

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年12月14日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	ハイブリッド・インカムオープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2022年6月13日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

第一部【証券情報】

(1 2) その他

< 訂正前 >

申込みの方法

受益権の取得申込に際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。

お申込みの際に、「一般コース」か「自動けいぞく投資コース」か、どちらかのコースをお申し出ください。（原則として、お買付け後のコース変更はできません。）

なお、販売会社や申込形態によっては、どちらか一方のコースのみのお取り扱いとなる場合や、買付単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

取得申込みの受付の中止、既に受付けた取得申込みの受付の取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）における取引の停止、その他やむを得ない事情等があるときは、取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

振替受益権について

ファンドの受益権は、投資信託振替制度（「振替制度」と称する場合があります。）に移行したため、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

< 訂正後 >

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

<更新後>

委託会社の概況(2022年10月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

2 投資方針

(1) 投資方針

<更新後>

[1]高格付債およびハイ・イールド・ボンドを実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目標として積極的な運用を行ないます。

「海外アクティブ債券マザーファンド」および「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」への投資比率は50%：50%程度を基本とし、±10%程度の範囲内で運用を行ないます。

ポートフォリオの平均格付 は、BBB以上に維持することを基本とします。

各マザーファンドを通じて投資する債券の格付から計算される平均格付をいいます。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。

投資対象債券の格付について

高格付債	AA 格相当以上を中心に BBB 格相当まで
ハイ・イールド・ボンド	主に BB 格相当～B 格相当



S&P	ムーディーズ	高格付債	ハイ・イールド・ボンド	ポートフォリオ平均
AAA	Aaa	AA 格相当以上を中心に BBB 格相当まで	主に BB 格相当～B 格相当	
AA	Aa			
A	A			
BBB	Baa			
BB	Ba			
B	B			
CCC	Caa			
CC	Ca			
C	C			
D				

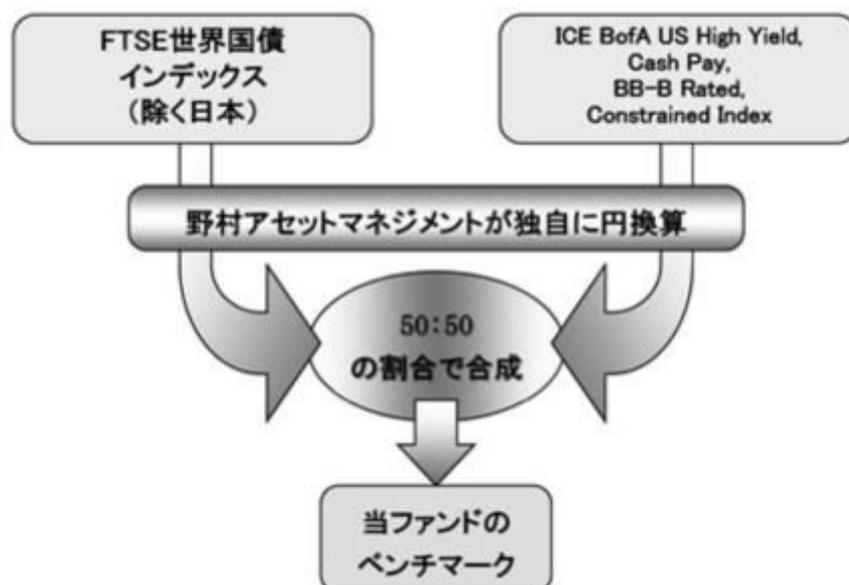
[2]FTSE世界国債インデックス（除く日本）およびICE BofA US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Indexを野村アセットマネジメントが独自に円換算し、各々を50：50の割合で合成した指数（円ベース）をベンチマークとします。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

ファンドでは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）の各国別指数（現地通貨ベース）をもとに、委託会社が円換算した指数を用います。

ICE BofA US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index

ファンドでは、ICE BofA US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算した指数を用います。



ベンチマークは、世界の債券市場の構造変化または、米国債券市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。

[3] 高格付債への投資にあたっては、ソブリン債(FTSE世界国債インデックス(除く日本)採用国が発行する国債・政府保証債)を中心とした債券に投資をすることを基本とします。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)の採用国

アメリカ	カナダ	オーストラリア	オーストリア	ベルギー
デンマーク	フィンランド	フランス	ドイツ	アイルランド
イタリア	オランダ	スペイン	スウェーデン	イギリス
ポーランド	ノルウェー	シンガポール	マレーシア	メキシコ
イスラエル	中国	ニュージーランド		

上記は、2022年10月末現在の、FTSE世界国債インデックス(除く日本)の採用国です。なお、採用国は今後変更される場合があります。

投資する債券の格付は、AA格相当以上を中心にBBB格相当までとします。

カントリーアロケーション¹、デュレーション²などをアクティブに変更することで、リスクの低減を図りつつ、収益の獲得を目指します。

1 債券の発行国別の配分(カントリーアロケーション)の他、為替予約取引を活用^{*}することで、通貨のアロケーションについてもアクティブに変更する場合があります。なお、原則として、対円でのが替ヘッジは行ないません。

* 外貨間のが替予約取引をいいます。たとえば、米国ドル売りのユーロ買い等の予約取引がこれに相当します。

2 ポートフォリオのデュレーションは、FTSE世界国債インデックス(除く日本)のデュレーション±40%程度以内に維持することを基本とします。

「海外アクティブ債券マザーファンド」の運用にあたっては、NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド; 委託会社の英国現地法人)に運用の指図に関する権限のうち、次に関する権限を委託します。

委託する範囲	: 日本を除く世界の債券(含む短期金融商品)の運用の一部
委託先名称	: NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)
委託先所在地	: 英国 ロンドン市

運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更する場合があります。

[4]ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、業種分類を考慮した分散投資と企業調査を重視した銘柄選定を基本とします。

米国ドル建てのハイ・イールド・ボンドに投資し、インカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざします。

- ・「ハイ・イールド・ボンド」とは、BB格以下に格付されている債券をいいます。
- ・当ファンドでは、ハイ・イールド・ボンドのうち、主にBB格～B格相当の格付をもつ債券に投資します。なお、一部格付をもたない債券(BB格～B格相当の格付と判断される債券も含まれます)に投資する場合があります。
- ・ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、企業調査およびクレジット分析により投資機会をとらえ、投資リスクを抑えることを目指します。

ポートフォリオによる分散投資によりリスクの低減を図ることを基本とします。

- ・同一発行体の発行するハイ・イールド・ボンドへの投資割合は、原則としてマザーファンドの信託財産の純資産総額の5%¹以内とします。

1 当ハイブリッド・インカムオープンでの実質投資割合は2.5%以内とします。

- ・投資対象を40業種に分類し、1業種あたりの投資割合は、原則としてマザーファンドの信託財産の純資産総額の15%²以内とします。

2 当ハイブリッド・インカムオープンでの実質投資割合は7.5%以内とします。

- ・組入債券がデフォルトした場合、速やかに売却することを基本とします。

「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」の運用にあたっては、「ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク」(NCRAM社)に運用の指図に関する権限のうち、次に関する権限を委託します。

委託する範囲	: 海外の公社債(含む短期金融商品)の運用
委託先名称	: NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC. (ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク)
委託先所在地	: 米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市

運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

ご参考

NCRAM社について

Nomura Corporate Research and Asset Management Inc.(ノムラ・コーポレート・リサーチ・

アンド・アセット・マネージメント・インク：NCRAM社）は1991年3月に設立された米国に登録されている野村グループの投資顧問会社であり、米国公社債やエマージング・マーケット債で構成されるポートフォリオの運用を行なっています。

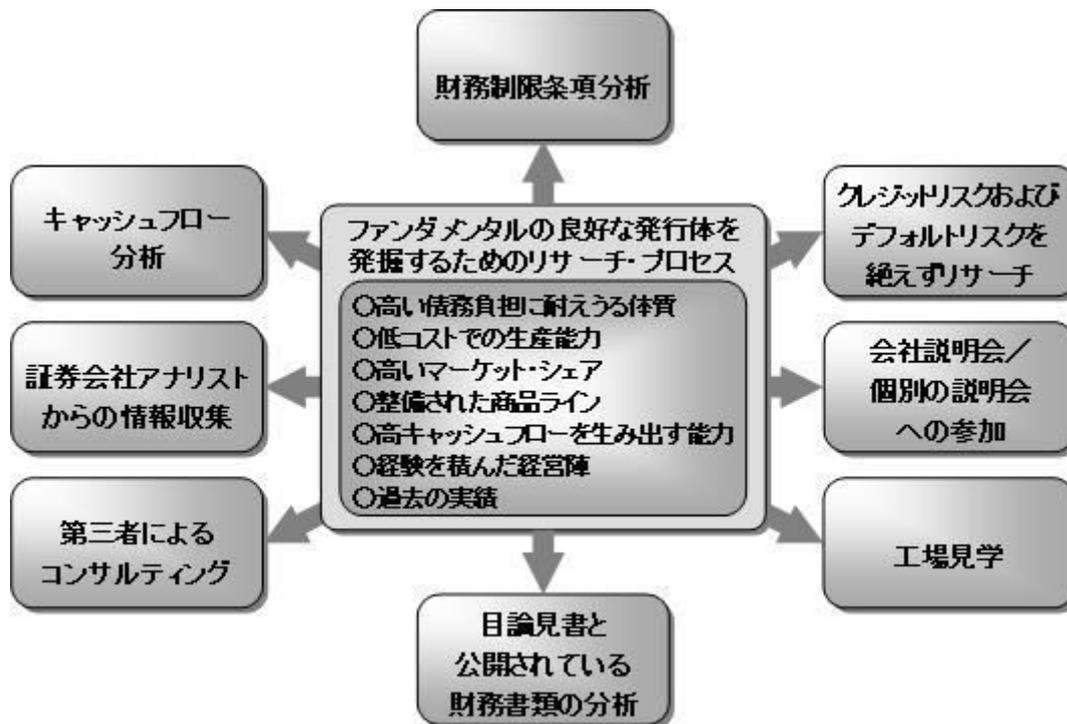
NCRAM社は、クレジットリスクを有する債券の運用において充実した体制を整えています。

NCRAM社はファンダメンタルズの良い企業を発掘するために、リサーチ中心のボトム・アップ・アプローチを採用しています。

デフォルトによる損失を最小限に抑えることを目的にクレジット・リスク管理を徹底し、保守的なポートフォリオ運用を行なっています。

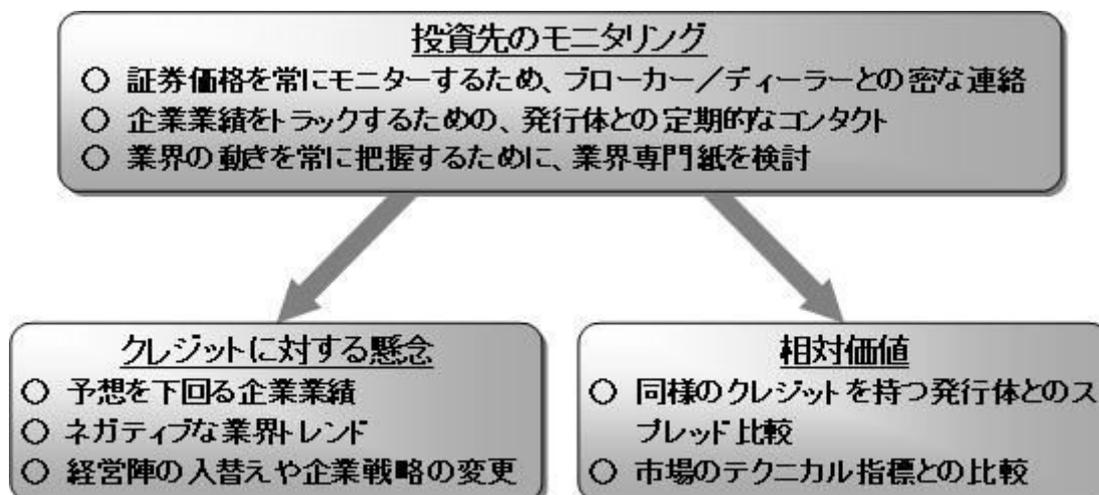
NCRAM社のリサーチプロセス

NCRAM社の信用分析は、企業の業務内容とキャッシュフローを生み出す能力に焦点を当てています。



投資先のモニタリングと規律ある売却

投資先は継続的にモニターされ、状況に応じてポートフォリオを修正します。



3 投資リスク

< 更新後 >



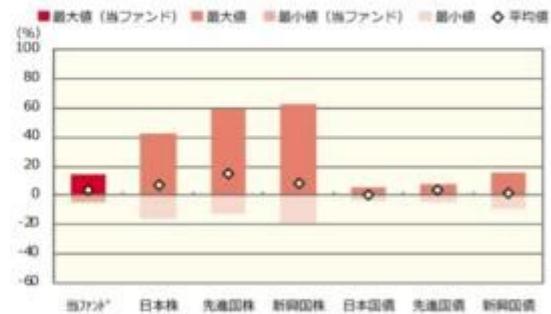
投資リスク

■ リスクの定量的比較 (2017年11月末～2022年10月末：月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド*	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	13.9	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△4.8	△16.0	△12.4	△19.4	△3.7	△4.5	△9.4
平均値 (%)	3.8	7.2	15.3	8.4	0.0	3.2	2.0

