

アライアンス・バーンスタイン・ハイ・イールド・オープン

2010年6月30日 現在

| 通貨  | 銘柄                       | 償還日        | クーポン(%) | 数量        | 評価金額(円)     | 保有比率(%) |
|-----|--------------------------|------------|---------|-----------|-------------|---------|
| 米ドル | PEABODY ENERGY CORP      | 2013/3/15  | 6.875   | 3,115,000 | 278,371,352 | 1.17%   |
| 米ドル | DIRECTV HOL / FIN        | 2015/6/15  | 6.375   | 2,960,000 | 270,412,576 | 1.13%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF TURKEY       | 2025/2/5   | 7.375   | 2,485,000 | 247,082,059 | 1.04%   |
| 米ドル | NEXTEL COMMUNICATIONS    | 2015/8/1   | 7.375   | 2,850,000 | 239,559,600 | 1.00%   |
| 米ドル | WMG HOLDINGS CORP        | 2014/12/15 | 9.5     | 2,590,000 | 227,444,476 | 0.95%   |
| 米ドル | QWEST CORP               | 2012/3/15  | 8.875   | 2,335,000 | 221,579,358 | 0.93%   |
| 米ドル | CASE NEW HOLLAND INC     | 2014/3/1   | 7.125   | 2,415,000 | 220,623,774 | 0.92%   |
| 米ドル | NRG ENERGY INC           | 2017/1/15  | 7.375   | 2,450,000 | 214,608,240 | 0.90%   |
| 米ドル | SPRINT CAP CORP          | 2028/11/15 | 6.875   | 2,830,000 | 206,578,680 | 0.87%   |
| 米ドル | KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB  | 2013/7/2   | 8.375   | 2,119,000 | 203,191,334 | 0.85%   |
| 米ドル | WYNN LAS VEGAS LLC       | 2014/12/1  | 6.625   | 2,110,000 | 187,159,532 | 0.78%   |
| 米ドル | AMERICAN GENERAL FINANCE | 2067/1/15  | 6       | 3,705,000 | 185,217,396 | 0.78%   |
| 米ドル | HCA INC                  | 2013/7/15  | 6.75    | 2,075,000 | 180,842,060 | 0.76%   |
| 米ドル | AMERICAN GENERAL FINANCE | 2017/12/15 | 6.9     | 2,560,000 | 180,074,496 | 0.75%   |
| 米ドル | MOSAIC CO                | 2016/12/1  | 7.625   | 1,850,000 | 179,955,313 | 0.75%   |
| 米ドル | QUEBECOR MEDIA           | 2016/3/15  | 7.75    | 2,065,000 | 179,056,976 | 0.75%   |
| 米ドル | HCA INC                  | 2016/11/15 | 9.625   | 1,856,559 | 175,767,124 | 0.74%   |
| 米ドル | HCA INC                  | 2015/1/15  | 6.375   | 2,105,000 | 174,376,937 | 0.73%   |
| 米ドル | US WEST COMMUNICATIONS   | 2033/9/15  | 6.875   | 2,145,000 | 174,131,958 | 0.73%   |
| 米ドル | CHESAPEAKE ENERGY        | 2016/1/15  | 6.625   | 1,895,000 | 170,184,644 | 0.71%   |
| 米ドル | CASE NEW HOLLAND INC     | 2017/12/1  | 7.875   | 1,873,000 | 168,208,886 | 0.71%   |
| 米ドル | FIRST DATA CORP          | 2015/9/24  | 9.875   | 2,408,000 | 164,056,077 | 0.69%   |
| 米ドル | FREEMPORT-MCMORAN C&G    | 2017/4/1   | 8.375   | 1,685,000 | 163,624,958 | 0.69%   |
| 米ドル | DYNEGY HOLDINGS INC      | 2016/5/1   | 8.375   | 2,215,000 | 157,766,476 | 0.66%   |
| 米ドル | CITIZENS COMMUNICATIONS  | 2013/1/15  | 6.25    | 1,770,000 | 157,196,886 | 0.66%   |
| 米ドル | COMMUNITY HEALTH SYSTEMS | 2015/7/15  | 8.875   | 1,662,000 | 151,281,556 | 0.63%   |
| 米ドル | EDISON MISSION ENERGY    | 2017/5/15  | 7       | 2,625,000 | 150,969,000 | 0.63%   |
| 米ドル | GAZ CAPITAL SA           | 2019/4/23  | 9.25    | 1,457,000 | 148,897,241 | 0.62%   |
| 米ドル | BOMBARDIER INC           | 2014/11/15 | 8       | 1,605,000 | 147,335,790 | 0.62%   |
| 米ドル | MAJAPAHIT HOLDING BV     | 2019/8/7   | 8       | 1,500,000 | 146,987,400 | 0.62%   |
| 米ドル | EDISON MISSION ENERGY    | 2013/6/15  | 7.5     | 1,865,000 | 142,738,148 | 0.60%   |
| 米ドル | AMKOR TECHNOLOGIES INC   | 2016/6/1   | 9.25    | 1,520,000 | 141,214,080 | 0.59%   |
| 米ドル | OWENS BROCKWAY GLASS     | 2014/12/1  | 6.75    | 1,555,000 | 140,682,094 | 0.59%   |
| 米ドル | ALLIED WASTE NORTH AMER  | 2016/5/15  | 7.125   | 1,475,000 | 140,296,100 | 0.59%   |
| 米ドル | MIRANT AMERICAS GENER    | 2021/10/1  | 8.5     | 1,695,000 | 139,475,448 | 0.58%   |
