.875% 01/05/2012	US	USD	180,000	189,900	0.08
Brazil 5.625% 07/01/2041	BR	USD	200,000	188,500	0.07
Mexico 5.625% 15/01/2017	MX	USD	176,000	188,426	0.07
First Data 10.55% 24/09/2015	US	USD	236,868	188,420	0.07
Pakistan 7.125% 31/03/2016 144A	PK	USD	200,000	188,000	0.07
Apria Healthcare Group 12.375% 01/11/2014 144A	US	USD	170,000	187,425	0.07
Nielsen Finance 11.50% 01/05/2016	US	USD	165,000	187,275	0.07
Huntsman 5.50% 30/06/2016 144A	US	USD	205,000	186,550	0.07
GMAC 6.875% 28/08/2012	US	USD	185,000	185,925	0.07
Plains Exploration & Production 7.00% 15/03/2017	US	USD	185,000	183,372	0.07
Turkey 8.00% 14/02/2034	TR	USD	160,000	183,339	0.07
GMAC 7.00% 01/02/2012	US	USD	180,000	182,700	0.07
RRI Energy 6.75% 15/12/2014	US	USD	181,000	180,095	0.07
Terra Capital 7.75% 01/11/2019	US	USD	150,000	180,000	0.07
Express 8.75% 01/03/2018 144A	US	USD	175,000	177,188	0.07
United Surgical Partners 8.875% 01/05/2017	US	USD	170,000	176,800	0.07
Iron Mountain 7.75% 15/01/2015	US	USD	175,000	176,531	0.07
Drummond 7.375% 15/02/2016	US	USD	180,000	176,400	0.07
CSC Holdings 8.50% 15/04/2014 144A	US	USD	165,000	176,336	0.07
Nielsen Finance 10.21% 01/08/2016	US	USD	185,000	176,212	0.07
Controladora Mabe 7.875% 28/10/2019 144A	MX	USD	165,000	174,488	0.07
NET Servicos de Comunicacao 7.50% 27/01/2020 144A	BR	USD	165,000	174,281	0.07
Opti Canada 7.875% 15/12/2014	CA	USD	185,000	173,900	0.07
Reynolds American 7.30% 15/07/2015	US	USD	155,000	172,930	0.07
US Treasury 4.625% 31/07/2012	US	USD	160,000	172,619	0.07
Energy Transfer Partners 9.00% 15/04/2019	US	USD	140,000	171,471	0.07
Hercules Offshore 10.50% 15/10/2017 144A	US	USD	170,000	169,575	0.07
Lithuania 6.75% 15/01/2015 144A	LT	USD	155,000	168,748	0.07
Federal Home Loan Banks 3.625% 18/10/2013	US	USD	160,000	168,561	0.07
Alestra 11.75% 11/08/2014	MX	USD	145,000	164,477	0.07
Intelsat Subsidiary Holding 8.875% 15/01/2015	BM	USD	155,000	159,262	0.06
Tesco Property 2 6.052% 13/10/2039	GB	GBP	100,000	159,177	0.06