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2017年11月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2017年11月から2022年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2017年11月から2022年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
* 決算日に対応した数値とは異なります。
* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。



投資リスク

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
 - MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
 - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
 - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他）

4 手数料等及び税金

（5）課税上の取扱い

< 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除は適用されません。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)については、申告分離課税により20.315%(国税15.315%および地方税5%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債(同族会社が発行した社債を除きます。)などの一定の公社債をいいます。

(注2) 株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(国税15.315%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

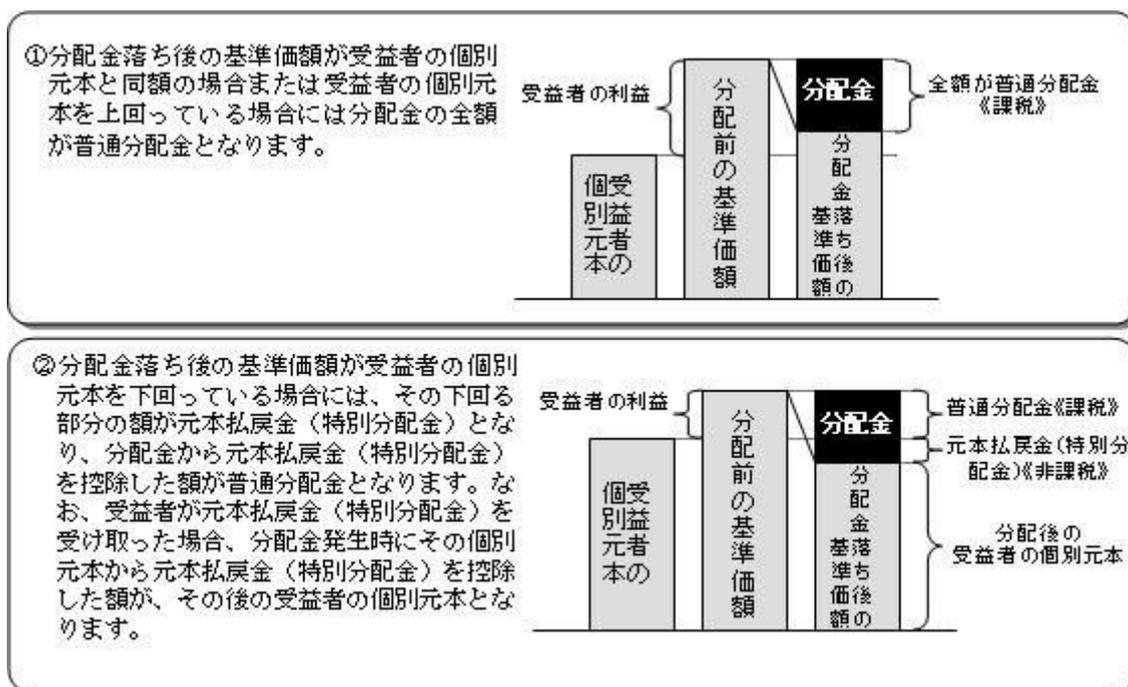
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2022年10月末現在）が変更になる場合があります。

以下は2022年10月31日現在の運用状況であります。

また、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います。

（１）投資状況

ハイブリッド・インカムオープン

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,477,492,136	99.86
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,053,920	0.13
合計（純資産総額）		1,479,546,056	100.00

（参考）海外アクティブ債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	9,963,710,093	24.21
	カナダ	319,853,092	0.77
	メキシコ	2,255,503,392	5.48
	ドイツ	738,504,348	1.79
	イタリア	10,142,440,883	24.64
	フランス	5,305,870,595	12.89
	スペイン	3,706,168,768	9.00
	ベルギー	85,019,810	0.20
	イギリス	1,803,114,362	4.38
	オーストラリア	536,113,993	1.30
	シンガポール	224,464,420	0.54
	マレーシア	594,528,287	1.44
	中国	1,035,952,719	2.51
	イスラエル	216,560,025	0.52
	小計	36,927,804,787	89.72
地方債証券	カナダ	949,842,847	2.30
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,276,929,981	7.96
合計（純資産総額）		41,154,577,615	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	4,604,344,025	11.18
	買建	オーストラリア	676,747,121	1.64
	売建	アメリカ	4,248,413,517	10.32
	売建	カナダ	1,210,188,031	2.94

売建	ドイツ	7,875,544,086	19.13
売建	イギリス	676,019,316	1.64

(参考) ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アメリカ	30,422,835,478	95.23
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,521,902,448	4.76
合計(純資産総額)		31,944,737,926	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ハイブリッド・インカムオープン

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	69,083,155	10.6344	734,657,903	10.9524	756,626,346	51.13
2	日本	親投資信託受益証券	海外アクティブ債券マザーファンド	309,783,322	2.2994	712,315,770	2.3270	720,865,790	48.72

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.86
合計	99.86

(参考) 海外アクティブ債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,500,000	14,372.32	3,090,049,746	13,185.87	2,834,962,856	0.25	2025/9/30	6.88
2	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000,000	15,036.46	2,556,199,764	14,729.48	2,504,011,940	0.95	2023/3/15	6.08
3	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	305,000,000	752.13	2,294,003,642	739.50	2,255,503,392	6.75	2023/3/9	5.48
4	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,500,000	15,449.13	1,931,141,355	15,086.10	1,885,762,965	4.4	2023/10/31	4.58
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	15,597.41	1,559,741,457	13,901.69	1,390,169,082	2.375	2026/4/30	3.37
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	15,116.72	1,511,672,748	13,594.74	1,359,474,666	1.625	2026/2/15	3.30
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000	19,595.61	1,508,862,588	17,422.99	1,341,570,961	5.5	2029/4/25	3.25

8	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000	16,856.77	1,432,825,858	14,620.26	1,242,722,559	3.5	2030/3/1	3.01
9	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,100,000	21,751.81	1,544,378,808	17,114.53	1,215,132,084	6	2031/5/1	2.95
10	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,500,000	14,668.97	1,100,172,757	14,530.23	1,089,767,662	0.3	2023/8/15	2.64
11	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	9,000,000	16,662.91	1,499,661,990	12,099.42	1,088,948,538	1.25	2036/5/25	2.64
12	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,062.55	1,031,277,912	2,071.90	1,035,952,719	2.89	2031/11/18	2.51
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,500,000	15,544.17	1,165,813,410	13,684.54	1,026,340,860	1.25	2026/12/1	2.49
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000	14,692.87	1,028,501,578	14,522.85	1,016,599,920	0.65	2023/10/15	2.47
15	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000	16,195.05	1,133,653,549	13,928.06	974,964,781	2.05	2027/8/1	2.36
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,800,000	14,770.80	1,152,122,962	12,202.09	951,763,161	0	2030/11/25	2.31
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	9,723.62	1,166,835,135	7,733.55	928,026,354	1.25	2050/5/15	2.25
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	15,558.03	933,482,025	13,667.71	820,063,125	2.25	2027/2/15	1.99
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	15,595.67	1,247,654,157	10,129.16	810,333,533	2.25	2046/8/15	1.96
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000	15,261.33	763,066,866	14,336.89	716,844,630	2	2025/12/1	1.74
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,438.31	771,915,690	14,215.00	710,750,286	2.25	2024/10/31	1.72
22	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	20,200,000	2,937.51	593,378,636	2,943.20	594,528,287	3.582	2032/7/15	1.44
23	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,700,000	19,584.52	920,472,782	12,267.94	576,593,484	2	2048/5/25	1.40
24	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000	13,163.99	526,559,795	12,790.14	511,605,976	0	2030/2/15	1.24
25	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000	15,777.66	552,218,317	14,537.31	508,806,194	1.6	2025/4/30	1.23
26	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	3,000,000	24,391.78	731,753,567	16,005.69	480,170,814	3.25	2044/1/22	1.16
27	カナダ	地方債証券	ONTARIO (PROVINCE OF)	5,000,000	10,813.82	540,691,423	9,565.14	478,257,200	2.05	2030/6/2	1.16
28	カナダ	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	5,000,000	10,703.10	535,155,385	9,431.71	471,585,647	1.9	2030/9/1	1.14
29	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,500,000	19,733.13	493,328,376	17,858.81	446,470,259	5	2025/3/7	1.08
30	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	17,735.89	709,435,612	10,870.23	434,809,586	1.5	2050/5/25	1.05

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	89.72
地方債証券	2.30
合計	92.03

(参考) ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	1,200,000	12,815.29	153,783,574	13,552.74	162,632,917	5.5	2027/11/15	0.50
2	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	1,425,000	11,091.10	158,048,292	10,677.98	152,161,240	5.75	2027/3/1	0.47
3	アメリカ	社債券	BWAY HOLDING CO	1,025,000	14,072.98	144,248,121	14,668.47	150,351,855	5.5	2024/4/15	0.47
4	アメリカ	社債券	GLOBAL AIR LEASE CO LTD	1,246,966	11,301.56	140,926,652	11,968.27	149,240,303	6.5	2024/9/15	0.46
5	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	1,000,000	13,516.27	135,162,711	13,820.05	138,200,559	5.125	2027/11/1	0.43
6	アメリカ	社債券	MOZART DEBT MERGER SUB	1,075,000	12,069.92	129,751,647	12,165.77	130,782,036	3.875	2029/4/1	0.40
7	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	1,100,000	10,641.06	117,051,715	11,563.53	127,198,926	5.75	2030/1/15	0.39
8	アメリカ	社債券	CENTENE CORP	900,000	13,501.55	121,514,005	13,809.38	124,284,430	4.25	2027/12/15	0.38
9	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	1,000,000	11,652.79	116,527,912	12,347.09	123,470,928	4.5	2030/8/15	0.38
10	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	900,000	12,996.99	116,972,915	13,352.44	120,171,995	5.113	2029/5/3	0.37
11	アメリカ	社債券	AMERICAN AIRLINES INC	700,000	15,417.70	107,923,940	16,386.28	114,704,018	11.75	2025/7/15	0.35
12	アメリカ	社債券	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	800,000	13,087.35	104,698,840	14,266.24	114,129,955	6.625	2026/7/15	0.35
13	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	800,000	13,046.88	104,375,040	13,713.53	109,708,249	5	2028/2/1	0.34
14	アメリカ	社債券	AMERICAN AIRLINES/AADVAN	800,000	12,962.07	103,696,602	13,617.31	108,938,483	5.75	2029/4/20	0.34
15	アメリカ	社債券	IMOLA MERGER CORP	825,000	12,483.49	102,988,809	13,080.97	107,918,083	4.75	2029/5/15	0.33
16	アメリカ	社債券	LIFE TIME INC	775,000	13,417.21	103,983,409	13,842.44	107,278,934	5.75	2026/1/15	0.33
17	アメリカ	社債券	SIRIUS XM RADIO INC	775,000	13,446.73	104,212,213	13,792.33	106,890,567	5.5	2029/7/1	0.33
18	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	625,000	16,491.92	103,074,521	17,008.38	106,302,420	8.875	2030/7/15	0.33
19	アメリカ	社債券	UBER TECHNOLOGIES INC	825,000	12,318.25	101,625,613	12,858.88	106,085,812	4.5	2029/8/15	0.33
20	アメリカ	社債券	ORGANON FINANCE 1 LLC	800,000	12,510.03	100,080,244	13,209.81	105,678,542	4.125	2028/4/30	0.33
21	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	925,000	12,022.92	111,212,031	11,267.38	104,223,351	7.625	2026/3/1	0.32
22	アメリカ	社債券	COLT MERGER SUB INC	700,000	14,314.28	100,199,965	14,694.12	102,858,860	6.25	2025/7/1	0.32
23	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	875,000	11,368.39	99,473,425	11,716.98	102,523,643	4.5	2032/5/1	0.32
24	アメリカ	社債券	WEATHERFORD INTERNATIONA	725,000	13,084.76	94,864,514	13,994.92	101,463,232	8.625	2030/4/30	0.31
25	アメリカ	社債券	STANDARD INDUSTRIES INC	775,000	12,502.76	96,896,435	13,030.94	100,989,800	4.75	2028/1/15	0.31
26	アメリカ	社債券	CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN	750,000	12,511.36	93,835,237	13,384.91	100,386,846	5.5	2031/6/15	0.31
27	アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	1,025,000	10,234.31	104,901,714	9,735.49	99,788,802	4.75	2031/2/15	0.31
28	アメリカ	社債券	SERVICE PROPERTIES TRUST	925,000	10,001.17	92,510,880	10,641.96	98,438,174	4.95	2029/10/1	0.30
29	アメリカ	社債券	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	850,000	10,894.36	92,602,121	11,549.45	98,170,359	5.5	2028/4/1	0.30
30	アメリカ	社債券	ICAHN ENTERPRISES/FIN	675,000	13,791.58	93,093,232	14,437.26	97,451,520	4.75	2024/9/15	0.30