| 米ドル | FOREST OIL               | 2019/6/15  | 7.25    | 1,630,000 | 139,174,616 | 0.58%   |
| 米ドル | COUNTRYWIDE FINANCIAL CO | 2016/5/15  | 6.25    | 1,498,000 | 138,116,475 | 0.58%   |
| 米ドル | PETROHAWK ENERGY         | 2013/7/15  | 9.125   | 1,493,000 | 137,714,917 | 0.58%   |
| 米ドル | CONTINENTAL AIRLINES INC | 2011/12/1  | 8.75    | 1,550,000 | 137,315,430 | 0.58%   |
| 米ドル | CRICKET COMMUNICATIONS   | 2014/11/1  | 9.375   | 1,510,000 | 135,274,860 | 0.57%   |
| 米ドル | DAVITA INC               | 2015/3/15  | 7.25    | 1,525,000 | 135,269,330 | 0.57%   |
| 米ドル | HANSON AUSTRALIA FUNDING | 2013/3/15  | 5.25    | 1,548,000 | 134,912,534 | 0.57%   |
| 米ドル | AES CORPORATION          | 2014/3/1   | 7.75    | 1,500,000 | 134,710,800 | 0.56%   |
| 米ドル | PLAINS EXPL & PROD       | 2015/6/15  | 7.75    | 1,540,000 | 134,215,312 | 0.56%   |
| 米ドル | CABLEVISION SYSTEMS CORP | 2020/4/15  | 8       | 1,500,000 | 134,047,200 | 0.56%   |
| 米ドル | RRI ENERGY INC           | 2017/6/15  | 7.875   | 1,590,000 | 132,242,208 | 0.55%   |
| 米ドル | LIMITED BRANDS           | 2014/11/1  | 5.25    | 1,494,000 | 131,197,702 | 0.55%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF ARGENTINA    | 2015/10/3  | 7       | 1,912,200 | 131,156,275 | 0.55%   |
| 米ドル | COUCHE-TARD              | 2013/12/15 | 7.5     | 1,443,000 | 128,474,619 | 0.54%   |
| 米ドル | SERVICE CORP INT         | 2016/4/1   | 6.75    | 1,460,000 | 127,888,992 | 0.54%   |
| 米ドル | EL PASO ENERGY           | 2012/12/15 | 7.375   | 1,370,000 | 126,994,831 | 0.53%   |
| 米ドル | POWER SECTOR ASSETS & LI | 2019/5/27  | 7.25    | 1,290,000 | 126,834,789 | 0.53%   |
| 米ドル | EVRAZ GROUP SA           | 2015/11/10 | 8.25    | 1,450,000 | 126,371,560 | 0.53%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF TURKEY       | 2036/3/17  | 6.875   | 1,387,000 | 126,096,608 | 0.53%   |
| 米ドル | TESORO CORP              | 2012/11/1  | 6.25    | 1,420,000 | 125,641,600 | 0.53%   |
| 米ドル | INEOS GROUP HOLD PLC     | 2016/2/15  | 8.5     | 1,820,000 | 125,606,208 | 0.53%   |
| 米ドル | TOLL BROS FINANCE CORP   | 2015/5/15  | 5.15    | 1,429,000 | 125,411,244 | 0.53%   |
| 米ドル | IASIS HEALTHCARE         | 2014/6/15  | 8.75    | 1,390,000 | 122,987,200 | 0.52%   |
| 米ドル | STEEL DYNAMICS INC       | 2016/4/15  | 7.75    | 1,355,000 | 120,489,852 | 0.51%   |
| 米ドル | ENTERPRISE PRODUCTS OPER | 2066/8/1   | 8.375   | 1,325,000 | 117,089,455 | 0.49%   |
| 米ドル | AQUILA INC               | 2012/7/1   | 11.875  | 1,145,000 | 116,776,537 | 0.49%   |
| 米ドル | HILCORP ENERGY/FINANCE   | 2015/11/1  | 7.75    | 1,330,000 | 116,207,420 | 0.49%   |
| 米ドル | DR HORTON                | 2016/4/15  | 6.5     | 1,335,000 | 113,986,572 | 0.48%   |
| 米ドル | SENSUS METERING SYSTEMS  | 2013/12/15 | 8.625   | 1,320,000 | 113,873,760 | 0.48%   |
| 米ドル | CLEAR CHANNEL            | 2013/1/15  | 5.75    | 1,680,000 | 113,714,496 | 0.48%   |
| 米ドル | ECHOSTAR DBS CORP        | 2011/10/1  | 6.375   | 1,245,000 | 113,462,328 | 0.48%   |
| 米ドル | ALLTEL CORP              | 2032/7/1   | 7.875   | 1,020,000 | 113,357,108 | 0.48%   |
| 米ドル | PETROLEOS DE VENEZUELA   | 2027/4/12  | 5.375   | 2,853,000 | 112,963,964 | 0.47%   |
| 米ドル | VEDANTA RESOURCES PLC    | 2014/1/15  | 8.75    | 1,193,000 | 112,417,822 | 0.47%   |
| 米ドル | RRI ENERGY INC           | 2014/6/15  | 7.625   | 1,285,000 | 111,991,348 | 0.47%   |
| 米ドル | AES CORPORATION          | 2017/10/15 | 8       | 1,240,000 | 110,675,208 | 0.46%   |
| 米ドル | GENWORTH FINANCIAL INC   | 2066/11/15 | 6.15    | 1,825,000 | 110,207,370 | 0.46%   |
| 米ドル | KINDER MORGAN FIN        | 2016/1/5   | 5.7     | 1,290,000 | 109,002,936 | 0.46%   |