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
Targa Resources Partners 11.25% 15/07/2017 144A	US	USD	140,000	158,200	0.06
TRW Automotive 7.00% 15/03/2014 144A	US	USD	160,000	157,600	0.06
Catalent Pharma Solution 9.50% 15/04/2015	US	USD	168,200	156,838	0.06
Fresenius US Finance II 9.00% 15/07/2015 144A	US	USD	140,000	156,450	0.06
Sungard Data Systems 4.875% 15/01/2014	US	USD	165,000	156,131	0.06
Asbury Automotive Group 8.00% 15/03/2014	US	USD	155,000	155,388	0.06
Pfizer 5.75% 03/06/2021	US	EUR	100,000	154,710	0.06
Cloud Peak Energy Resources 8.50% 15/12/2019 144A	US	USD	150,000	154,500	0.06
Omega Healthcare Investors 7.50% 15/02/2020 144A	US	USD	150,000	153,750	0.06
Quicksilver Resources 9.125% 15/08/2019	US	USD	145,000	152,250	0.06
Sonic Automotive 8.625% 15/08/2013	US	USD	150,000	152,250	0.06
Citibank 1.50% 12/07/2011	US	USD	150,000	151,427	0.06
US Treasury 6.125% 15/08/2029	US	USD	126,000	151,254	0.06
Ford Motor 6.625% 15/02/2028	US	USD	180,000	151,200	0.06
Clear Channel Communications 5.00% 15/03/2012	US	USD	170,000	150,450	0.06
Omega Healthcare Investors 7.00% 15/01/2016	US	USD	150,000	150,375	0.06
EXCO Resources 7.25% 15/01/2011	US	USD	150,000	150,000	0.06
Nisource Finance 10.75% 15/03/2016	US	USD	118,000	149,655	0.06
International Lease Finance 8.75% 15/03/2017 144A	US	USD	145,000	147,175	0.06
Chesapeake Energy 9.50% 15/02/2015	US	USD	135,000	146,812	0.06
Crown Castle International 9.00% 15/01/2015	US	USD	135,000	146,138	0.06
Chesapeake Energy 6.875% 15/11/2020	US	USD	150,000	145,875	0.06
Steel Dynamics 7.375% 01/11/2012	US	USD	140,000	145,600	0.06
Ford Motor Credit 7.00% 01/10/2013	US	USD	140,000	145,572	0.06
Dollar General 10.625% 15/07/2015	US	USD	133,000	144,970	0.06
Indonesia 6.875% 17/01/2018 144A	ID	USD	130,000	144,424	0.06
Ghana 8.50% 04/10/2017 144A	GH	USD	130,000	141,895	0.06
US Oncology 9.125% 15/08/2017	US	USD	135,000	141,075	0.06
Georgia-Pacific 8.25% 01/05/2016 144A	US	USD	130,000	141,050	0.06
Alcatel-Lucent USA 6.50% 15/01/2028	US	USD	200,000	140,750	0.06
Washington Mutual 4.375% 19/05/2014 (Defaulted)	US	EUR	100,000	140,680	0.06
Continental Airlines RJ04 9.558% 01/09/2019	US	USD	152,672	138,932	0.06
MGM Mirage 5.875% 27/02/2014	US	USD	165,000	137,775	0.05
American Casino & Entertainment 11.00% 15/06/2014	US	USD	145,000	134,488	0.05
Majapahit Holding 7.25% 28/06/2017 Reg S	NL	USD	125,000	133,125	0.05
Helix Energy Solutions 9.50% 15/01/2016 144A	US	USD	130,000	132,600	0.05
Connacher Oil & Gas 10.25% 15/12/2015 144A	CA	USD	130,000	131,300	0.05
Uruguay 8.00% 18/11/2022	UY	USD	110,000	130,900	0.05
Freeport McMoRan Copper & Gold 8.25% 01/04/2015	US	USD	120,000	130,644	0.05
Chesapeake Energy 7.25% 15/12/2018	US	USD	130,000	130,325	0.05
DirecTV Holdings 6.375% 15/06/2015	US	USD	125,000	129,844	0.05
Biomet 11.625% 15/10/2017	US	USD	115,000	128,512	0.05
Petrohawk Energy 7.875% 01/06/2015	US	USD	125,000	127,500	0.05
New Albertsons 7.75% 15/06/2026	US	USD	150,000	127,500	0.05
Denbury Resources 8.25% 15/02/2020	US	USD	120,000	127,200	0.05
International Lease Finance 8.625% 15/09/2015 144A	US	USD	125,000	126,875	0.05