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	95.23
合計	95.23

投資不動産物件

ハイブリッド・インカムオープン

該当事項はありません。

（参考）海外アクティブ債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

ハイブリッド・インカムオープン

該当事項はありません。

（参考）海外アクティブ債券マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	T-NOTE先物(2年) (2022年12月限)	売建	140	米ドル	29,217,343.4	4,331,763,331	28,655,156.6	4,248,413,517	10.32
	アメリカ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	T-NOTE先物(5年) (2022年12月限)	買建	70	米ドル	7,468,453.02	1,107,272,845	7,481,250	1,109,170,125	2.69
	アメリカ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	T-ULTRA先物(2022 年12月限)	買建	148	米ドル	21,401,406.25	3,172,972,490	19,142,875	2,838,122,645	6.89
	アメリカ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	T-NOTE先物(ULTRA 10年)(2022年12月 限)	買建	38	米ドル	4,414,375	654,475,238	4,431,750	657,051,255	1.59
	カナダ	モントリ オール取引 所	カナダ10年国債先 物(2022年12月限)	売建	90	カナダド ル	11,190,410	1,218,299,933	11,115,900	1,210,188,031	2.94
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	BOBL先物(2022年 12月限)	売建	80	ユーロ	9,836,000	1,451,695,240	9,592,000	1,415,683,280	3.43
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	BUNDS先物(2022年 12月限)	売建	23	ユーロ	3,187,570	470,453,456	3,204,590	472,965,438	1.14

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	SCHATZ先物(2022年12月限)	売建	379	ユーロ	40,938,920	6,042,175,202	40,564,370	5,986,895,368	14.54
オーストラリア	シドニー先物取引所	オーストラリア10年国債先物(2022年12月限)	買建	60	豪ドル	7,098,064.86	674,671,065	7,119,906.6	676,747,121	1.64
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT先物(2022年12月限)	売建	38	英ポンド	3,906,540	672,706,188	3,925,780	676,019,316	1.64

(参考) ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

ハイブリッド・インカムオープン

2022年10月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第18特定期間	(2013年 3月15日)	6,224	6,293	0.8110	0.8200
第19特定期間	(2013年 9月17日)	5,090	5,147	0.8036	0.8126
第20特定期間	(2014年 3月17日)	4,479	4,527	0.8414	0.8504
第21特定期間	(2014年 9月16日)	4,132	4,175	0.8674	0.8764
第22特定期間	(2015年 3月16日)	3,929	3,959	0.9398	0.9468
第23特定期間	(2015年 9月15日)	3,445	3,471	0.9089	0.9159
第24特定期間	(2016年 3月15日)	2,932	2,957	0.8350	0.8420
第25特定期間	(2016年 9月15日)	2,533	2,550	0.7745	0.7795
第26特定期間	(2017年 3月15日)	2,488	2,497	0.8391	0.8421
第27特定期間	(2017年 9月15日)	2,188	2,196	0.8448	0.8478
第28特定期間	(2018年 3月15日)	1,911	1,918	0.8072	0.8102
第29特定期間	(2018年 9月18日)	1,882	1,889	0.8355	0.8385
第30特定期間	(2019年 3月15日)	1,722	1,728	0.8378	0.8408
第31特定期間	(2019年 9月17日)	1,675	1,681	0.8368	0.8398
第32特定期間	(2020年 3月16日)	1,462	1,468	0.7887	0.7917
第33特定期間	(2020年 9月15日)	1,477	1,482	0.8367	0.8397
第34特定期間	(2021年 3月15日)	1,453	1,458	0.8700	0.8730
第35特定期間	(2021年 9月15日)	1,414	1,419	0.8800	0.8830
第36特定期間	(2022年 3月15日)	1,362	1,367	0.8657	0.8687
第37特定期間	(2022年 9月15日)	1,454	1,459	0.9502	0.9532
	2021年10月末日	1,423		0.9001	

11月末日	1,403		0.8857
12月末日	1,423		0.9012
2022年 1月末日	1,385		0.8798
2月末日	1,368		0.8696
3月末日	1,424		0.9048
4月末日	1,414		0.9156
5月末日	1,397		0.9055
6月末日	1,406		0.9137
7月末日	1,419		0.9237
8月末日	1,422		0.9295
9月末日	1,415		0.9249
10月末日	1,479		0.9686

分配の推移

ハイブリッド・インカムオープン

	計算期間	1口当たりの分配金
第18特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月15日	0.0270円
第19特定期間	2013年 3月16日～2013年 9月17日	0.0270円
第20特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0270円
第21特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	0.0270円
第22特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	0.0210円
第23特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	0.0210円
第24特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	0.0210円
第25特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	0.0150円
第26特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	0.0110円
第27特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	0.0090円
第28特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.0090円
第29特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.0090円
第30特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	0.0090円
第31特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.0090円
第32特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	0.0090円
第33特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	0.0090円
第34特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	0.0090円
第35特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	0.0090円
第36特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	0.0090円
第37特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	0.0090円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

収益率の推移

ハイブリッド・インカムオープン

	計算期間	収益率
第18特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月15日	24.6%
第19特定期間	2013年 3月16日～2013年 9月17日	2.4%
第20特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	8.1%
第21特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	6.3%
第22特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	10.8%
第23特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	1.1%
第24特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	5.8%
第25特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	5.4%
第26特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	9.8%
第27特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	1.8%
第28特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	3.4%
第29特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	4.6%
第30特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	1.4%
第31特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	1.0%
第32特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	4.7%
第33特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	7.2%
第34特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	5.1%
第35特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	2.2%
第36特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	0.6%
第37特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	10.8%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

ハイブリッド・インカムオープン

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第18特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月15日	66,981,663	2,404,646,841	7,675,690,686
第19特定期間	2013年 3月16日～2013年 9月17日	102,350,860	1,443,034,026	6,335,007,520
第20特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	25,089,687	1,035,963,675	5,324,133,532
第21特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	31,344,638	591,324,431	4,764,153,739
第22特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	18,478,665	601,142,696	4,181,489,708
第23特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	6,885,869	397,803,550	3,790,572,027
第24特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	14,137,961	292,371,650	3,512,338,338
第25特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	4,921,173	245,590,758	3,271,668,753

第26特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	8,140,835	314,520,039	2,965,289,549
第27特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	3,549,449	378,208,420	2,590,630,578
第28特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	2,746,897	225,762,504	2,367,614,971
第29特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	2,343,351	116,198,766	2,253,759,556
第30特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	2,837,654	200,614,679	2,055,982,531
第31特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	2,172,041	55,643,300	2,002,511,272
第32特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	2,037,523	149,774,236	1,854,774,559
第33特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	2,118,665	91,376,365	1,765,516,859
第34特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	2,046,936	96,376,300	1,671,187,495
第35特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	1,985,300	65,800,140	1,607,372,655
第36特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	6,496,893	40,038,102	1,573,831,446
第37特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	2,183,865	45,326,994	1,530,688,317

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

< 更新後 >



運用実績（2022年10月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2022年9月	30 円
2022年7月	30 円
2022年5月	30 円
2022年3月	30 円
2022年1月	30 円
直近1年間累計	180 円
設定来累計	7,860 円

■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率

銘柄	投資比率（%）
海外アクティブ債券マザーファンド	48.7
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	51.1

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「海外アクティブ債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	US TREASURY N/B	国債証券	3.4
2	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.0
3	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	2.7
4	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	1.6
6	US TREASURY N/B	国債証券	1.6
7	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	1.6
8	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.5
9	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.4
10	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	1.3

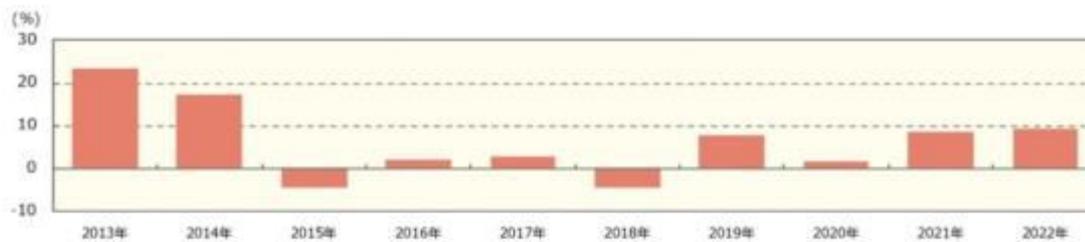
・「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	TRANSDIGM INC	社債券	0.3
2	CARNIVAL CORP	社債券	0.2
3	BWAY HOLDING CO	社債券	0.2
4	GLOBAL AIR LEASE CO LTD	社債券	0.2
5	TENET HEALTHCARE CORP	社債券	0.2
6	MOZART DEBT MERGER SUB	社債券	0.2
7	CSC HOLDINGS LLC	社債券	0.2
8	CENTENE CORP	社債券	0.2
9	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	社債券	0.2
10	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	社債券	0.2



運用実績（2022年10月31日現在）

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2022年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1 申込（販売）手続等

< 訂正前 >

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。（原則として、お買付け後のコース変更はできません。）

ファンドの申込(販売)手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。なお、販売会社や申込形態によっては、どちらか一方のコースのみのお取扱いとなる場合や、申込単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

< 訂正後 >

(1) 受益権の募集

申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。

—

(2) 申込締切時間

午後3時までに取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受け付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

—

(3) 購入コース

分配金を受取る「一般コース」と、分配金が再投資される「自動けいぞく投資コース」があります。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。また、原則として、お買付け後のコース変更はできません。

(4) 販売単位

「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

—

(5) 販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

—

(6) 申込代金の支払い

取得申込日から起算して6営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に取得申込代金をお支払いいただく場合があります。

—

(7) 積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

(8) 申込受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた取得申込みの受け付けを取り消す場合があります。

(9) 申込手続等に関する照会先

ファンドの申込（販売）手続等についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

購入のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2 換金（解約）手続等

<訂正前>

受益者は、受益権を、「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

換金のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

受益者がご換金のお申込みをすときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

ご換金のお申込みの受け付けについては、午後3時までに、ご換金のお申込みが行われかつ、そのご換金のお申込みの受け付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、ご換金の申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超えるご換金は行なえません。また、別途、大口のご換金について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断によりご換金の金額に制限を設ける場合やご換金の受付時間に制限 を設ける場合があります。

受付時間に制限とは、営業日の正午までにご換金のお申込みが行なわれ、かつ当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものに制限する場合をいいます。

ご換金代金は、原則としてご換金のお申込日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

また、一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を

撤回しない場合には、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとします。

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

<訂正後>

(1)解約の請求

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

(2)解約請求の締切時間

一部解約の実行の請求の受け付けについては、午後3時までに解約請求の申込みが行われ、かつ、その解約請求の申込みの受け付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

(3)換金単位

「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

(4)換金価額

ご換金の申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

(5)換金制限

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超えるご換金は行なえません。また、別途、大口のご換金について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断によりご換金の金額に制限を設ける場合やご換金の受付時間に制限を設ける場合があります。

受付時間に制限とは、営業日の正午までにご換金のお申込みが行なわれ、かつ当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものに制限する場合があります。

(6)換金代金の支払い

原則としてご換金のお申込日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

(7)解約請求の受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、

および既に受付けた一部解約の実行の請求の受け取りを中止する場合があります。

また、一部解約の実行の請求の受け取りが中止された場合には、受益者は当該受け取り中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受け取り中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け取ったものとして扱われます。