アライアンス・バーンスタイン・ハイ・イールド・オープン

2010年6月30日 現在

| 通貨  | 銘柄                       | 償還日        | クーポン(%) | 数量        | 評価金額(円)     | 保有比率(%) |
|-----|--------------------------|------------|---------|-----------|-------------|---------|
| 米ドル | REPUBLIC OF INDONESIA    | 2038/1/17  | 7.75    | 1,043,000 | 108,434,452 | 0.45%   |
| 米ドル | NOVELIS INC              | 2015/2/15  | 7.25    | 1,265,000 | 108,009,748 | 0.45%   |
| 米ドル | ALLBRITTON COMMUNICATION | 2018/5/15  | 8       | 1,250,000 | 107,558,500 | 0.45%   |
| 米ドル | CHESAPEAKE ENERGY        | 2017/8/15  | 6.5     | 1,200,000 | 105,114,240 | 0.44%   |
| 米ドル | GOODYEAR TIRE            | 2015/7/1   | 9       | 1,147,000 | 104,277,440 | 0.44%   |
| 米ドル | XL CAPITAL LTD           | 2049/12/31 | 6.5     | 1,650,000 | 102,194,400 | 0.43%   |
| ユーロ | RHODIA SA                | 2013/10/15 | 3.394   | 1,000,000 | 100,802,350 | 0.42%   |
| 米ドル | OWENS CORNING            | 2036/12/1  | 7       | 1,110,000 | 97,270,939  | 0.41%   |
| 米ドル | TECK RESOURCES           | 2014/5/15  | 9.75    | 915,000   | 95,929,366  | 0.40%   |
| 米ドル | SUNGARD DATA SYSTEM      | 2013/8/15  | 9.125   | 1,065,000 | 95,880,246  | 0.40%   |
| 米ドル | NRG ENERGY INC           | 2016/2/1   | 7.375   | 1,065,000 | 93,760,044  | 0.39%   |
| 米ドル | RUSSIA AGRICULTURE BANK  | 2018/5/29  | 7.75    | 989,000   | 93,413,424  | 0.39%   |
| 米ドル | GEOPHYSIQUE-VERITAS      | 2015/5/15  | 7.5     | 1,115,000 | 93,229,164  | 0.39%   |
| 米ドル | TESORO CORP              | 2017/6/1   | 6.5     | 1,145,000 | 92,445,010  | 0.39%   |
| 米ドル | MOBILE TELESYSTEMS FIN   | 2012/1/28  | 8       | 1,000,000 | 92,019,200  | 0.39%   |
| 米ドル | ASSOCIATED MATERIALS INS | 2014/3/1   | 11.25   | 1,010,000 | 91,598,920  | 0.38%   |
| 米ドル | MOTOROLA INC             | 2025/5/15  | 7.5     | 940,000   | 91,433,427  | 0.38%   |
| 米ドル | SEAGATE TECHNOLOGY HDD   | 2011/10/1  | 6.375   | 1,004,000 | 90,943,726  | 0.38%   |
| 米ドル | FREESCALE SEMICONDUCTOR  | 2016/12/15 | 10.125  | 1,275,000 | 90,813,660  | 0.38%   |
| 米ドル | OPTI CANADA INC          | 2014/12/15 | 8.25    | 1,165,000 | 90,709,696  | 0.38%   |
| 米ドル | ROYAL CARIBBEAN CRUISES  | 2011/2/2   | 8.75    | 1,000,000 | 90,692,000  | 0.38%   |
| 米ドル | HERTZ CORPORATION        | 2014/1/1   | 8.875   | 1,015,000 | 90,480,754  | 0.38%   |
| 米ドル | RUSSIA AGRICULTURE BANK  | 2014/1/14  | 7.125   | 967,000   | 90,052,068  | 0.38%   |
| 米ドル | AMERICAN GENERAL FINANCE | 2012/7/15  | 4.875   | 1,115,000 | 89,529,594  | 0.38%   |
| 米ドル | ALBERTSON'S INC          | 2029/8/1   | 7.45    | 1,210,000 | 88,860,464  | 0.37%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF VENEZUELA    | 2025/4/21  | 7.65    | 1,781,000 | 88,640,370  | 0.37%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF GHANA        | 2017/10/4  | 8.5     | 946,000   | 87,887,184  | 0.37%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 2025/3/16  | 10.625  | 686,000   | 87,707,570  | 0.37%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF COLOMBIA     | 2037/9/18  | 7.375   | 846,000   | 87,579,274  | 0.37%   |
| 米ドル | ARCH WESTERN FINANCE LLC | 2013/7/1   | 6.75    | 985,000   | 87,370,682  | 0.37%   |
| 米ドル | WINDSTREAM CORP          | 2016/8/1   | 8.625   | 974,000   | 86,718,142  | 0.36%   |
| 米ドル | COLUMBUS INTL INC        | 2014/11/20 | 11.5    | 919,000   | 86,604,408  | 0.36%   |
| 米ドル | CRUM&FORSTER HLDG CORP   | 2017/5/1   | 7.75    | 970,000   | 86,254,728  | 0.36%   |
| 米ドル | NOBLE GROUP LTD          | 2020/1/29  | 6.75    | 1,000,000 | 86,046,800  | 0.36%   |
| 米ドル | ECHOSTAR DBS CORP        | 2016/2/1   | 7.125   | 960,000   | 85,790,208  | 0.36%   |