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
DISH DBS 7.75% 31/05/2015	US	USD	120,000	126,600	0.05
United Surgical Partners 9.25% 01/05/2017	US	USD	120,000	124,800	0.05
Pride International 8.50% 15/06/2019	US	USD	110,000	124,300	0.05
Revlon Consumer Products 9.75% 15/11/2015 144A	US	USD	120,000	123,900	0.05
Argentina 2.50% 31/12/2038	AR	USD	340,000	120,190	0.05
Royal Caribbean Cruises 11.875% 15/07/2015	LR	USD	105,000	119,700	0.05
AES 9.75% 15/04/2016 144A	US	USD	110,000	119,350	0.05
IPALCO Enterprises 7.25% 01/04/2016 144A	US	USD	115,000	119,312	0.05
Lambda Finance 2007-1X A2 0.803% FRN 20/09/2031 Reg S	NL	EUR	90,580	117,843	0.05
Tenneco 8.125% 15/11/2015	US	USD	115,000	117,588	0.05
NSG Holdings 7.75% 15/12/2025 Reg S	US	USD	130,000	117,000	0.05
Telcordia Technologies 4.001% FRN 15/07/2012 Reg S	US	USD	120,000	116,400	0.05
RSHB (Russian Agri Bank) 9.00% 11/06/2014 144A	LU	USD	100,000	115,438	0.05
JDA Software Group 8.00% 15/12/2014 144A	US	USD	110,000	114,400	0.05
MGM Mirage 9.00% 15/03/2020 144A	US	USD	110,000	113,850	0.05
Brazil 7.125% 20/01/2037	BR	USD	100,000	113,500	0.04
Continental Airlines ERJ1 9.798% 01/04/2021	US	USD	124,359	111,301	0.04
Global Crossing 12.00% 15/09/2015 144A	BM	USD	100,000	111,000	0.04
International Lease Finance 5.25% 10/01/2013 MTN	US	USD	117,000	110,850	0.04
Lamar Media 6.625% 15/08/2015 C	US	USD	115,000	110,826	0.04
Turkey 7.00% 11/03/2019	TR	USD	100,000	110,290	0.04
Tenet Healthcare 9.25% 01/02/2015	US	USD	105,000	110,250	0.04
Turkey 7.00% 05/06/2020	TR	USD	100,000	109,975	0.04
Majapahit Holding 8.00% 07/08/2019 144A	NL	USD	100,000	109,931	0.04
El Salvador 7.375% 01/12/2019 144A	SV	USD	100,000	109,375	0.04
Lithuania 7.375% 11/02/2020 144A	LT	USD	100,000	108,710	0.04
RSHB (Russian Agri Bank) 7.125% 14/01/2014 144A	LU	USD	100,000	108,494	0.04
Halyk Savings Bank of Kazakhstan 9.25% 16/10/2013 144A	KZ	USD	100,000	107,850	0.04
CMS Energy 8.75% 15/06/2019	US	USD	95,000	107,588	0.04
Venezuela 9.375% 13/01/2034	VE	USD	145,000	105,998	0.04
Petroleum Development 12.00% 15/02/2018	US	USD	100,000	105,500	0.04
Odebrecht Finance 7.00% 21/04/2020 144A	KY	USD	100,000	104,515	0.04
Naftogaz Ukraine 9.50% 30/09/2014	UA	USD	100,000	104,137	0.04
DISH DBS 6.375% 01/10/2011	US	USD	100,000	104,000	0.04
Oshkosh 8.25% 01/03/2017 144A	US	USD	100,000	103,875	0.04
RSHB (Russian Agri Bank) 6.299% 15/05/2017 144A	LU	USD	100,000	103,758	0.04
Crown Americas II 7.625% 15/05/2017 144A	US	USD	100,000	103,250	0.04
Export-Import Bank of India 0.751% FRN 07/06/2012	IN	JPY	10,000,000	103,074	0.04
Owens-Brockway Glass Container 6.75% 01/12/2014	US	USD	100,000	102,500	0.04
Foundation PA Coal 7.25% 01/08/2014	US	USD	100,000	102,250	0.04
DigitalGlobe 10.50% 01/05/2014 144A	US	USD	95,000	101,650	0.04
Rearden G Holdings EINS 7.875% 30/03/2020 144A	BR	USD	100,000	101,538	0.04
South Africa 5.50% 09/03/2020	ZA	USD	100,000	100,850	0.04
Speedway Motorsports 6.75% 01/06/2013	US	USD	100,000	100,000	0.04
Boise Paper Holdings 9.00% 01/11/2017 144A	US	USD	95,000	99,988	0.04
GMAC 8.00% 01/11/2031	US	USD	105,000	99,443	0.04