(8)換金手続等に関する照会先

ファンドの換金（解約）手続等についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

換金のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

4 受益者の権利等

<訂正前>

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

<自動けいぞく投資契約を結んでいない場合>

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益者にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱われます。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

<自動けいぞく投資契約を結んでいる場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還

日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

換金のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、6営業日目から受益者にお支払いします。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご留意ください。

<訂正後>

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

<自動けいぞく投資契約を結んでいない場合>

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

<自動けいぞく投資契約を結んでいる場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還

日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

受益者は、一部解約の実行を請求することができます。詳しくは、前述の「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は原則として6ヶ月毎に作成しております。

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2022年3月16日から2022年9月15日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

ハイブリッド・インカムオープン

(1) 貸借対照表

(単位：円)		
	前期 (2022年 3月15日現在)	当期 (2022年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,819,612	6,987,207
親投資信託受益証券	1,355,650,998	1,446,973,673
未収入金	7,700,000	8,500,000
流動資産合計	1,370,170,610	1,462,460,880
資産合計	1,370,170,610	1,462,460,880
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,721,494	4,592,064
未払受託者報酬	118,168	133,563
未払委託者報酬	2,836,007	3,205,376
未払利息	1	6
その他未払費用	4,708	5,323
流動負債合計	7,680,378	7,936,332
負債合計	7,680,378	7,936,332
純資産の部		
元本等		
元本	1,573,831,446	1,530,688,317
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	211,341,214	76,163,769
(分配準備積立金)	66,962,397	77,535,826
元本等合計	1,362,490,232	1,454,524,548
純資産合計	1,362,490,232	1,454,524,548
負債純資産合計	1,370,170,610	1,462,460,880

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)			
	前期	当期	
	自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日	
営業収益			
有価証券売買等損益	1,582,182	154,922,675	
営業収益合計	1,582,182	154,922,675	
営業費用			

	前期	当期
	自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日
支払利息	448	323
受託者報酬	382,947	391,899
委託者報酬	9,190,550	9,405,318
その他費用	15,257	15,615
営業費用合計	9,589,202	9,813,155
営業利益又は営業損失（ ）	8,007,020	145,109,520
経常利益又は経常損失（ ）	8,007,020	145,109,520
当期純利益又は当期純損失（ ）	8,007,020	145,109,520
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	275,249	1,298,326
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	192,816,876	211,341,214
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,646,112	5,399,881
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,646,112	5,399,881
剰余金減少額又は欠損金増加額	677,334	196,582
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	677,334	196,582
分配金	14,210,847	13,837,048
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	211,341,214	76,163,769

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2022年 3月16日から2022年 9月15日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2022年 3月15日現在	当期 2022年 9月15日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 1,573,831,446口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 1,530,688,317口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 211,341,214円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 76,163,769円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8657円 (10,000口当たり純資産額) (8,657円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9502円 (10,000口当たり純資産額) (9,502円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	当期 自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日																																																																																																												
<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である海外アクティブ債券マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 6,964,102円</p> <p>当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 75,031,004円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2021年 9月16日から2021年11月15日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>7,251,652円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,219,727円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>64,224,235円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>75,695,614円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,584,004,510口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>477円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>30円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>4,752,013円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2021年11月16日から2022年 1月17日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>5,055,435円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,293,281円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>66,445,435円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>75,794,151円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,579,113,482口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>479円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	7,251,652円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	4,219,727円	分配準備積立金額	D	64,224,235円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	75,695,614円	当ファンドの期末残存口数	F	1,584,004,510口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	477円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,752,013円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	5,055,435円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	4,293,281円	分配準備積立金額	D	66,445,435円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	75,794,151円	当ファンドの期末残存口数	F	1,579,113,482口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	479円	<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である海外アクティブ債券マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 6,691,009円</p> <p>当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 77,901,037円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2022年 3月16日から2022年 5月16日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>8,329,794円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,262,144円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>65,728,790円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>78,320,728円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,545,538,978口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>506円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>30円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>4,636,616円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2022年 5月17日から2022年 7月15日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>9,045,508円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,266,695円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>68,970,836円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>82,283,039円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,536,122,798口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>535円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,329,794円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	4,262,144円	分配準備積立金額	D	65,728,790円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	78,320,728円	当ファンドの期末残存口数	F	1,545,538,978口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	506円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,636,616円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	9,045,508円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	4,266,695円	分配準備積立金額	D	68,970,836円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,283,039円	当ファンドの期末残存口数	F	1,536,122,798口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	535円
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	7,251,652円																																																																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																																																											
収益調整金額	C	4,219,727円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	64,224,235円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	75,695,614円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,584,004,510口																																																																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	477円																																																																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,752,013円																																																																																																											
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	5,055,435円																																																																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																																																											
収益調整金額	C	4,293,281円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	66,445,435円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	75,794,151円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,579,113,482口																																																																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	479円																																																																																																											
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	8,329,794円																																																																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																																																											
収益調整金額	C	4,262,144円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	65,728,790円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	78,320,728円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,545,538,978口																																																																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	506円																																																																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,636,616円																																																																																																											
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	9,045,508円																																																																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																																																											
収益調整金額	C	4,266,695円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	68,970,836円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,283,039円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,536,122,798口																																																																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	535円																																																																																																											

10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	4,737,340円

2022年 1月18日から2022年 3月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,171,013円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	4,307,810円
分配準備積立金額	D	66,512,878円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	75,991,701円
当ファンドの期末残存口数	F	1,573,831,446口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	482円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	4,721,494円

10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	4,608,368円

2022年 7月16日から2022年 9月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,019,808円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	4,293,710円
分配準備積立金額	D	73,108,082円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	86,421,600円
当ファンドの期末残存口数	F	1,530,688,317口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	564円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	4,592,064円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

前期 自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	当期 自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

<p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2022年 3月15日現在	当期 2022年 9月15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	当期 自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

前期 自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	当期 自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日
期首元本額 1,607,372,655円	期首元本額 1,573,831,446円

期中追加設定元本額	6,496,893円	期中追加設定元本額	2,183,865円
期中一部解約元本額	40,038,102円	期中一部解約元本額	45,326,994円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2021年 9月16日 至 2022年 3月15日	当期 自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	27,235,981	45,789,476
合計	27,235,981	45,789,476

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年9月15日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年9月15日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	69,083,155	734,657,903	
		海外アクティブ債券マザーファンド	309,783,322	712,315,770	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：99.5%	378,866,477	1,446,973,673 100.0%	
合計				1,446,973,673	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「海外アクティブ債券マザーファンド」および「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」受益証

券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

海外アクティブ債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 9月15日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	700,160,625
コール・ローン	1,004,855,464
国債証券	38,587,357,786
地方債証券	949,511,067
派生商品評価勘定	711,670,557
未収入金	531,237,318
未収利息	198,573,650
前払費用	70,693,374
差入委託証拠金	1,166,829,012
流動資産合計	43,920,888,853
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	538,395,726
未払金	773,285,272
未払解約金	34,160,000
未払利息	871
流動負債合計	1,345,841,869
負債合計	
1,345,841,869	
純資産の部	
元本等	
元本	18,515,581,325
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	24,059,465,659
元本等合計	42,575,046,984
純資産合計	
42,575,046,984	
負債純資産合計	
43,920,888,853	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	--

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 9月15日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,2994円
(10,000口当たり純資産額)	(22,994円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 2022年 3月16日</p> <p>至 2022年 9月15日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする債券・金利等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 9月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	<p>国債証券、地方債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 9月15日現在	
期首	2022年 3月16日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	21,574,826,193円
同期中における追加設定元本額	829,908,852円
同期中における一部解約元本額	3,889,153,720円
期末元本額	18,515,581,325円
期末元本額の内訳*	
ハイブリッド・インカムオープン	309,783,322円
野村外国債券アクティブファンドAコース（野村SMA向け）	1,680,808,781円
野村外国債券アクティブファンドBコース（野村SMA向け）	674,378,722円
野村外国債券アクティブファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	6,131,818,309円
野村外国債券アクティブファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	4,360,672,337円
外国債券アクティブファンド（部分為替ヘッジあり）・分配型（非課税適格機関投資家専用）	1,813,746,686円
ノムラFOFs用・海外アクティブ債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,468,683,150円
外国債券アクティブファンド（為替ヘッジあり）・無分配型（非課税適格機関投資家専用）	1,749,546,886円
野村外国債券アクティブファンド（確定拠出年金向け）	326,143,132円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(2022年9月15日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年9月15日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,904,140.40	
		US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,659,687.50	
		US TREASURY N/B	21,500,000.00	19,333,202.05	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,316,406.00	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,546,875.00	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,653,593.60	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,922,500.00	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,366,718.60	
		US TREASURY N/B	8,000,000.00	6,076,874.40	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,514,992.06	
		US TREASURY N/B	12,000,000.00	7,111,874.40	
	小計	銘柄数：11 組入時価比率：25.7%	87,200,000.00	76,406,864.01 (10,952,159,887) 27.7%	
	カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,939,727.00	
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.8%	3,000,000.00	2,939,727.00 (319,989,283) 0.8%		
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	305,000,000.00	300,623,250.00		
小計	銘柄数：1 組入時価比率：5.1%	305,000,000.00	300,623,250.00 (2,158,354,685) 5.5%		
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	354,959.40		
	BELGIUM KINGDOM GOVT	200,000.00	254,411.24		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,500,000.00	12,906,337.50		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	3,478,335.00		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	2,853,750.00		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	1,729,550.00		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,851,536.40		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	479,784.50		
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,500,000.00	2,299,177.50		
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	3,572,040.00		

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	884,240.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	750,912.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000,000.00	16,948,320.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,500,000.00	7,385,250.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	6,896,330.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,429,950.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	4,878,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,500,000.00	6,990,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	6,711,600.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	8,515,300.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,100,000.00	8,343,920.00	
	FRANCE (GOVT OF)	6,100,000.00	6,129,991.26	
	FRANCE (GOVT OF)	7,800,000.00	6,618,963.00	
	FRANCE (GOVT OF)	9,000,000.00	7,659,900.00	
	FRANCE (GOVT OF)	4,700,000.00	4,205,071.20	
	FRANCE (GOVT OF)	5,500,000.00	4,353,316.00	
	FRANCE (GOVT OF)	5,800,000.00	3,647,944.80	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000.00	9,388,409.80	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,573,660.00	
小計	銘柄数：29	149,600,000.00	145,090,959.60 (20,743,654,494)	
	組入時価比率：48.7%		52.4%	
英ポンド	UK TREASURY	2,500,000.00	2,612,925.00	
	UK TREASURY	2,000,000.00	1,989,700.00	
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,563,898.00	
	UK TREASURY	2,500,000.00	1,682,100.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	3,000,000.00	2,874,720.00	
小計	銘柄数：5	11,400,000.00	10,723,343.00 (1,772,461,364)	
	組入時価比率：4.2%		4.5%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,939,220.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,879,700.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,427,400.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	425,500.00	
小計	銘柄数：4	6,000,000.00	5,671,820.60	

				(548,181,460)	
		組入時価比率：1.3%		1.4%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT		2,200,000.00	2,169,200.00	
小計	銘柄数：1		2,200,000.00	2,169,200.00	
		組入時価比率：0.5%		0.6%	(221,171,632)
リンギ	MALAYSIAN GOVERNMENT		20,200,000.00	19,383,180.68	
小計	銘柄数：1		20,200,000.00	19,383,180.68	
		組入時価比率：1.4%		1.6%	(613,413,704)
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND		50,000,000.00	50,618,750.00	
小計	銘柄数：1		50,000,000.00	50,618,750.00	
		組入時価比率：2.4%		2.6%	(1,041,890,793)
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND		6,000,000.00	5,166,583.80	
小計	銘柄数：1		6,000,000.00	5,166,583.80	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	(216,080,484)
合計				38,587,357,786	
				(38,587,357,786)	
地方債証券	カナダドル	ONTARIO (PROVINCE OF)	5,000,000.00	4,391,515.00	
		PROVINCE OF QUEBEC	5,000,000.00	4,331,600.00	
小計	銘柄数：2		10,000,000.00	8,723,115.00	
		組入時価比率：2.2%		2.4%	(949,511,067)
合計				949,511,067	
				(949,511,067)	
合計				39,536,868,853	
				(39,536,868,853)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 9月15日現在	
	契約額等(円)	

		うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
債券先物取引				
買建	3,083,774,696	-	2,990,096,609	93,678,087
売建	18,189,248,184	-	18,005,129,473	184,118,711
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	8,932,756,968	-	9,447,556,560	514,799,592
米ドル	7,335,963,538	-	7,849,937,420	513,973,882
スウェーデンクローナ	531,807,530	-	534,816,800	3,009,270
ズロチ	143,457,900	-	151,315,500	7,857,600
豪ドル	898,029,480	-	886,838,600	11,190,880
オフショア人民元	23,498,520	-	24,648,240	1,149,720
売建	8,039,609,775	-	8,471,575,160	431,965,385
カナダドル	1,020,648,519	-	1,076,835,870	56,187,351
メキシコペソ	1,740,635,100	-	1,869,986,700	129,351,600
ユーロ	4,091,814,494	-	4,302,737,810	210,923,316
英ポンド	321,567,338	-	330,413,800	8,846,462
ノルウェークローネ	353,865,500	-	354,147,500	282,000
シンガポールドル	454,086,364	-	478,914,020	24,827,656
新シェケル	56,992,460	-	58,539,460	1,547,000
合計	-	-	-	173,274,831

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

先物の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2022年 9月15日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	1,073,595,542
コール・ローン	310,478,210
社債券	29,611,510,413
未収入金	61,570,013
未収利息	472,012,462
前払費用	10,182,105
流動資産合計	31,539,348,745
資産合計	31,539,348,745
負債の部	
流動負債	
未払金	89,587,500
未払解約金	15,100,000
未払利息	269
流動負債合計	104,687,769
負債合計	104,687,769
純資産の部	
元本等	
元本	2,955,952,630
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,478,708,346
元本等合計	31,434,660,976
純資産合計	31,434,660,976
負債純資産合計	31,539,348,745

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 9月15日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	10.6344円
(10,000口当たり純資産額)	(106,344円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2022年 3月16日 至 2022年 9月15日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 9月15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p> 社債券</p> <p> （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p> コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p> これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 9月15日現在	
期首	2022年 3月16日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	3,267,250,938円
同期中における追加設定元本額	464,018,137円
同期中における一部解約元本額	775,316,445円
期末元本額	2,955,952,630円
期末元本額の内訳*	
ハイ・イールド ボンド オープンAコース	104,517,156円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース	375,267,814円
ハイ・イールド ボンド オープンCコース	5,788,935円
ハイ・イールド ボンド オープンDコース	113,693,312円
ハイブリッド・インカムオープン	69,083,155円
ハイ・イールド ボンド オープンAコース（野村SMA向け）	178,671,307円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース（野村SMA向け）	154,117,864円
ハイ・イールド ボンド オープン Aコース（野村SMA・EW向け）	919,082,828円
ハイ・イールド ボンド オープン Bコース（野村SMA・EW向け）	1,035,730,259円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年9月15日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年9月15日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	75,000.00	75,374.62	
		1011778 BC / NEW RED FIN	675,000.00	601,354.12	
		1011778 BC / NEW RED FIN	725,000.00	594,130.25	
		ACRISURE LLC / FIN INC	725,000.00	609,779.37	
		ACURIS FIN US/ACURIS FIN	200,000.00	166,409.00	
		ADT SEC CORP	225,000.00	194,320.12	
		ADTALEM GLOBAL EDUCATION	287,000.00	270,079.91	
		ADVANCED DRAINAGE SYSTEM	100,000.00	99,331.00	
		AETHON UN/AETHIN UN FIN	275,000.00	275,443.52	
		AFFINITY GAMING	600,000.00	520,377.06	
		AG ISSUER LLC	200,000.00	184,631.76	
		AG TTMT ESCROW ISSUER	50,000.00	49,713.50	
		AHERN RENTALS INC	300,000.00	231,000.00	
		AIR CANADA	175,000.00	154,617.75	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	175,000.00	166,263.59	
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	675,000.00	623,497.50	

ALBERTSONS COS/SAFEWAY	175,000.00	145,537.00	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	75,000.00	66,840.75	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	150,000.00	142,774.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	175,000.00	154,961.57	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	325,000.00	283,087.87	
ALLEGIAN T TRAVEL CO	75,000.00	74,112.75	
ALLIED UNI HLD / ALL FIN	200,000.00	166,505.82	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	800,000.00	746,296.00	
ALTICE FINANCING SA	400,000.00	323,450.32	
ALTICE FRANCE SA	225,000.00	186,014.25	
ALTICE FRANCE SA	400,000.00	311,955.20	
ALTICE FRANCE SA	400,000.00	317,342.00	
AMC NETWORKS INC	300,000.00	245,394.00	
AMERICAN AIRLINES INC	700,000.00	776,237.00	
AMERICAN AIRLINES/AADVAN	200,000.00	191,330.00	
AMERICAN AIRLINES/AADVAN	800,000.00	732,560.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	300,000.00	286,863.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	150,000.00	143,431.50	
AMN HEALTHCARE INC	475,000.00	413,240.50	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	300,000.00	305,337.00	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	150,000.00	141,958.50	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	175,000.00	163,079.00	
ANTERO RESOURCES CORP	175,000.00	166,606.12	
ANTERO RESOURCES MIDSTRE	150,000.00	137,928.75	
APACHE CORP	225,000.00	200,910.37	
APACHE CORP	200,000.00	171,652.00	
API ESCROW CORP	100,000.00	84,473.50	
API GROUP DE INC	150,000.00	123,071.25	
ARAMARK SERVICES INC	625,000.00	616,531.25	
ARAMARK SERVICES INC	400,000.00	368,640.00	
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	525,000.00	474,678.75	
ARCONIC CORP	300,000.00	298,125.00	
ARCONIC INC	200,000.00	203,010.00	
ARCONIC ROLLED PRODUCTS	325,000.00	303,844.41	
ARDAGH METAL PACKAGING	200,000.00	197,173.54	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	100,000.00	84,938.00	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	100,000.00	81,369.00	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	275,000.00	275,008.25	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	175,000.00	217,229.25	
ASGN INCORPORATED	650,000.00	575,372.46	
ASHTON WOODS USA/FINANCE	150,000.00	117,061.57	
ASHTON WOODS USA/FINANCE	500,000.00	383,374.90	
	200,000.00	165,265.56	

ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI		
AVANTOR FUNDING INC	275,000.00	250,498.87
AVANTOR FUNDING INC	450,000.00	387,850.50
AVIENT CORP	175,000.00	172,022.37
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	525,000.00	493,362.18
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	100,000.00	93,464.52
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	450,000.00	390,310.87
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	250,000.00	216,700.00
BALL CORP	350,000.00	278,978.00
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	101,625.00
BANK OF AMERICA CORP	125,000.00	119,860.53
BAUSCH HEALTH COS INC	175,000.00	122,793.12
BAUSCH HEALTH COS INC	300,000.00	207,639.18
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	32,473.58
BAUSCH HEALTH COS INC	170,000.00	58,606.65
BEACON ROOFING SUPPLY IN	100,000.00	92,587.88
BEACON ROOFING SUPPLY IN	200,000.00	165,248.00
BEAZER HOMES USA	650,000.00	629,707.00
BEAZER HOMES USA	400,000.00	344,289.60
BELLRING BRANDS INC	225,000.00	216,480.82
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	300,000.00	290,439.00
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	100,000.00	98,432.00
BERRY GLOBAL INC	90,000.00	85,703.28
BLACKSTONE MORTGAGE TR	275,000.00	235,878.47
BLUE RACER MID LLC/FINAN	175,000.00	173,461.75
BLUE RACER MID LLC/FINAN	325,000.00	309,975.25
BOMBARDIER INC	239,000.00	235,864.32
BOMBARDIER INC	175,000.00	167,437.37
BONANZA CREEK ENERGY INC	150,000.00	140,008.60
BOOZ ALLEN HAMILTON INC	150,000.00	134,087.85
BOYD GAMING CORP	325,000.00	284,774.75
BOYNE USA INC	225,000.00	196,357.50
BRISTOW GROUP INC	525,000.00	487,305.47
BROOKFIELD RESID PROPERT	200,000.00	160,324.00
BROOKFIELD RESID PROPERT	150,000.00	113,893.35
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	100,000.00	87,890.83
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	575,000.00	466,716.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	175,000.00	163,220.75
BWAY HOLDING CO	1,025,000.00	995,695.25
CALLON PETROLEUM CO	150,000.00	141,948.75
CALLON PETROLEUM CO	100,000.00	93,931.50
CALPINE CORP	141,000.00	135,529.20
CALPINE CORP	425,000.00	386,193.25

CALPINE CORP	550,000.00	494,351.00	
CALPINE CORP	150,000.00	126,332.10	
CALPINE CORP	100,000.00	83,789.89	
CARLYLE AVIATION ELEVATE	950,000.00	666,178.00	
CARNIVAL CORP	375,000.00	387,573.07	
CARNIVAL CORP	725,000.00	622,474.12	
CARNIVAL CORP	1,425,000.00	1,142,771.62	
CARNIVAL CORP	325,000.00	333,477.62	
CARNIVAL CORP	325,000.00	274,353.62	
CARNIVAL CORP	800,000.00	620,000.00	
CARPENTER TECHNOLOGY	275,000.00	261,790.62	
CASTLELAKE AVIATION FIN	225,000.00	196,699.50	
CATALENT PHARMA SOLUTION	400,000.00	325,744.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	675,000.00	638,507.81	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	800,000.00	735,752.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	205,772.62	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	375,000.00	359,306.28	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	400,000.00	345,701.68	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	1,000,000.00	844,500.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	400,000.00	327,266.64	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	550,000.00	457,770.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	875,000.00	712,665.62	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	425,000.00	336,406.62	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	173,607.75	
CDI ESCROW ISSUER INC	225,000.00	209,513.25	
CDW LLC/CDW FINANCE	250,000.00	245,326.25	
CDW LLC/CDW FINANCE	150,000.00	138,958.50	
CDW LLC/CDW FINANCE	200,000.00	168,913.62	
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	300,000.00	297,417.00	
CEMEX SAB DE CV	200,000.00	160,710.00	
CENTENE CORP	900,000.00	852,718.49	
CENTENE CORP	150,000.00	125,415.00	
CENTENE CORP	550,000.00	515,735.00	
CENTENE CORP	375,000.00	321,697.50	
CENTENE CORP	250,000.00	205,956.87	
CENTENE CORP	200,000.00	158,562.00	
CENTRAL GARDEN & PET CO	150,000.00	125,667.75	
CENTURY COMMUNITIES	325,000.00	313,140.75	
CENTURY COMMUNITIES	100,000.00	79,071.17	
CENTURYLINK INC	200,000.00	202,739.00	
CENTURYLINK INC	275,000.00	280,843.75	
CENTURYLINK INC	375,000.00	323,998.12	

CENTURYLINK INC	150,000.00	130,687.50
CHARLES RIVER LABORATORI	150,000.00	137,182.12
CHARLES RIVER LABORATORI	550,000.00	468,227.26
CHENIERE ENERGY INC	275,000.00	263,359.25
CHENIERE ENERGY PARTNERS	300,000.00	278,583.00
CHENIERE ENERGY PARTNERS	525,000.00	458,857.87
CHENIERE ENERGY PARTNERS	450,000.00	367,284.37
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	500,000.00	437,090.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	425,000.00	343,581.34
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	375,000.00	289,762.50
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	1,025,000.00	775,802.00
CHURCHILL DOWNS INC	175,000.00	167,484.94
CITGO PETROLEUM CORP	550,000.00	539,855.25
CITGO PETROLEUM CORP	300,000.00	288,264.45
CITIGROUP INC	400,000.00	337,040.00
CITIGROUP INC	175,000.00	154,525.00
CITIGROUP INC	50,000.00	49,651.74
CLEAR CHANNEL INTL BV	400,000.00	384,123.04
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	550,000.00	503,170.25
CLEARWAY ENERGY OP LLC	525,000.00	489,130.00
CLEARWAY ENERGY OP LLC	100,000.00	84,418.75
CLEARWAY ENERGY OP LLC	100,000.00	83,263.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	125,000.00	126,243.75
CLEVELAND-CLIFFS INC	225,000.00	213,631.87
CLEVELAND-CLIFFS INC	375,000.00	325,775.62
CNX RESOURCES CORP	425,000.00	425,516.37
CNX RESOURCES CORP	225,000.00	212,221.12
CNX RESOURCES CORP	225,000.00	224,437.50
COEUR MINING INC	225,000.00	160,434.99
COGENT COMMUNICATIONS GR	300,000.00	289,749.42
COINBASE GLOBAL INC	175,000.00	108,875.37
COLT MERGER SUB INC	350,000.00	342,083.00
COMMERCIAL METALS CO	100,000.00	85,923.47
COMMERCIAL METALS CO	75,000.00	61,386.34
COMMERCIAL METALS CO	100,000.00	83,439.75
COMMSCOPE FINANCE LLC	250,000.00	238,800.00
COMMSCOPE FINANCE LLC	300,000.00	266,727.00
COMMSCOPE INC	200,000.00	165,118.00
COMMSCOPE INC	100,000.00	87,122.50
COMMSCOPE TECH FINANCE L	260,000.00	242,043.75
COMPASS GROUP DIVERSIFIE	200,000.00	165,319.00
COMPASS GROUP DIVERSIFIE	100,000.00	78,026.51
COMPASS MINERALS INTERNA	175,000.00	165,669.00