| 米ドル | RANGE RESOURCES CORP     | 2016/5/15  | 7.5     | 955,000   | 85,554,630  | 0.36%   |
| 米ドル | RUSSIA AGRICULTURE BANK  | 2017/5/15  | 6.299   | 974,000   | 85,533,174  | 0.36%   |
| 米ドル | MACYS RETAIL HLDGS INC   | 2016/12/1  | 5.9     | 955,000   | 84,709,646  | 0.36%   |
| 米ドル | AMERICAN EXPRESS CO      | 2066/9/1   | 6.8     | 1,000,000 | 84,277,200  | 0.35%   |
| 米ドル | HCA INC                  | 2016/2/15  | 6.5     | 1,020,000 | 84,270,564  | 0.35%   |
| 米ドル | HARRAHS OPERATING CO INC | 2016/6/1   | 6.5     | 1,463,000 | 83,816,440  | 0.35%   |
| 米ドル | JOSTENS IH CORP          | 2012/10/1  | 7.625   | 945,000   | 83,613,600  | 0.35%   |
| 米ドル | GEORGIA-PACIFIC          | 2015/1/15  | 7       | 930,000   | 83,314,980  | 0.35%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF BRAZIL       | 2037/1/20  | 7.125   | 792,000   | 83,061,272  | 0.35%   |
| 米ドル | OWENS CORNING            | 2016/12/1  | 6.5     | 870,000   | 81,864,138  | 0.34%   |
| 米ドル | ARAMARK CORP             | 2015/2/1   | 8.5     | 915,000   | 81,768,792  | 0.34%   |
| 米ドル | SERVICEMASTER            | 2015/7/15  | 10.75   | 890,000   | 81,503,352  | 0.34%   |
| 米ドル | VIAANT HOLDINGS          | 2017/7/15  | 10.125  | 902,000   | 81,405,139  | 0.34%   |
| ユーロ | CENTRAL EUROPEAN MEDIA   | 2016/9/15  | 11.625  | 750,000   | 81,261,788  | 0.34%   |
| 米ドル | BIOMET INC               | 2017/10/15 | 11.625  | 850,000   | 81,224,640  | 0.34%   |
| 米ドル | MASCO CORP               | 2016/10/3  | 6.125   | 945,000   | 80,851,843  | 0.34%   |
| 米ドル | WINDSTREAM CORP          | 2013/8/1   | 8.125   | 881,000   | 80,484,284  | 0.34%   |
| 米ドル | L-3 COMMUNICATIONS CORP  | 2015/1/15  | 5.875   | 920,000   | 80,384,080  | 0.34%   |
| 米ドル | CIT GROUP INC            |            |         | 26,854    | 80,333,977  | 0.34%   |
| 米ドル | STATER BROTHERS HLDGS    | 2012/6/15  | 8.125   | 905,000   | 80,174,493  | 0.34%   |
| 米ドル | US STEEL CORP            | 2018/2/1   | 7       | 915,000   | 80,149,608  | 0.34%   |
| 米ドル | STEEL CAP(SEVERSTAL)     | 2014/4/19  | 9.25    | 848,000   | 80,095,635  | 0.34%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF INDONESIA    | 2035/10/12 | 8.5     | 714,000   | 79,916,021  | 0.33%   |
| ユーロ | COMMERZBANK CAP 5.012    | 2049/3/29  | 0       | 1,350,000 | 78,593,490  | 0.33%   |
| 米ドル | ENERGY FUTURE HOLDINGS   | 2017/11/1  | 10.875  | 1,195,000 | 78,242,864  | 0.33%   |
| 米ドル | SLM CORP                 | 2010/7/26  | 4.5     | 875,000   | 77,613,550  | 0.33%   |
| 米ドル | NEWFIELD EXPLORATION CO  | 2018/5/15  | 7.125   | 885,000   | 77,521,752  | 0.32%   |
| 米ドル | DYNEGY-RSTN DNKM         | 2016/11/8  | 7.67    | 995,000   | 77,473,088  | 0.32%   |
| 米ドル | AFFINIA GROUP            | 2014/11/30 | 9       | 865,000   | 76,917,876  | 0.32%   |
| 米ドル | TNK-BP FINANCE SA        | 2016/7/18  | 7.5     | 835,000   | 76,558,979  | 0.32%   |
| 米ドル | ALLY FINANCIAL INC       |            |         | 1,069     | 76,191,246  | 0.32%   |
| 米ドル | TICKETMASTER             | 2016/8/1   | 10.75   | 800,000   | 75,915,840  | 0.32%   |
| 米ドル | SLM CORP                 | 2012/8/27  | 5.125   | 865,000   | 75,408,602  | 0.32%   |
| 米ドル | PIONEER NATURAL RECOURSE | 2016/7/15  | 5.875   | 850,000   | 75,156,859  | 0.32%   |
| 米ドル | WEYERHAEUSER CO          | 2032/3/15  | 7.375   | 845,000   | 73,546,173  | 0.31%   |
| 米ドル | ACCO BRANDS CORP         | 2015/8/15  | 7.625   | 900,000   | 73,261,440  | 0.31%   |
| 米ドル | CINCINNATI BELL INC      | 2018/3/15  | 8.75    | 900,000   | 72,863,280  | 0.31%   |
| 米ドル | IRON MOUNTAIN INC        | 2016/1/1   | 6.625   | 830,000   | 72,153,228  | 0.30%   |