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
Continental Airlines 8.75% 01/12/2011	US	USD	100,000	99,000	0.04
Enterprise Inns 6.50% 06/12/2018	GB	GBP	75,000	98,304	0.04
Mac-Gray 7.625% 15/08/2015	US	USD	100,000	98,120	0.04
Commercial Vehicle Group 8.00% 01/07/2013	US	USD	140,000	98,000	0.04
Nationwide Building Society 3.375% VRN 17/08/2015	GB	EUR	75,000	97,475	0.04
Barclays 10.00% 21/05/2021 EMTN	GB	GBP	50,000	96,793	0.04
Intelsat Subsidiary Holding 8.50% 15/01/2013	BM	USD	95,000	96,548	0.04
US Treasury 3.375% 15/11/2019	US	USD	100,000	96,434	0.04
Ford Motor 6.625% 01/10/2028	US	USD	115,000	96,025	0.04
South East Water 5.5834% 29/03/2029	KY	GBP	65,000	95,031	0.04
Kansas City Southern Railway 13.00% 15/12/2013	US	USD	80,000	95,000	0.04
Pakistan Mobile Comm. 8.625% 13/11/2013 144A	PK	USD	100,000	93,500	0.04
European Investment Bank 11.25% 02/12/2011 144A	99	ZMK	400,000,000	93,467	0.04
Cerveceria Nacional Dominicana 16.00% 27/03/2012	DO	USD	100,000	93,399	0.04
Nakilat 6.267% 31/12/2033 Reg S	QA	USD	100,000	93,250	0.04
Uruguay 6.875% 28/09/2025	UY	USD	85,000	92,472	0.04
Lamar Media 6.625% 15/08/2015	US	USD	95,000	92,150	0.04
Nielsen Finance 11.625% 01/02/2014	US	USD	80,000	91,000	0.04
Interpublic Group 10.00% 15/07/2017	US	USD	80,000	90,800	0.04
GMAC 6.625% 15/05/2012	US	USD	90,000	90,450	0.04
US Treasury 1.50% 31/12/2013	US	USD	91,000	89,269	0.04
Aquilex Holdings 11.125% 15/12/2016 144A	US	USD	80,000	86,000	0.03
HCA 9.125% 15/11/2014	US	USD	80,000	84,600	0.03
Ford Motor 6.375% 01/02/2029	US	USD	105,000	84,000	0.03
Avis Budget Car Rental 9.625% 15/03/2018 144A	US	USD	80,000	83,600	0.03
Kansas City Southern Railway 8.00% 01/06/2015	US	USD	80,000	83,600	0.03
Berry Petroleum 10.25% 01/06/2014	US	USD	75,000	82,500	0.03
Clear Channel Communications 6.25% 15/03/2011	US	USD	85,000	82,450	0.03
Navios Maritime Holdings 8.875% 01/11/2017 144A	MH	USD	80,000	82,400	0.03
Range Resources 7.25% 01/05/2018	US	USD	80,000	82,400	0.03
Santander Issuances 7.30% VRN 27/07/2019	ES	GBP	50,000	82,339	0.03
Roche Holding 6.50% 04/03/2021 EMTN	US	EUR	50,000	82,226	0.03
Affinion Group 10.125% 15/10/2013 Reg S	US	USD	80,000	81,400	0.03
USI Holdings 4.125% FRN 15/11/2014 144A	US	USD	95,000	81,344	0.03
Granite Master Issuer 2005-4 A5 0.502% FRN 20/12/2054	GB	EUR	64,644	80,359	0.03
Cloverie (Zurich) 7.50% VRN 24/07/2039 EMTN	IE	EUR	50,000	77,474	0.03
Univision Communications 12.00% 01/07/2014 144A	US	USD	70,000	77,000	0.03
Verso Paper Holdings 11.50% 01/07/2014 144A	US	USD	70,000	75,775	0.03
Sovereign Housing Capital 5.705% 10/09/2039	GB	GBP	50,000	75,517	0.03
Nexstar Broadcasting 7.00% 15/01/2014	US	USD	93,530	74,737	0.03
Noranda Aluminium Acquisition 5.274% 15/05/2015	US	USD	96,180	74,547	0.03
ArvinMeritor 10.625% 15/03/2018	US	USD	70,000	72,800	0.03
Veolia Environnement 5.125% 24/05/2022 EMTN	FR	EUR	50,000	71,650	0.03
GMAC 6.875% 15/09/2011	US	USD	70,000	70,875	0.03
Solutia 7.875% 15/03/2020	US	USD	70,000	70,000	0.03
Rexam 4.375% 15/03/2013 EMTN	GB	EUR	50,000	69,904	0.03