COMSTOCK RESOURCES INC	700,000.00	644,906.50	
CONNECT FINCO SARL/CONNE	600,000.00	553,128.00	
CONSENSUS CLOUD SOLUTION	200,000.00	178,335.68	
CONSENSUS CLOUD SOLUTION	200,000.00	175,700.00	
CONSOLIDATED ENERGY FIN	550,000.00	519,674.48	
CONSTELLIUM SE	250,000.00	197,681.25	
COVANTA HOLDING CORP	200,000.00	168,935.00	
CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN	750,000.00	666,757.50	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	350,000.00	322,644.00	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	200,000.00	197,380.00	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	150,000.00	138,664.50	
CSC HOLDINGS LLC	400,000.00	378,816.00	
CSC HOLDINGS LLC	600,000.00	563,628.00	
CSC HOLDINGS LLC	1,100,000.00	866,464.50	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	163,444.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	147,000.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	143,826.00	
CSC HOLDINGS LLC	600,000.00	491,682.00	
CSTN MERGER SUB INC	300,000.00	256,500.00	
CTR PARTNERSHIP/CARETRST	225,000.00	194,129.43	
CUSHMAN & WAKEFIELD US	150,000.00	146,813.02	
DARLING INGREDIENTS INC	75,000.00	74,155.50	
DAVITA INC	1,050,000.00	861,420.00	
DAVITA INC	370,000.00	283,283.10	
DCP MIDSTREAM LLC	225,000.00	218,056.18	
DCP MIDSTREAM OPERATING	375,000.00	361,582.50	
DCP MIDSTREAM OPERATING	250,000.00	206,580.77	
DELEK LOG PART/FINANCE	175,000.00	161,274.75	
DELEK LOGISTICS PARTNERS	175,000.00	169,740.79	
DELTA AIR LINES INC	225,000.00	210,801.73	
DELTA AIR LINES INC	100,000.00	102,287.50	
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON	225,000.00	37,968.75	
DIRECTV HOLDINGS/FING	675,000.00	619,859.25	
DISH DBS CORP	150,000.00	148,294.50	
DISH DBS CORP	400,000.00	367,710.00	
DISH DBS CORP	425,000.00	340,293.25	
DISH DBS CORP	450,000.00	375,468.75	
DISH DBS CORP	200,000.00	139,386.00	
DISH DBS CORP	350,000.00	272,343.75	
DISH DBS CORP	225,000.00	138,007.12	
DIVERSIFIED HEALTHCARE T	224,000.00	215,781.44	
DIVERSIFIED HEALTHCARE T	650,000.00	418,886.00	

DOLYA HOLDCO 18 DAC	200,000.00	169,943.86
EDGEWELL PERSONAL CARE	300,000.00	279,953.70
EDGEWELL PERSONAL CARE	250,000.00	214,048.75
EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000.00	184,476.70
EMBARQ CORP	375,000.00	283,383.75
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	200,000.00	197,369.00
ENERGEAN ISRAEL FINANCE	100,000.00	89,375.00
ENERGEAN ISRAEL FINANCE	125,000.00	108,437.50
ENERGIZER HOLDINGS INC	100,000.00	92,257.75
ENLINK MIDSTREAM LLC	75,000.00	73,004.62
ENLINK MIDSTREAM LLC	200,000.00	190,536.00
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	475,000.00	381,432.12
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	400,000.00	304,792.00
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	200,000.00	193,756.00
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	125,000.00	124,946.80
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	200,000.00	193,632.00
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	175,000.00	150,185.00
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	125,000.00	124,946.66
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	175,000.00	150,317.12
FAIR ISAAC CORP	150,000.00	134,957.35
FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	350,000.00	311,955.00
FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	350,000.00	291,845.92
FERTITTA ENTERTAINMENT	350,000.00	308,666.75
FIRSTENERGY CORP	250,000.00	238,068.75
FMG RESOURCES AUG 2006	100,000.00	94,000.00
FMG RESOURCES AUG 2006	325,000.00	300,828.12
FORD MOTOR COMPANY	150,000.00	175,392.30
FORD MOTOR COMPANY	75,000.00	78,814.12
FORD MOTOR COMPANY	225,000.00	175,757.06
FORD MOTOR COMPANY	375,000.00	364,595.62
FORD MOTOR COMPANY	200,000.00	149,329.86
FORD MOTOR COMPANY	225,000.00	178,213.50
FORD MOTOR CREDI	825,000.00	670,786.87
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	194,295.00
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	188,328.34
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000.00	367,750.00
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	186,220.00
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	174,517.90
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	175,500.00
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	900,000.00	832,756.50
FORESTAR GROUP INC	200,000.00	170,509.10
FORESTAR GROUP INC	125,000.00	103,756.07
FORTRESS TRANS & INFRAST	191,000.00	178,272.42

FORTRESS TRANS & INFRAST	200,000.00	172,188.00	
FOXTROT ESCROW ISSUER	222,000.00	185,043.66	
FREEDOM MORTGAGE	275,000.00	206,869.41	
FREEDOM MORTGAGE CORP	450,000.00	356,100.07	
FREEPORT-MCMORAN INC	200,000.00	188,654.00	
FRONT RANGE BIDCO INC	375,000.00	319,435.35	
GAP INC/THE	175,000.00	124,724.40	
GAP INC/THE	175,000.00	122,623.37	
GARDA WORLD SECURITY	675,000.00	590,196.37	
GCI LLC	250,000.00	216,800.00	
GENESIS ENERGY LP/FIN	250,000.00	237,332.97	
GENESIS ENERGY LP/FIN	325,000.00	300,830.92	
GENWORTH MORTGAGE HLDING	200,000.00	192,147.32	
GLOBAL AIR LEASE CO LTD	1,203,345.00	987,097.88	
GO DADDY OPCO/FINCO	425,000.00	406,042.87	
GO DADDY OPCO/FINCO	250,000.00	214,092.50	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	500,000.00	524,170.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	550,000.00	487,074.50	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	175,000.00	149,800.00	
GRAHAM HOLDINGS CO	200,000.00	197,816.00	
GRAY ESCROW II INC	200,000.00	167,933.00	
GRAY ESCROW INC	575,000.00	571,205.00	
GRAY TELEVISION INC	250,000.00	205,428.75	
GRIFFON CORPORATION	375,000.00	348,075.00	
GRIFOLS ESCROW ISSUER	200,000.00	167,169.80	
HARVEST MIDSTREAM I LP	400,000.00	384,664.00	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT	300,000.00	259,899.00	
HAWAIIAN BRAND INTELLECT	200,000.00	186,517.24	
HCA INC	500,000.00	501,940.65	
HCA INC	450,000.00	455,629.45	
HEALTHEQUITY INC	450,000.00	399,375.00	
HELIOS SOFTWARE HOLDINGS	200,000.00	158,327.50	
HESS MIDSTREAM	400,000.00	391,896.00	
HESS MIDSTREAM OPERATION	225,000.00	192,723.75	
HESS MIDSTREAM OPERATION	100,000.00	91,249.75	
HESS MIDSTREAM PARTNERS	275,000.00	254,058.36	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	200,000.00	184,369.00	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	150,000.00	138,983.25	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	600,000.00	548,250.00	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	150,000.00	138,197.59	
HILLENBRAND INC	225,000.00	189,237.87	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	150,000.00	149,526.76	

HILTON DOMESTIC OPERATIN	150,000.00	146,163.75
HILTON DOMESTIC OPERATIN	100,000.00	86,899.55
HILTON DOMESTIC OPERATIN	125,000.00	106,387.50
HILTON DOMESTIC OPERATIN	375,000.00	302,625.00
HILTON GRAND VAC BOR ESC	475,000.00	410,065.12
HILTON GRAND VAC BOR ESC	325,000.00	263,536.00
HOLLY NRG PRTRN/FIN CORP	150,000.00	146,350.45
HOLLY NRG PRTRN/FIN CORP	175,000.00	160,405.87
HOSPITALITY PROP TRUST	400,000.00	361,880.00
HOWARD HUGHES CORP	200,000.00	177,647.28
HOWARD HUGHES CORP	150,000.00	124,688.58
HOWARD HUGHES CORP	150,000.00	119,149.50
HOWARD MIDSTREAM ENERGY	150,000.00	136,010.67
HUBBAY MINERALS INC	125,000.00	109,115.45
HUBBAY MINERALS INC	150,000.00	129,146.35
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	475,000.00	435,190.25
IAMGOLD CORP	275,000.00	129,804.64
ICAHN ENTERPRISES/FIN	675,000.00	649,392.25
ICAHN ENTERPRISES/FIN	525,000.00	505,260.00
ICAHN ENTERPRISES/FIN	400,000.00	366,996.12
ICAHN ENTERPRISES/FIN	175,000.00	150,272.50
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	200,000.00	190,805.00
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	175,000.00	157,517.50
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	225,000.00	197,184.37
ILFC E-CAPITAL TRUST I	300,000.00	212,250.00
ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	184,668.50
ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	180,340.00
IMOLA MERGER CORP	1,000,000.00	860,464.90
INDIGO MERGER SUB INC	200,000.00	178,772.00
IQVIA INC	150,000.00	143,142.00
IRON MOUNTAIN INC	325,000.00	302,427.77
IRON MOUNTAIN INC	125,000.00	113,987.50
IRON MOUNTAIN INC	475,000.00	416,216.85
IRON MOUNTAIN INC	600,000.00	531,990.00
IRON MOUNTAIN INC	350,000.00	292,645.50
IRON MOUNTAIN INC	150,000.00	131,162.89
IRON MOUNTAIN INFO MGMT	175,000.00	145,876.69
ITT HOLDINGS LLC	225,000.00	186,754.83
J2 GLOBAL	348,000.00	293,590.20
JACOBS ENTERTAINMENT INC	175,000.00	155,154.12
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	200,000.00	155,325.00
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	600,000.00	435,960.00
JANE STREET GRP/JSG FIN	200,000.00	177,250.00

JEFFERSON CAPITAL HOLDIN	225,000.00	195,537.37	
JELD-WEN INC	150,000.00	145,545.00	
JELD-WEN INC	100,000.00	84,137.00	
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	132,886.84	
JPMORGAN CHASE & CO	275,000.00	277,577.63	
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	148,080.10	
KAISER ALUMINUM CORP	175,000.00	153,125.00	
KB HOME	150,000.00	147,289.33	
KB HOME	100,000.00	94,375.00	
KB HOME	175,000.00	136,269.87	
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	300,000.00	289,780.50	
KINETIK HOLDINGS LP	225,000.00	214,713.00	
L BRANDS INC	44,000.00	46,643.15	
L BRANDS INC	200,000.00	183,399.38	
L BRANDS INC	250,000.00	243,574.27	
L BRANDS INC	200,000.00	185,671.06	
L BRANDS INC	525,000.00	464,168.25	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	650,000.00	560,169.22	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	100,000.00	83,333.50	
LAMAR MEDIA CORP	225,000.00	202,218.75	
LAMAR MEDIA CORP	100,000.00	92,609.00	
LAMAR MEDIA CORP	225,000.00	197,217.00	
LAMAR MEDIA CORP	100,000.00	83,624.00	
LAMB WESTON HLD	150,000.00	132,192.75	
LAMB WESTON HLD	150,000.00	130,923.00	
LAREDO PETROLEUM INC	250,000.00	253,443.75	
LAREDO PETROLEUM INC	350,000.00	342,655.25	
LCM INVESTMENTS HOLDINGS	275,000.00	221,051.93	
LEEWARD RENEWABL	300,000.00	248,326.59	
LEVEL 3 FINANCING INC	275,000.00	240,964.62	
LEVEL 3 FINANCING INC	400,000.00	333,414.80	
LEVEL 3 FINANCING INC	200,000.00	157,394.04	
LEVEL 3 FINANCING INC	550,000.00	431,022.62	
LIFE TIME INC	775,000.00	702,586.79	
LIFEPOINT HEALTH INC	275,000.00	269,718.32	
LIFEPOINT HEALTH INC	100,000.00	85,924.00	
LINDBLAD EXPEDITIONS LLC	300,000.00	273,615.00	
LITHIA MOTORS INC	425,000.00	356,507.00	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	200,000.00	192,264.00	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	615,000.00	565,080.45	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	100,000.00	88,000.00	
LOGAN MERGER SUB INC	300,000.00	209,715.48	