アライアンス・バーンスタイン・ハイ・イールド・オープン

2010年6月30日 現在

| 通貨  | 銘柄                       | 償還日        | クーポン(%)  | 数量        | 評価金額(円)    | 保有比率(%) |
|-----|--------------------------|------------|----------|-----------|------------|---------|
| 米ドル | DYNEGY HOLDINGS INC      | 2019/6/1   | 7.75     | 1,150,000 | 71,989,540 | 0.30%   |
| 米ドル | CSC HOLDINGS INC         | 2018/7/15  | 7.625    | 800,000   | 71,491,840 | 0.30%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF DOMINICAN    | 2027/4/20  | 8.625    | 751,000   | 71,432,116 | 0.30%   |
| 米ドル | NATIONWIDE MUTUAL INSURA | 2039/8/15  | 9.375    | 690,000   | 71,246,140 | 0.30%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF PANAMA       | 2036/1/26  | 6.7      | 703,000   | 69,043,598 | 0.29%   |
| 米ドル | PLASTIPAK HOLDINGS       | 2015/12/15 | 8.5      | 770,000   | 68,333,989 | 0.29%   |
| 米ドル | GAZPROM                  | 2016/11/22 | 6.212    | 747,000   | 66,672,887 | 0.28%   |
| 米ドル | COMPLETE PRODUCT CPX     | 2016/12/15 | 8        | 780,000   | 66,598,896 | 0.28%   |
| 米ドル | ISTAR FINANCIAL          | 2011/4/1   | 5.125    | 827,000   | 66,587,394 | 0.28%   |
| 米ドル | CASE CORPORATION         | 2016/1/15  | 7.25     | 750,000   | 66,525,900 | 0.28%   |
| 米ドル | VIP FIN (VIMPELCOM)      | 2013/4/30  | 8.375    | 710,000   | 66,432,996 | 0.28%   |
| 米ドル | LIBERTY MEDIA CORP       | 2013/5/15  | 5.7      | 730,000   | 66,043,684 | 0.28%   |
| 米ドル | BANCO BMG SA             | 2016/1/15  | 9.15     | 700,000   | 65,652,160 | 0.28%   |
| ユーロ | SMURFIT KAPPA ACQUISITIO | 2019/11/15 | 7.75     | 600,000   | 65,332,860 | 0.27%   |
| 米ドル | HARRAHS OPERATING CO INC | 2017/6/1   | 11.25    | 700,000   | 64,877,960 | 0.27%   |
| 米ドル | RAINBOW NATL SRVCS       | 2012/9/1   | 8.75     | 730,000   | 64,751,876 | 0.27%   |
| 米ドル | MSM 2007-15AR 2A1        | 2037/11/25 | 5.449905 | 1,072,439 | 64,423,348 | 0.27%   |
| 米ドル | CCH II LLC/CCH II CAPITA | 2016/11/30 | 13.5     | 625,000   | 64,286,250 | 0.27%   |
| 米ドル | TRANSNEFT                | 2013/8/7   | 7.7      | 665,000   | 63,882,308 | 0.27%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 2019/1/15  | 9.875    | 540,000   | 63,367,164 | 0.27%   |
| 米ドル | RUSSIA AGRICULTURE BANK  | 2014/6/11  | 9        | 634,000   | 63,318,721 | 0.27%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 2019/6/17  | 8.375    | 577,000   | 63,050,406 | 0.26%   |
| 米ドル | RBS GLOBAL & REXNORD COR | 2018/5/1   | 8.5      | 734,000   | 62,508,908 | 0.26%   |
| 米ドル | NEWPAGE CORP             | 2012/5/1   | 10       | 1,300,000 | 62,400,520 | 0.26%   |
| 米ドル | HUNTSMAN INTL LLC        | 2016/6/30  | 5.5      | 800,000   | 62,289,920 | 0.26%   |
| 米ドル | E*TRADE FINANCIAL CORP   | 2013/9/15  | 7.375    | 747,000   | 60,806,995 | 0.25%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF EL SALVADOR  | 2035/6/15  | 7.65     | 644,000   | 60,399,987 | 0.25%   |
| 米ドル | PULTE HOMES INC          | 2014/1/15  | 5.25     | 705,000   | 60,273,129 | 0.25%   |
| 米ドル | TRAVELPORT INC           | 2014/9/1   | 9.875    | 680,000   | 60,015,984 | 0.25%   |
| 米ドル | CITGO PETROLEUM CORP     | 2017/7/1   | 11.5     | 682,000   | 59,815,356 | 0.25%   |
| 米ドル | EXPEDIA INC              | 2016/7/1   | 8.5      | 625,000   | 59,447,500 | 0.25%   |
| 米ドル | TYCO INTL FINANCE        | 2019/1/15  | 8.5      | 515,000   | 58,865,987 | 0.25%   |
| 米ドル | UKRAINE GOVERNMENT       | 2013/6/11  | 7.65     | 655,000   | 58,678,830 | 0.25%   |
| 米ドル | CIT GROUP INC            | 2017/5/1   | 7        | 715,086   | 57,497,348 | 0.24%   |
| ユーロ | ZIGGO BOND CO            | 2018/5/15  | 8        | 550,000   | 57,368,396 | 0.24%   |
| 米ドル | BEAR STEARNS CO          | 2017/1/22  | 5.55     | 615,000   | 56,974,347 | 0.24%   |
| 米ドル | EDISON MISSION ENERGY    | 2016/6/15  | 7.75     | 920,000   | 56,574,112 | 0.24%   |
| 米ドル | SOUTHWESTERN ENERGY CO   | 2018/2/1   | 7.5      | 600,000   | 56,406,000 | 0.24%   |
| 米ドル | RS FINANCE               | 2010/10/7  | 7.5      | 641,000   | 56,332,849 | 0.24%   |
| 米ドル | UKRAINE GOVERNMENT       | 2017/11/14 | 6.75     | 684,000   | 56,208,247 | 0.24%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF URUGUAY      | 2017/5/17  | 9.25     | 500,000   | 55,853,000 | 0.23%   |
| 米ドル | INEOS GROUP HOLD PLC     | 2016/2/15  | 8.5      | 800,000   | 55,565,440 | 0.23%   |
| 米ドル | CAPMARK FINANCIAL 7.875  | 2012/5/10  | 0        | 1,940,000 | 55,124,066 | 0.23%   |
| 米ドル | GSC HOLDINGS CORP        | 2012/10/1  | 8        | 595,000   | 54,093,354 | 0.23%   |
| 米ドル | SELECT MEDICAL CORP      | 2015/2/1   | 7.625    | 649,000   | 54,049,888 | 0.23%   |
| 米ドル | CATALENT PHARMA SOLUTION | 2015/4/15  | 9.5      | 633,016   | 53,348,816 | 0.22%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF TURKEY       | 2020/6/5   | 7        | 550,000   | 53,287,080 | 0.22%   |
| 米ドル | CSC HOLDINGS INC         | 2018/2/15  | 7.875    | 580,000   | 52,473,064 | 0.22%   |
| 米ドル | BAUSCH & LOMB            | 2015/11/1  | 9.875    | 575,000   | 52,275,090 | 0.22%   |
| 米ドル | GABONESE REPUBLIC        | 2017/12/12 | 8.2      | 553,000   | 51,620,559 | 0.22%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF VENEZUELA    | 2023/5/7   | 9        | 912,000   | 51,038,803 | 0.21%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF CROATIA      | 2019/11/5  | 6.75     | 550,000   | 50,984,932 | 0.21%   |
| 米ドル | GTL TRADE FINANCE INC    | 2017/10/20 | 7.25     | 538,000   | 50,815,391 | 0.21%   |
| 米ドル | HEXION US FIN            | 2014/11/15 | 4.93588  | 690,000   | 50,672,496 | 0.21%   |
| 米ドル | DTEK FINANCE BV          | 2015/4/28  | 9.5      | 601,000   | 50,517,656 | 0.21%   |
| 米ドル | ATF BANK                 | 2016/5/11  | 9        | 549,000   | 49,304,153 | 0.21%   |
| 米ドル | LIBERTY MUTUAL GROUP     | 2014/3/15  | 5.75     | 525,000   | 48,318,906 | 0.20%   |
| ユーロ | NORSKE SKOGINDUSTRIER    | 2017/6/26  | 7        | 670,000   | 47,673,582 | 0.20%   |
| 米ドル | VTB CAPITAL SA           | 2018/5/29  | 6.875    | 520,000   | 47,504,912 | 0.20%   |
| 米ドル | STARWOOD HOTELS RESORTS  | 2012/5/1   | 7.875    | 500,000   | 47,336,800 | 0.20%   |
| 米ドル | NEIMAN MARCUS            | 2015/10/15 | 9        | 524,671   | 46,655,004 | 0.20%   |
| 米ドル | VALE OVERSEAS LIMITED    | 2036/11/21 | 6.875    | 511,000   | 46,569,678 | 0.20%   |
| 米ドル | LIMITED BRANDS           | 2017/7/15  | 6.9      | 525,000   | 46,568,130 | 0.20%   |
| 米ドル | LEVI STRAUSS & CO        | 2016/4/1   | 8.875    | 504,000   | 46,154,707 | 0.19%   |
| 米ドル | AIFUL CORPORATION        | 2011/12/12 | 6        | 704,000   | 46,094,541 | 0.19%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF VENEZUELA    | 2020/12/9  | 6        | 955,000   | 45,629,136 | 0.19%   |
| 米ドル | TEREX CORP               | 2017/11/15 | 8        | 565,000   | 45,616,970 | 0.19%   |
| 米ドル | TRANSNEFT                | 2014/3/5   | 5.67     | 505,000   | 45,576,048 | 0.19%   |
| 米ドル | HERCULES OFFSHOR HERO    | 2017/10/15 | 10.5     | 580,000   | 45,545,080 | 0.19%   |
| 米ドル | WILLIAMS COS INC         | 2021/9/1   | 7.875    | 445,000   | 45,081,197 | 0.19%   |
| 米ドル | CENTERCREDIT INTERNATION | 2014/1/30  | 8.625    | 501,000   | 43,996,016 | 0.18%   |
| 米ドル | DEX ONE CORP             |            |          | 25,493    | 43,623,703 | 0.18%   |
| 米ドル | ECOPETROL SA             | 2019/7/23  | 7.625    | 433,000   | 43,196,600 | 0.18%   |