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
KBC 4.50% 17/09/2014 EMTN	NL	EUR	50,000	69,759	0.03
UBS Jersey 4.125% VRN 25/09/2018 EMTN	CH	EUR	50,000	68,110	0.03
US Bank 4.375% VRN 28/02/2017 EMTN	US	EUR	50,000	67,756	0.03
Glencore Finance Europe 5.25% 22/03/2017 EMTN	LU	EUR	50,000	67,367	0.03
Sonic Automotive 9.00% 15/03/2018 144A	US	USD	65,000	66,625	0.03
GMAC 6.875% 15/09/2011	US	USD	65,000	65,731	0.03
Bank of America 4.00% VRN 28/03/2018 EMTN	US	EUR	50,000	64,456	0.03
Goldman Sachs Group 4.75% 12/10/2021	US	EUR	50,000	62,169	0.02
HCA 6.375% 15/01/2015	US	USD	65,000	61,750	0.02
General Nutrition Center 5.75% 15/03/2014	US	USD	65,000	61,588	0.02
American International Group 5.60% 18/10/2016	US	USD	65,000	60,334	0.02
Mexico 7.50% 08/04/2033 MTN	MX	USD	50,000	59,250	0.02
KBC Ifima 0.85% FRN 14/12/2015 EMTN	NL	EUR	50,000	58,692	0.02
Verso Paper Holdings 3.999% FRN 01/08/2014	US	USD	65,000	55,250	0.02
Sealy Mattress 10.875% 15/04/2016 144A	US	USD	49,000	54,758	0.02
Avis Budget Car Rental 7.75% 15/05/2016	US	USD	55,000	53,900	0.02
Casella Waste Systems 11.00% 15/07/2014 144A	US	USD	50,000	53,625	0.02
Delta Air Lines 9.50% 15/09/2014 144A	US	USD	50,000	52,500	0.02
International Lease Finance 5.875% 01/05/2013	US	USD	55,000	51,883	0.02
TRW Automotive 8.875% 01/12/2017 144A	US	USD	50,000	51,875	0.02
Lear 8.125% 15/03/2020	US	USD	50,000	50,875	0.02
Imperial Tobacco Finance 8.375% 17/02/2016 EMTN	GB	EUR	30,000	49,939	0.02
Landry's Restaurant 11.625% 01/12/2015 144A	US	USD	45,000	48,600	0.02
NXP Funding 10.00% 15/07/2013 144A	NL	USD	45,000	47,700	0.02
Easton-Bell Sports 9.75% 01/12/2016 144A	US	USD	45,000	47,475	0.02
United Mexican States 5.95% 19/03/2019 EMTN	MX	USD	44,000	47,432	0.02
Granite Mortgages 2005-4 A5 0.502% FRN 20/12/2054 Reg S	GB	GBP	33,854	47,173	0.02
Clear Channel Worldwide A 9.25% 15/12/2017 144A	US	USD	45,000	46,688	0.02
American International Group 5.85% 16/01/2018 MTN	US	USD	50,000	46,222	0.02
Tennessee Gas Pipeline 8.00% 01/02/2016	US	USD	40,000	46,100	0.02
Tenet Healthcare 7.375% 01/02/2013	US	USD	45,000	45,562	0.02
Lear 7.875% 15/03/2018	US	USD	45,000	45,562	0.02
Geo Group 7.75% 15/10/2017 144A	US	USD	45,000	45,450	0.02
GMAC 6.00% 15/12/2011	US	USD	45,000	45,112	0.02
WestLB 3.50% 03/09/2012 EMTN	DE	EUR	30,000	41,669	0.02
Shingle Springs Tribal G.A. 9.375% 15/06/2015 Reg S	US	USD	50,000	41,500	0.02
Viasat 8.875% 15/09/2016 144A	US	USD	40,000	40,900	0.02
Mexican Bonos De Desarrollo 9.50% 18/12/2014	MX	MXN	432,500	39,020	0.02
Headwaters 11.375% 01/11/2014 144A	US	USD	35,000	36,225	0.01
Brocade Comm. Systems 6.875% 15/01/2020 144A	US	USD	35,000	35,700	0.01
Brocade Comm. Systems 6.625% 15/01/2018 144A	US	USD	35,000	35,612	0.01
Ventas Realty 6.50% 01/06/2016	US	USD	35,000	35,612	0.01
Claire's Stores 9.25% 01/06/2015	US	USD	40,000	35,200	0.01
HSBC Bank 5.75% 27/06/2017 EMTN	GB	GBP	20,000	31,764	0.01
General Cable 7.125% 01/04/2017	US	USD	30,000	29,738	0.01
US Treasury 1.875% 28/02/2014	US	USD	30,000	29,734	0.01