LSF9 ATL HLDG/VICTRA FIN	275,000.00	252,206.46
LUMEN TECHNOLOGIES INC	325,000.00	242,612.50
LUMEN TECHNOLOGIES INC	175,000.00	134,827.00
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	150,000.00	129,521.25
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	50,000.00	42,342.50
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	75,000.00	62,509.49
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	275,000.00	185,490.91
MAGIC MERGERCO INC	200,000.00	156,059.84
MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN	200,000.00	192,269.00
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	74,000.00	73,923.04
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	100,000.00	88,867.06
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	100,000.00	84,533.48
MASONITE INTERNATIONAL C	250,000.00	228,360.00
MASONITE INTERNATIONAL C	175,000.00	140,488.42
MATADOR RESOURCES CO	300,000.00	297,528.00
MATCH GROUP HLD II LLC	175,000.00	139,621.12
MATCH GROUP INC	425,000.00	400,480.68
MATCH GROUP INC	100,000.00	89,126.00
MATTAMY GROUP CORP	250,000.00	203,627.50
MATTEL INC	125,000.00	115,437.50
MATTEL INC	100,000.00	99,091.16
MATTEL INC	125,000.00	111,798.75
MATTEL INC	150,000.00	136,691.44
MATTHEWS INTERNATIONAL C	425,000.00	384,890.62
MEG ENERGY CORP	325,000.00	335,104.25
MEG ENERGY CORP	550,000.00	513,218.75
MERCER INTL INC	475,000.00	397,643.87
MERITAGE HOMES CORP	325,000.00	321,009.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PL	350,000.00	328,769.66
MGIC INVESTMENT CORP	450,000.00	415,444.50
MGM RESORTS INTL	250,000.00	250,391.25
MGM RESORTS INTL	394,000.00	385,600.31
MGM RESORTS INTL	211,000.00	195,921.94
MGM RESORTS INTL	300,000.00	263,088.75
MIDCAP FINANCIAL	200,000.00	156,550.00
MIDWEST GAMING BORROWER	200,000.00	171,212.00
MILLENNIUM ESCROW CORP	175,000.00	139,061.82
MINERAL RESOURCES LTD	450,000.00	454,266.00
MIWD HLDCO II/MIWD FIN	350,000.00	284,412.13
MOLINA HEALTHCARE INC	150,000.00	138,214.24
MOLINA HEALTHCARE INC	175,000.00	153,446.40
MOLINA HEALTHCARE INC	225,000.00	192,608.84
MOSS CREEK RESOURCES HLD	75,000.00	68,769.56

MOTION BONDCO DAC	400,000.00	344,421.00	
MOZART DEBT MERGER SUB	1,075,000.00	910,068.12	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	200,000.00	168,468.90	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	500,000.00	402,282.50	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	625,000.00	524,218.75	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	75,000.00	55,828.50	
MSCI INC	75,000.00	66,155.62	
MSCI INC	250,000.00	211,418.12	
MSCI INC	175,000.00	144,698.89	
MURPHY OIL CORP	650,000.00	628,475.25	
MURPHY OIL CORP	225,000.00	218,661.75	
NABORS INDUSTRIES INC	225,000.00	213,862.50	
NATIONSTAR MTG HLD INC	100,000.00	89,133.50	
NATIONSTAR MTG HLD INC	200,000.00	165,896.00	
NATIONSTAR MTG HLD INC	100,000.00	77,993.20	
NATIONSTAR MTG HLD INC	75,000.00	59,079.37	
NAVIENT CORP	60,000.00	60,537.60	
NAVIENT CORP	300,000.00	290,575.50	
NAVIENT CORP	425,000.00	404,937.87	
NAVIENT CORP	200,000.00	186,000.00	
NAVIENT CORP	275,000.00	217,803.35	
NCL CORPORATION LTD	350,000.00	319,072.60	
NCR CORP	275,000.00	260,772.38	
NCR CORP	200,000.00	183,997.80	
NCR CORP	500,000.00	459,973.75	
NCR CORP	50,000.00	47,684.75	
NCR CORP	525,000.00	487,585.87	
NESCO HOLDINGS II INC	200,000.00	176,218.00	
NEW ENTERPRISE STONE & L	200,000.00	174,819.00	
NEWELL BRANDS INC	100,000.00	101,188.00	
NEWELL BRANDS INC	100,000.00	100,821.50	
NEWELL RUBBERMAID INC	525,000.00	497,437.50	
NEWMARK GROUP INC	150,000.00	149,732.25	
NEWS CORP	500,000.00	443,140.00	
NEWS CORP	225,000.00	207,424.12	
NEXSTAR BROADCASTING INC	275,000.00	247,142.50	
NEXSTAR ESCROW INC	200,000.00	191,283.50	
NEXTERA ENERGY OPERATING	250,000.00	243,130.00	
NEXTERA ENERGY OPERATING	139,000.00	128,937.79	
NEXTERA ENERGY OPERATING	325,000.00	302,656.25	
NGL ENRGY OP/FIN CORP	450,000.00	408,153.69	
NIELSEN FINANCE LLC/CO	150,000.00	150,642.75	

NIELSEN FINANCE LLC/CO	100,000.00	100,455.70
NMI HOLDINGS	300,000.00	301,852.50
NORTHERN OIL AND GAS INC	125,000.00	120,208.12
NORTONLIFELOCK INC	175,000.00	173,158.12
NORTONLIFELOCK INC	225,000.00	222,648.75
NOVA CHEMICALS CORP	400,000.00	379,760.00
NOVA CHEMICALS CORP	375,000.00	334,485.00
NOVA CHEMICALS CORP	125,000.00	102,171.21
NOVELIS CORP	100,000.00	88,576.12
NOVELIS CORP	475,000.00	421,063.75
NOVELIS CORP	100,000.00	81,121.50
NRG ENERGY INC	152,000.00	152,183.16
NRG ENERGY INC	150,000.00	123,557.25
NRG ENERGY INC	375,000.00	343,012.50
NRG ENERGY INC	250,000.00	204,217.87
NUSTAR LOGISTICS LP	150,000.00	143,311.05
NUSTAR LOGISTICS LP	150,000.00	142,357.50
NUSTAR LOGISTICS LP	150,000.00	136,183.50
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	625,000.00	724,681.25
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	425,000.00	447,447.22
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	250,000.00	278,530.00
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	28,359.87
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	250,000.00	214,736.25
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	650,000.00	542,668.75
OI EUROPEAN GROUP BV	175,000.00	145,405.75
OLIN CORP	225,000.00	210,828.37
OLIN CORP	300,000.00	271,311.00
OLYMPUS WTR US HLDG CORP	600,000.00	489,204.00
ON SEMICONDUCTOR CORP	325,000.00	289,250.00
OPEN TEXT HOLDINGS INC	250,000.00	200,957.32
OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	275,000.00	219,265.06
OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	275,000.00	210,466.98
ORGANON FINANCE 1 LLC	800,000.00	716,380.00
ORGANON FINANCE 1 LLC	200,000.00	175,303.00
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	575,000.00	528,304.25
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	100,000.00	84,543.50
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	200,000.00	165,839.00
OWENS & MINOR INC	200,000.00	167,355.00
OWENS & MINOR INC	150,000.00	139,404.00
OWENS-BROCKWAY	106,000.00	107,203.63
OWENS-BROCKWAY	150,000.00	141,192.00
OWENS-BROCKWAY	400,000.00	385,728.00
OWENS-BROCKWAY	94,000.00	89,120.46

P&L DEV LLC/PLD FIN CORP	250,000.00	182,812.50	
PARK INTERMED HOLDINGS	275,000.00	251,917.87	
PARK INTERMED HOLDINGS	175,000.00	150,824.15	
PARK-OHIO INDUSTRIES INC	375,000.00	306,562.50	
PARKLAND CORP/CANADA	109,000.00	91,320.20	
PARKLAND CORP/CANADA	350,000.00	293,566.00	
PARKLAND FUEL CORP	200,000.00	189,376.00	
PATRICK INDUSTRIES INC	200,000.00	157,988.00	
PAYSAFE FIN PLC/PAYSAFE	375,000.00	288,481.87	
PBF HOLDING CO LLC	475,000.00	426,124.87	
PDC ENERGY INC	163,000.00	161,991.95	
PENN VIRGINIA ESC LLC	150,000.00	147,187.50	
PENNYMAC FIN SVCS INC	575,000.00	443,750.50	
PENNYMAC FIN SVCS INC	100,000.00	80,263.31	
PERFORMANCE FOOD GROUP I	400,000.00	379,978.00	
PERFORMANCE FOOD GROUP I	225,000.00	194,458.50	
PETSMART INC/PETSMART FI	250,000.00	228,125.00	
PG&E CORP	275,000.00	245,796.37	
PG&E CORP	275,000.00	239,551.12	
PGT INNOVATIONS INC	425,000.00	357,293.25	
PICASSO FINANCE SUB INC	121,000.00	120,515.39	
PILGRIM'S PRIDE CORP	600,000.00	592,500.00	
PLAYTIKA HOLDING CORP	275,000.00	230,674.12	
PM GENERAL PURCHASER LLC	300,000.00	261,738.81	
POLYONE CORP	200,000.00	195,209.78	
POST HOLDINGS INC	158,000.00	154,304.60	
POST HOLDINGS INC	375,000.00	353,092.50	
POST HOLDINGS INC	150,000.00	137,669.25	
POST HOLDINGS INC	200,000.00	171,854.00	
POST HOLDINGS INC	150,000.00	126,485.25	
PRECISION DRILLING CORP	175,000.00	159,564.56	
PRESIDIO HOLDING INC	200,000.00	187,008.66	
PRESTIGE BRANDS INC	300,000.00	272,580.00	
PRESTIGE BRANDS INC	150,000.00	120,113.25	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	150,000.00	148,864.35	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	325,000.00	282,912.50	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	650,000.00	587,132.00	
PRIME SECURITY ONE MS IN	675,000.00	574,934.15	
PRIMO WATER HOLDINGS INC	475,000.00	397,562.55	
QUEBECOR MEDIA INC	250,000.00	249,087.50	
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN	125,000.00	100,614.28	
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN	375,000.00	289,460.13	
	275,000.00	195,527.75	

RACKSPACE TECHNOLOGY		
RADIAN GROUP INC	225,000.00	214,329.39
RADIAN GROUP INC	50,000.00	49,562.25
RADIAN GROUP INC	300,000.00	277,317.30
RANGE RESOURCES CORP	425,000.00	442,399.50
RANGE RESOURCES CORP	175,000.00	159,454.75
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	250,000.00	246,943.60
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	450,000.00	351,672.84
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	275,000.00	206,931.78
RLJ LODGING TRUST LP	175,000.00	156,079.59
RLJ LODGING TRUST LP	225,000.00	188,165.25
ROCKCLIFF ENERGY II LLC	175,000.00	162,583.75
ROCKETMTGE CO-ISSUER INC	125,000.00	106,368.75
ROLLS-ROYCE PLC	200,000.00	182,819.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	125,000.00	102,500.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	800,000.00	641,452.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	375,000.00	325,571.47
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	325,000.00	232,958.37
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	850,000.00	662,681.25
SABRE GLBL INC	150,000.00	147,477.00
SABRE GLBL INC	125,000.00	117,195.62
SBA COMMUNICATIONS CORP	300,000.00	272,589.00
SBA COMMUNICATIONS CORP	175,000.00	143,815.00
SCIH SALT HOLDINGS INC	375,000.00	326,392.50
SCIL IV LLC / SCIL USA H	200,000.00	164,406.00
SCOTTS MIRACLE-GRO CO	700,000.00	519,421.00
SEAGATE HDD CAYMAN	150,000.00	117,830.08
SEAGATE HDD CAYMAN	300,000.00	227,861.25
SEALED AIR CORP	375,000.00	371,683.12
SEALED AIR CORP	225,000.00	201,656.25
SEALED AIR CORP	50,000.00	47,256.87
SEASPAN CORP	375,000.00	309,211.87
SENSATA TECH INC	150,000.00	131,289.61
SENSATA TECHNOLOGIES BV	200,000.00	194,062.50
SENSATA TECHNOLOGIES INC	150,000.00	122,314.87
SERVICE CORP INTL	300,000.00	278,470.74
SERVICE CORP INTL	275,000.00	223,276.51
SERVICE CORP INTL	200,000.00	168,708.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	200,000.00	194,750.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	225,000.00	191,868.72
SERVICE PROPERTIES TRUST	175,000.00	137,375.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	100,000.00	85,979.91
SERVICE PROPERTIES TRUST	925,000.00	685,975.74