アライアンス・バーンスタイン・ハイ・イールド・オープン

2010年6月30日 現在

| 通貨  | 銘柄                       | 償還日        | クーポン(%) | 数量        | 評価金額(円)    | 保有比率(%) |
|-----|--------------------------|------------|---------|-----------|------------|---------|
| 米ドル | REPUBLIC OF PANAMA       | 2029/4/1   | 9.375   | 353,000   | 43,180,231 | 0.18%   |
| 米ドル | NRG ENERGY INC           | 2014/2/1   | 7.25    | 480,000   | 43,054,368 | 0.18%   |
| 米ドル | UNITED RENTALS NA INC    | 2013/11/15 | 7.75    | 489,000   | 41,968,718 | 0.18%   |
| 米ドル | TXU CORP                 | 2024/11/15 | 6.5     | 1,048,000 | 41,727,168 | 0.17%   |
| 米ドル | RAINBOW NATL SRVCS       | 2014/9/1   | 10.375  | 450,000   | 41,458,410 | 0.17%   |
| 米ドル | CIT GROUP INC            | 2016/5/1   | 7       | 510,775   | 41,351,935 | 0.17%   |
| 米ドル | WEST CORP                | 2014/10/15 | 9.5     | 465,000   | 41,348,916 | 0.17%   |
| 米ドル | TEXAS COMP ELEC HOLD     | 2015/11/1  | 10.25   | 694,000   | 40,987,918 | 0.17%   |
| 米ドル | PETROBRAS INTL FIN CO    | 2020/1/20  | 5.75    | 460,000   | 40,708,126 | 0.17%   |
| ユーロ | ABN AMRO BANK NV         | 2049/3/10  | 4.31    | 583,000   | 39,595,021 | 0.17%   |
| 米ドル | CROWN AMERICAS           | 2013/11/15 | 7.625   | 435,000   | 39,547,242 | 0.17%   |
| 米ドル | DJO FINANCE LLC          | 2014/11/15 | 10.875  | 425,000   | 39,296,180 | 0.16%   |
| 米ドル | REGENCY ENERGY PARTNERS  | 2013/12/15 | 8.375   | 430,000   | 39,282,908 | 0.16%   |
| 米ドル | LYONDELL CHEMICAL        | 2018/5/1   | 11      | 415,000   | 39,105,948 | 0.16%   |
| 米ドル | SANMINA-SCI CORP         | 2016/3/1   | 8.125   | 450,000   | 39,019,680 | 0.16%   |
| 米ドル | ENTERTAINMENT PROPERTIES | 2020/7/15  | 7.75    | 445,000   | 38,684,562 | 0.16%   |
| 米ドル | CCO HLDGS LLC/CAP CORP   | 2018/4/30  | 7.875   | 433,000   | 38,599,179 | 0.16%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF LITHUANIA    | 2015/11/15 | 6.75    | 412,000   | 38,094,179 | 0.16%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF INDONESIA    | 2018/1/17  | 6.875   | 380,000   | 37,993,312 | 0.16%   |
| 米ドル | SIERRA PACIFIC POW       | 2016/5/15  | 6       | 378,000   | 37,491,335 | 0.16%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF BRAZIL       | 2025/2/4   | 8.75    | 315,000   | 37,347,408 | 0.16%   |
| 米ドル | GEORGIA-PACIFIC          | 2017/1/15  | 7.125   | 420,000   | 37,347,408 | 0.16%   |
| 米ドル | PRINCIPAL FINANCIAL      | 2014/5/15  | 7.875   | 363,000   | 37,157,271 | 0.16%   |
| 米ドル | CALIFORNIA ST            | 2036/3/1   | 7.95    | 385,000   | 35,782,688 | 0.15%   |
| 米ドル | ALFA BOND ISSUANCE       | 2015/12/9  | 8.625   | 400,000   | 35,480,480 | 0.15%   |
| 米ドル | GOODYEAR TIRE            | 2011/12/1  | 8.625   | 384,000   | 35,420,314 | 0.15%   |
| 米ドル | LBI ESCROW CORP          | 2017/11/1  | 8       | 385,000   | 35,086,744 | 0.15%   |
| 米ドル | ELAN CORP PLC            | 2016/10/15 | 8.75    | 405,000   | 34,983,333 | 0.15%   |
| 米ドル | HARRAHS OPERATING CO INC | 2015/6/1   | 5.625   | 596,000   | 34,936,328 | 0.15%   |
| 米ドル | ROYAL CARIBBEAN CRUISES  | 2013/6/15  | 7       | 395,000   | 34,774,852 | 0.15%   |
| 米ドル | SOUTHERN PERU            | 2035/7/27  | 7.5     | 360,000   | 34,556,466 | 0.14%   |
| 米ドル | ASBURY AUTOMOTIVE GROUP  | 2014/3/15  | 8       | 390,000   | 34,079,311 | 0.14%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF COLOMBIA     | 2020/2/25  | 11.75   | 255,000   | 33,223,134 | 0.14%   |
| 米ドル | HANSON PLC               | 2016/8/15  | 6.125   | 387,000   | 32,880,650 | 0.14%   |
| 米ドル | MMG FIDUCIARY            | 2016/2/1   | 6.75    | 390,000   | 32,433,662 | 0.14%   |
| 米ドル | CONTINENTAL AIRLINES INC | 2018/7/2   | 7.875   | 395,039   | 31,283,006 | 0.13%   |