	国コード	通貨	額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
American Airlines 2001-2 8.608% 01/04/2011	US	USD	30,000	29,100	0.01
Ford Motor Credit 7.45% 16/07/2031	US	USD	30,000	28,425	0.01
Dignity Finance 8.151% 31/12/2030	GB	GBP	15,000	27,580	0.01
Waterford Gaming 8.625% 15/09/2014 Reg S	US	USD	50,000	27,250	0.01
Tenet Healthcare 9.00% 01/05/2015 Reg S	US	USD	25,000	26,844	0.01
Omega Healthcare Investors 7.00% 01/04/2014	US	USD	25,000	25,000	0.01
Nexstar Broadcasting 7.00% 15/01/2014	US	USD	31,000	24,800	0.01
Edison Mission Energy 7.00% 15/05/2017	US	USD	25,000	17,438	0.01
Station Casinos 6.00% 01/04/2012 (Defaulted)	US	USD	255,000	17,212	0.01
International Lease Finance 6.375% 25/03/2013	US	USD	16,000	15,524	0.01
International Lease Finance 5.625% 20/09/2013 MTN	US	USD	10,000	9,406	0.00
Momentive Performance 10.125% 01/12/2014	US	USD	7,554	7,242	0.00
MGM Mirage 6.75% 01/04/2013	US	USD	5,000	4,550	0.00
Station Casinos 7.75% 15/08/2016 (Defaulted)	US	USD	60,000	4,350	0.00
Bank of America 7.625% 01/06/2019	US	USD	3,000	3,422	0.00
Marsh & McLennan Cos 9.25% 15/04/2019	US	USD	2,000	2,484	0.00
Anglo American Capital 9.375% 08/04/2019 144A	GB	USD	1,000	1,271	0.00
Bank of America 7.375% 15/05/2014	US	USD	1,000	1,123	0.00
Reader's Digest Association 9.00% 15/02/2017 (Defaulted)	US	USD	150,000	15	0.00
				225,827,558	89.53

	国コード	通貨	株数または 額面価額	時価 (米ドル)	純資産 比率(%)
非上場					
Freescale Semiconductor 10.125% 15/03/2018 144A	US	USD	815,000	876,125	0.35
Six Flags Operations	US	USD	34,610	804,451	0.32
Viant Holdings 10.125% 15/07/2017 144A	US	USD	558,000	558,000	0.22
Barclays credit linked bond (Ghana) 18/03/2013 144A	GB	USD	370,000	380,767	0.15
CEVA Group 11.50% 01/04/2018 144A	GB	USD	350,000	360,500	0.14
Tenet Healthcare 10.00% 01/05/2018 144A	US	USD	315,000	352,800	0.14
Catalina Marketing 10.50% 01/10/2015 144A	US	USD	295,000	309,750	0.12
RDS Ultra-Deepwater 11.875% 15/03/2017 144A	KY	USD	275,000	281,188	0.11
Essar Steel Algoma 9.375% 15/03/2015 144A	CA	USD	260,000	262,600	0.10
Connacher Oil & Gas 11.75% 15/07/2014 144A	CA	USD	195,000	216,450	0.09
North American Energy 10.875% 01/06/2016 144A	US	USD	185,000	196,100	0.08
Georgia Gulf 9.00% 15/01/2017 144A	US	USD	185,000	193,547	0.08
Crown Castle GS III 7.75% 01/05/2017 144A	US	USD	170,000	185,300	0.07
Quintiles Transnational 9.50% 30/12/2014 144A	US	USD	155,000	158,100	0.06
Viasystems 12.00% 15/01/2015 144A	US	USD	130,000	141,050	0.06
Sequa 11.75% 01/12/2015 144A	US	USD	130,000	130,000	0.05
United Airlines 9.875% 01/08/2013 144A	US	USD	65,000	68,088	0.03
Drummond 9.00% 15/10/2014 144A	US	USD	65,000	67,600	0.03
Seagate Technology 10.00% 01/05/2014 144A	KY	USD	50,000	56,750	0.02
Sequa 13.50% 01/12/2015 144A	US	USD	55,168	56,547	0.02
Tenet Healthcare 10.00% 01/05/2018 Reg S	US	USD	25,000	28,000	0.01
Spansion	US	USD	3,008	25,357	0.01
				5,709,069	2.26
投資有価証券合計 (取得原価 : 220,876,975米ドル)				231,536,627	91.79

対象

対象 エクスポージャー (米ドル)	未実現(損)益 (米ドル)	純資産 比率(%)
-------------------------	------------------	--------------

為替先渡契約

(Bought : 購入, Sold : 売却, at : レート, 決済日 : 日 / 月 / 年)

Bought USD Sold JPY at 0.01126 19/05/2010	177,786	9,122	0.00
Bought CAD Sold USD at 1.05006 19/05/2010	191,417	6,490	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.36294 19/05/2010	300,198	2,375	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.35810 19/05/2010	469,229	2,034	0.00
Bought CAD Sold USD at 1.02870 19/05/2010	134,150	1,727	0.00
Bought GBP Sold USD at 0.66516 19/05/2010	168,381	1,557	0.00
Bought EUR Sold USD at 0.74588 19/05/2010	120,663	1,039	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.35966 19/05/2010	166,326	912	0.00
Bought EUR Sold USD at 0.74403 19/05/2010	111,554	682	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.35557 19/05/2010	277,210	682	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.36080 19/05/2010	83,839	530	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.35668 19/05/2010	110,884	364	0.00
Bought EUR Sold USD at 0.74055 19/05/2010	202,551	286	0.00
Bought CAD Sold USD at 1.01862 19/05/2010	95,227	281	0.00
Bought USD Sold CAD at 0.98577 19/05/2010	216,616	255	0.00
Bought USD Sold EUR at 1.35153 19/05/2010	96,009	(51)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 93.27680 19/05/2010	123,289	(124)	(0.00)
Bought USD Sold EUR at 1.35060 19/05/2010	109,532	(133)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.73768 19/05/2010	105,737	(262)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 92.81700 19/05/2010	92,817	(550)	(0.00)
Bought USD Sold EUR at 1.34672 19/05/2010	137,929	(563)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 92.51401 19/05/2010	89,803	(824)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.73230 19/05/2010	95,589	(932)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.73596 19/05/2010	211,968	(1,018)	(0.00)
Bought GBP Sold USD at 0.64870 19/05/2010	94,035	(1,479)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.72584 19/05/2010	93,685	(1,732)	(0.00)
Bought EUR Sold USD at 0.72868 19/05/2010	172,916	(2,534)	(0.00)
Bought USD Sold CAD at 0.95196 19/05/2010	116,185	(3,853)	(0.00)
Bought USD Sold GBP at 1.48865 19/05/2010	386,914	(7,308)	(0.00)
Bought JPY Sold USD at 88.37950 19/05/2010	156,722	(8,377)	(0.00)
Bought USD Sold CAD at 0.94711 19/05/2010	334,770	(12,751)	(0.01)
Bought GBP Sold USD at 0.63824 19/05/2010	444,971	(14,055)	(0.01)
Bought JPY Sold USD at 89.95400 19/05/2010	556,618	(20,368)	(0.01)
		<u>(48,578)</u>	<u>(0.03)</u>

対象

通貨	対象 エクスポージャー (米ドル)	未実現(損)益 (米ドル)	純資産 比率(%)
----	-------------------------	------------------	--------------

先物

Euro Bund Future 08/06/2010	EUR	(370,050)	(2,846)	(0.00)
Long Gilt Future 28/06/2010	GBP	(114,750)	(3,629)	(0.00)
			<u>(6,475)</u>	<u>(0.00)</u>

地域別		
	国コード	%
アメリカ合衆国	US	57.91
ドイツ	DE	4.21
カナダ	CA	3.73
アルゼンチン	AR	3.24
英国	GB	3.23
ベネズエラ	VE	2.36
オランダ	NL	1.88
国際機関	99	1.65
バミューダ	BM	1.64
イタリア	IT	1.53
フランス	FR	1.05
ルクセンブルグ	LU	1.00
メキシコ	MX	0.85
ロシア	RU	0.82
トルコ	TR	0.81
インドネシア	ID	0.68
日本	JP	0.62
コロンビア	CO	0.49
ブラジル	BR	0.40
フィリピン	PH	0.38
ケイマン諸島	KY	0.34
ベトナム	VN	0.32
エジプト	EG	0.30
ウルグアイ	UY	0.25
オーストラリア	AU	0.20
エルサルバドル	SV	0.19
コンゴ民主共和国	CD	0.19
イラク	IQ	0.16
ドミニカ共和国	DO	0.14
アイルランド	IE	0.14
ペルー	PE	0.13
ウクライナ	UA	0.12
マーシャル諸島	MH	0.11
パキスタン	PK	0.11
リトアニア	LT	0.11
セルビア	RS	0.09
スリランカ	LK	0.08
ガーナ	GH	0.06
リベリア	LR	0.05
カタール	QA	0.04
インド	IN	0.04
カザフスタン	KZ	0.04
南アフリカ	ZA	0.04
スペイン	ES	0.03
スイス	CH	0.03
現金その他純資産		8.21
合計		100.00

部門別	
	%
政府	43.74
金融	12.74
一般消費財・サービス	9.22
電気通信サービス	5.44
素材	3.76
エネルギー	3.66
資本財・サービス	3.29
ヘルスケア	3.24
情報技術	2.96
公益事業	2.59
生活必需品	1.15
現金その他純資産	8.21
合計	100.00

添付の財務書類に対する注記は、当財務書類の一部である。

3 販売及び買戻しの実績

平成22年4月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに平成22年4月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