| 米ドル | IRON MOUNTAIN INC        | 2015/1/15  | 7.75    | 330,000   | 29,417,388 | 0.12%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF VENEZUELA    | 2038/3/31  | 7       | 611,000   | 29,257,965 | 0.12%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF INDONESIA    | 2037/2/17  | 6.625   | 313,000   | 28,940,481 | 0.12%   |
| 米ドル | DIGICEL SA               | 2014/4/1   | 12      | 287,000   | 28,314,042 | 0.12%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF VENEZUELA    | 2028/5/7   | 9.25    | 507,800   | 28,305,991 | 0.12%   |
| 米ドル | CLEAR CHANNEL            | 2014/9/15  | 5.5     | 580,000   | 28,225,120 | 0.12%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF ARGENTINA    | 2033/12/31 | 8.28    | 471,127   | 28,137,577 | 0.12%   |
| 米ドル | ACCO BRANDS CORP         | 2015/3/15  | 10.625  | 290,000   | 27,711,936 | 0.12%   |
| ユーロ | FOODCORP LTD             | 2012/6/15  | 8.875   | 257,000   | 27,430,098 | 0.11%   |
| 米ドル | ONCOR ELECTRIC DELIVERY  | 2018/9/1   | 6.8     | 255,000   | 26,465,695 | 0.11%   |
| 米ドル | K HOVNANIAN ENTERPRISES  | 2016/10/15 | 10.625  | 300,000   | 26,444,460 | 0.11%   |
| 米ドル | MARINER ENERGY           | 2016/6/30  | 11.75   | 237,000   | 26,107,351 | 0.11%   |
| 米ドル | NOVA CHEMICALS CORP      | 2019/11/1  | 8.625   | 298,000   | 26,103,370 | 0.11%   |
| 米ドル | ANTERO RESOURCES FINANCE | 2017/12/1  | 9.375   | 293,000   | 25,957,046 | 0.11%   |
| 米ドル | CIT GROUP INC            | 2014/5/1   | 7       | 306,465   | 25,387,376 | 0.11%   |
| 米ドル | BOYD GAMING CORP         | 2014/4/15  | 6.75    | 325,000   | 25,161,500 | 0.11%   |
| 米ドル | CIT GROUP INC            | 2015/5/1   | 7       | 306,465   | 25,150,111 | 0.11%   |
| ユーロ | REPUBLIC OF ARGENTINA    | 2033/12/31 | 7.82    | 394,264   | 25,078,314 | 0.11%   |
| 米ドル | SANDRIDGE ENERGY INC     | 2020/1/15  | 8.75    | 296,000   | 24,749,626 | 0.10%   |
| 米ドル | NOBLE GROUP LTD          | 2013/5/30  | 8.5     | 249,000   | 24,399,908 | 0.10%   |
| 米ドル | DOMTAR CORP              | 2015/8/15  | 7.125   | 251,000   | 23,318,904 | 0.10%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF URUGUAY      | 2033/1/15  | 7.875   | 223,178   | 23,103,744 | 0.10%   |
| 米ドル | IIRSA NORTE FINANCE LTD  | 2024/5/30  | 8.75    | 224,876   | 21,986,214 | 0.09%   |
| 米ドル | HEXION US FIN/NOVA SCOTI | 2018/2/1   | 8.875   | 273,000   | 21,860,311 | 0.09%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 2030/2/2   | 9.5     | 181,000   | 21,700,162 | 0.09%   |
| 米ドル | EMPRESAS PUBLIC MEDELLIN | 2019/7/29  | 7.625   | 213,000   | 21,343,367 | 0.09%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF EL SALVADOR  | 2019/12/1  | 7.375   | 217,000   | 20,928,174 | 0.09%   |
| 米ドル | USIMINAS COMMERCIAL LTD  | 2018/1/18  | 7.25    | 206,000   | 19,639,463 | 0.08%   |
| 米ドル | EURASIAN DEVELOPMENT BAN | 2014/9/29  | 7.375   | 195,000   | 18,228,428 | 0.08%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF URUGUAY      | 2036/3/21  | 7.625   | 175,000   | 17,961,440 | 0.08%   |
| 米ドル | CIT GROUP INC            | 2013/5/1   | 7       | 204,309   | 17,354,170 | 0.07%   |
| 米ドル | CSC HOLDINGS INC         | 2012/4/15  | 6.75    | 183,000   | 16,758,554 | 0.07%   |
| 米ドル | TRANSNEFT                | 2018/8/7   | 8.7     | 152,000   | 15,499,926 | 0.06%   |
| 米ドル | UKRAINE GOVERNMENT       | 2012/6/26  | 6.385   | 150,000   | 13,172,460 | 0.06%   |
| 米ドル | CCO HLDGS LLC/CAP CORP   | 2020/4/30  | 8.125   | 145,000   | 13,150,340 | 0.06%   |
| 米ドル | GEOPHYSIQUE-VERITAS      | 2017/5/15  | 7.75    | 150,000   | 12,542,040 | 0.05%   |
| 米ドル | GOODMAN GLOBAL GROUP INC | 2014/12/15 | 0       | 234,000   | 12,500,233 | 0.05%   |

アライアンス・バーンスタイン・ハイ・イールド・オープン

2010年6月30日 現在

| 通貨  | 銘柄                       | 償還日        | クーポン(%) | 数量        | 評価金額(円)        | 保有比率(%) |
|-----|--------------------------|------------|---------|-----------|----------------|---------|
| 米ドル | BOISE PAPER HOLD         | 2017/11/1  | 9       | 131,000   | 12,170,424     | 0.05%   |
| 米ドル | US STEEL CORP            | 2037/6/1   | 6.65    | 137,000   | 10,424,714     | 0.04%   |
| 米ドル | NAVISTAR INTL CORP       | 2021/11/1  | 8.25    | 115,000   | 10,353,266     | 0.04%   |
| 米ドル | SINCLAIR TELEVISION GROU | 2017/11/1  | 9.25    | 105,000   | 9,406,530      | 0.04%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF VENEZUELA    | 2034/1/13  | 9.375   | 169,000   | 9,368,130      | 0.04%   |
| 米ドル | REPUBLIC OF SERBIA       | 2024/11/1  | 6.75    | 106,333   | 9,267,247      | 0.04%   |
| 米ドル | BRODER BROS CO           | 2013/10/15 | 12      | 128,401   | 8,776,310      | 0.04%   |
| 米ドル | ASBURY AUTOMOTIVE GROUP  | 2017/3/15  | 7.625   | 77,000    | 6,404,182      | 0.03%   |
| 米ドル | AUTONATION INC           | 2018/4/15  | 6.75    | 73,000    | 6,362,154      | 0.03%   |
| 米ドル | CLEAR CHANNEL WORLDWIDE  | 2017/12/15 | 9.25    | 65,000    | 5,808,712      | 0.02%   |
| 米ドル | ANADARKO PETROLEUM CORP  | 2016/9/15  | 5.95    | 69,000    | 5,253,273      | 0.02%   |
| 米ドル | WDAC SUBSIDIARY 8.375    | 2014/12/1  | 0       | 1,155,000 | 4,981,977      | 0.02%   |
| 米ドル | GALLERY CAPITAL SA10.125 | 2013/5/15  | 0       | 208,000   | 3,680,768      | 0.02%   |
| 米ドル | CHARTER COMM.-CW14       |            |         | 5,287     | 2,596,255      | 0.01%   |
| 米ドル | CLEAR CHANNEL WORLDWIDE  | 2017/12/15 | 9.25    | 17,000    | 1,511,681      | 0.01%   |
| 米ドル | PHASE METRICS INC        |            |         | 650,454   | 575,522        | 0.00%   |
| 米ドル | STATION CASINOS 6.625    | 2018/3/15  | 0       | 2,335,000 | 154,951        | 0.00%   |
| 米ドル | BRODER BROS CO           |            |         | 11,244    | 1              | 0.00%   |
| 米ドル | PLIANT CORPORATION       |            |         | 5         | 0              | 0.00%   |
|     |                          |            |         | TOTAL     | 23,858,388,291 | 100.00% |