	販売口数	買戻口数	発行済口数
クラスA	3,339,080 (3,339,080)	338,160 (338,160)	6,088,740 (6,088,740)
クラスB	5,707,200 (5,707,200)	2,212,800 (2,212,800)	18,032,430 (18,032,430)

（注）（ ）内の数字は、日本における販売、買戻および発行済口数である。

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額

資本金は、50万ユーロ (6,224万円) で、平成22年4月末日現在全額払込済である。また、1株1,000ユーロ (124,480円) の記名株式500株を発行済である。

直近5年間において資本の額の増減はない。

(注) ユーロの円貨換算は、便宜上、平成22年4月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1ユーロ = 124.48円) による。以下、別段の表示がない限り、ユーロの金額表示はすべてこれによる。

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社の目的は、投資信託を設定、管理および運用し、ならびに投資信託の不可分の共有権を証する証明書または確認書を発行することにある。サブ・ファンドおよび受益者に代わり、受益証券、債券、投資信託の受益証券等の購入、売却、申込みおよび交換ならびにサブ・ファンドの資産に直接または間接に付随する権利の行使を含む管理運用業務を行う。

管理会社は、ファンドの受益者のためにすべての現金、有価証券およびその他資産の保管を保管受託銀行であるブラウン・ブラザーズ・ハリマン (ルクセンブルグ) エス・シー・エイに委託しており、管理事務業務および登録・名義書換の遂行業務を管理事務代行会社、所在地事務代行会社および登録・名義書換事務代行会社である F I L (ルクセンブルグ) エス・エイに委託している。

平成22年4月末日現在、管理会社は3本のサブ・ファンドを有するフィデリティ・ワールド・ファンズを含む4本のルクセンブルグ籍のアンブレラ型オープン・エンド契約型投資信託を管理しており、その純資産額は、257,643,849.33米ドルおよび143,617,913,531.00円の合計額である。

(3) その他

本書提出前6か月以内において、管理会社およびファンドに重要な影響を及ぼした事実、または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

(2) その他の訂正

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

2 投資方針

(3) 運用体制

< 訂正前 >

(前略)

フィデリティの運用・調査体制

(2009年12月末日現在)

(単位：人)

拠点		米国	欧州	日本	アジア・パシフィック	総計
ポートフォリオ・マネージャー	株式	<u>104</u>	<u>59</u>	16	<u>26</u>	<u>205</u>
	ハイ・イールド債券	11	0	0	0	11
	投資適格債券	<u>23</u>	<u>7</u>	0	2	<u>32</u>
アナリスト	株式	<u>215</u>	<u>96</u>	<u>36</u>	48	<u>395</u>
	ハイ・イールド債券	28	0	0	0	28
	投資適格債券	63	<u>20</u>	0	<u>7</u>	<u>90</u>
トレーダー	株式	<u>42</u>	13	0	15	<u>70</u>
	ハイ・イールド債券	<u>4</u>	0	0	0	<u>4</u>
	投資適格債券	<u>31</u>	8	0	4	<u>43</u>
合計		<u>521</u>	203	<u>52</u>	<u>102</u>	<u>878</u>
運用に関するコンプライアンス部門		<u>47</u>	<u>8</u>	<u>5</u>	<u>10</u>	<u>70</u>

FMR LLCおよびFIL Limitedとその関係会社を含む。

アナリストには、リサーチ・アナリストとリサーチ・アソシエイトを含む。管理職等は除く。

上表中の数値は、将来変更となることがある。

(後略)

< 訂正後 >

（前略）

フィデリティの運用・調査体制

（平成22年3月末日現在）

（単位：人）

拠点		米国	欧州	日本	アジア・パシフィック	総計
ポートフォリオ・マネージャー	株式	106	61	16	23	206
	ハイ・イールド債券	11	0	0	0	11
	投資適格債券	25	8	0	2	35
アナリスト	株式	211	94	35	48	388
	ハイ・イールド債券	28	0	0	0	28
	投資適格債券	63	19	0	6	88
トレーダー	株式	39	13	0	15	67
	ハイ・イールド債券	3	0	0	0	3
	投資適格債券	29	8	0	4	41
合計		515	203	51	98	867
運用に関するコンプライアンス部門		48	9	4	12	73

FMR LLCおよびFIL Limitedとその関係会社を含む。

アナリストには、リサーチ・アナリストとリサーチ・アソシエイトを含む。管理職等は除く。

上表中の数値は、将来変更となることがある。

（後略）