SERVICE PROPERTIES TRUST	150,000.00	108,287.25	
SHEA HOMES LP/FNDG CP	150,000.00	127,539.10	
SHEA HOMES LP/FNDG CP	150,000.00	118,950.40	
SIMMONS FOOD INC/SIMMONS	200,000.00	173,272.00	
SINCLAIR TELEVISION GROU	375,000.00	316,387.50	
SINCLAIR TELEVISION GROU	125,000.00	96,066.87	
SINCLAIR TELEVISION GROU	275,000.00	220,956.97	
SIRIUS XM RADIO INC	350,000.00	314,201.65	
SIRIUS XM RADIO INC	300,000.00	287,494.50	
SIRIUS XM RADIO INC	275,000.00	243,705.00	
SIRIUS XM RADIO INC	775,000.00	726,640.00	
SIRIUS XM RADIO INC	450,000.00	366,966.90	
SIZZLING PLATT/FIN CO	350,000.00	315,187.07	
SLM CORP	400,000.00	391,565.56	
SLM CORP	90,000.00	63,588.40	
SM ENERGY CO	450,000.00	442,116.00	
SM ENERGY CO	125,000.00	122,503.12	
SONIC AUTOMOTIVE INC	125,000.00	102,213.75	
SONIC AUTOMOTIVE INC	125,000.00	101,462.50	
SOTHEBY'S	200,000.00	186,945.64	
SOUTHWESTERN ENERGY	150,000.00	142,266.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	37,000.00	36,860.14	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	100,000.00	105,611.26	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	450,000.00	420,246.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	350,000.00	311,932.25	
SPCM SA	200,000.00	164,248.00	
SPECIALTY BUILDING PRODU	500,000.00	445,224.45	
SPECTRUM BRANDS INC	75,000.00	64,794.37	
SPECTRUM BRANDS INC	75,000.00	63,685.50	
SPECTRUM BRANDS INC	175,000.00	135,170.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	100,000.00	97,854.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	350,000.00	343,887.25	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	150,000.00	147,217.03	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	500,000.00	487,875.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	375,000.00	358,985.62	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	200,000.00	183,895.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	25,000.00	20,730.12	
SPRINT CAPITAL CORP	325,000.00	342,850.62	
SPRINT CAPITAL CORP	450,000.00	535,641.75	
SPRINT CORP	150,000.00	154,050.00	
SPRINT CORP	550,000.00	565,730.00	
SPRINT CORP	125,000.00	132,495.00	

SRM ESCROW ISSUER LLC	650,000.00	565,708.00
SRS DISTRIBUTION INC	150,000.00	134,435.25
SS&C TECHNOLOGIES INC	625,000.00	596,437.50
STANDARD INDUSTRIES INC	125,000.00	114,869.38
STANDARD INDUSTRIES INC	775,000.00	681,333.50
STANDARD INDUSTRIES INC	425,000.00	338,030.12
STANDARD INDUSTRIES INC	275,000.00	201,850.00
STAPLES INC	650,000.00	575,250.00
STAPLES INC	500,000.00	391,035.10
STL HOLDING CO LLC	300,000.00	267,750.00
STUDIO CITY FINANCE LTD	400,000.00	194,786.36
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	37,000.00	36,360.14
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	200,000.00	181,736.40
SUNNOVA ENERGY CORP	200,000.00	183,260.00
SUNOCO LP/FINANCE CORP	296,000.00	255,146.08
SUNOCO LP/FINANCE CORP	275,000.00	233,406.25
SUPERIOR PLUS/GEN PRTRN	200,000.00	175,159.30
SYNAPTICS INC	200,000.00	170,263.26
T-MOBILE USA INC	200,000.00	183,060.72
T-MOBILE USA INC	200,000.00	184,684.00
T-MOBILE USA INC	175,000.00	170,911.12
T-MOBILE USA INC	400,000.00	357,964.00
T-MOBILE USA INC	225,000.00	197,293.59
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	150,000.00	151,737.00
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	275,000.00	245,308.66
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	175,000.00	156,074.62
TALOS PRODUCTION INC	300,000.00	315,664.50
TAP ROCK RESOURCES LLC	300,000.00	282,159.87
TAYLOR MORRISON COMM	150,000.00	134,502.00
TAYLOR MORRISON COMM	100,000.00	81,184.17
TEGNA INC	100,000.00	98,765.93
TEGNA INC	475,000.00	455,392.00
TEGNA INC	200,000.00	192,388.00
TEINE ENERGY LTD	275,000.00	254,815.00
TELECOM ITALIA CAPITAL	725,000.00	608,166.25
TELESAT CANADA/TELESAT L	150,000.00	84,567.75
TELESAT CANADA/TELESAT L	150,000.00	77,023.54
TELESAT CANADA/TELESAT L	275,000.00	111,359.35
TEMPUR SEALY INTL INC	150,000.00	127,299.00
TEMPUR SEALY INTL INC	225,000.00	176,896.12
TENET HEALTHCARE CORP	206,000.00	201,439.16
TENET HEALTHCARE CORP	125,000.00	121,753.15
TENET HEALTHCARE CORP	275,000.00	261,736.75

TENET HEALTHCARE CORP	350,000.00	340,014.50	
TENET HEALTHCARE CORP	1,000,000.00	942,500.00	
TENET HEALTHCARE CORP	150,000.00	137,253.94	
TENET HEALTHCARE CORP	150,000.00	140,119.50	
TENET HEALTHCARE CORP	275,000.00	240,444.62	
TENET HEALTHCARE CORP	450,000.00	434,394.00	
TENNECO INC	200,000.00	199,992.00	
TENNECO INC	250,000.00	244,680.87	
TENNECO INC	325,000.00	324,156.04	
TEREX CORP	325,000.00	286,344.50	
TERRAFORM POWER OPERATIN	175,000.00	162,976.62	
TERRAFORM POWER OPERATIN	350,000.00	316,575.00	
TOPBUILD CORP	175,000.00	141,492.24	
TRANSDIGM INC	200,000.00	205,181.12	
TRANSDIGM INC	500,000.00	491,490.00	
TRANSDIGM INC	550,000.00	542,487.00	
TRANSDIGM INC	1,200,000.00	1,091,397.00	
TRANSDIGM INC	425,000.00	360,863.25	
TRANSDIGM INC	550,000.00	465,600.96	
TRANSOCEAN POSEIDON	109,375.00	103,623.51	
TRAVEL + LEISURE CO	200,000.00	162,696.94	
TRI POINTE GROUP INC	200,000.00	176,057.30	
TRI POINTE GROUP INC	125,000.00	110,175.35	
TRI POINTE HOLDINGS INC	100,000.00	99,092.00	
TRIMAS CORP	250,000.00	220,293.75	
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	150,000.00	103,362.75	
TRONOX INC	375,000.00	311,317.80	
TTM TECHNOLOGIES INC	225,000.00	193,390.20	
TWITTER INC	575,000.00	549,976.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	400,000.00	405,572.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	825,000.00	727,097.25	
UNITED AIRLINES HOLDINGS	25,000.00	24,404.50	
UNITED AIRLINES INC	200,000.00	184,864.00	
UNITED AIRLINES INC	200,000.00	174,643.00	
UNITED RENTALS NORTH AM	88,000.00	87,950.28	
UNITED RENTALS NORTH AM	375,000.00	323,118.75	
UNITED RENTALS NORTH AM	125,000.00	103,909.37	
UNITED WHOLESAL MTGE LL	100,000.00	84,243.32	
UNITED WHOLESAL MTGE LL	300,000.00	237,181.50	
UNITI GROUP/CSL CAPITAL	200,000.00	167,592.62	
UNIVAR SOLUTIONS USA INC	175,000.00	163,135.00	
UNIVISION COMMUNICATIONS	450,000.00	436,014.00	

UNIVISION COMMUNICATIONS	300,000.00	291,928.50
UNIVISION COMMUNICATIONS	225,000.00	194,904.00
UNIVISION COMMUNICATIONS	225,000.00	224,724.37
UPC BROADBAND FINCO BV	400,000.00	346,410.00
USA COM PART/USA COM FIN	200,000.00	187,082.00
USA COM PART/USA COM FIN	200,000.00	187,611.00
VENATOR FIN SARL/VENATOR	175,000.00	127,972.25
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	275,000.00	240,358.25
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	200,000.00	173,847.00
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	250,000.00	206,932.50
VERICAST MERGER SUB INC	530,250.00	526,935.93
VERITAS US INC/BERMUDA L	300,000.00	240,472.50
VERMILION ENERGY INC	225,000.00	215,106.75
VIASAT INC	150,000.00	136,088.25
VICI PROPERTIES / NOTE	100,000.00	93,620.09
VICI PROPERTIES / NOTE	150,000.00	138,622.50
VICI PROPERTIES / NOTE	250,000.00	222,611.25
VICI PROPERTIES / NOTE	100,000.00	86,587.23
VICI PROPERTIES/NOTE	250,000.00	239,929.77
VICI PROPERTIES/NOTE	650,000.00	637,929.50
VICI PROPERTIES/NOTE	75,000.00	65,770.50
VIDEOTRON LTD	150,000.00	147,548.25
VIDEOTRON LTD / LTEE	75,000.00	71,070.00
VIDTRON LTD/VIDTRON LTEE	350,000.00	294,658.00
VIKING CRUISES LTD	75,000.00	66,416.25
VIKING CRUISES LTD	300,000.00	317,302.50
VIKING OCEAN CRUISES SHI	125,000.00	100,184.31
VIPER ENERGY PARTNERS LP	375,000.00	356,216.92
VISTRA CORP	225,000.00	204,637.50
VISTRA OPERATIONS CO LLC	500,000.00	481,092.50
VISTRA OPERATIONS CO LLC	375,000.00	351,403.12
VISTRA OPERATIONS CO LLC	375,000.00	325,760.62
VMED O2 UK FINAN	600,000.00	500,988.00
VOC ESCROW LTD	300,000.00	254,047.50
WEATHERFORD INTERNATIONA	725,000.00	676,754.87
WESCO DISTRIBUTION INC	350,000.00	355,227.25
WESCO DISTRIBUTION INC	300,000.00	303,178.23
WESTERN GLOBAL AIRLINES	250,000.00	225,242.32
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	100,000.00	89,509.00
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	275,000.00	237,711.37
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	225,000.00	199,564.87
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	25,000.00	21,324.62
WILLIAMS SCOTSMAN INTL	200,000.00	179,561.00

	WINDSTREAM ESCROW LLC	200,000.00	174,510.00	
	WMG ACQUISITION CORP	250,000.00	217,756.25	
	WMG ACQUISITION CORP	250,000.00	200,625.00	
	WR GRACE HOLDING LLC	550,000.00	502,562.50	
	WW INTERNATIONAL INC	175,000.00	107,699.86	
	WYNDHAM DESTINATIONS INC	275,000.00	269,077.87	
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	325,000.00	311,720.50	
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	375,000.00	342,712.50	
	WYNN RESORTS FINANCE LLC	200,000.00	200,064.00	
	WYNN RESORTS FINANCE LLC	75,000.00	61,437.75	
	XEROX HOLDINGS CORP	250,000.00	232,760.92	
	XEROX HOLDINGS CORP	250,000.00	213,740.30	
	XHR LP	200,000.00	193,833.70	
	XPO LOGISTICS INC	158,000.00	160,077.60	
	YUM! BRANDS INC	150,000.00	124,544.40	
	YUM! BRANDS INC	175,000.00	152,507.68	
	YUM! BRANDS INC	275,000.00	254,472.62	
	ZIGGO BOND CO BV	200,000.00	154,357.00	
	ZIGGO BV	400,000.00	336,832.40	
小計	銘柄数：800	232,861,970.00	206,582,324.64	
	組入時価比率：94.2%		(29,611,510,413)	
			100.0%	
合計			29,611,510,413	
			(29,611,510,413)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

ハイブリッド・インカムオープン

2022年10月31日現在

資産総額	1,482,046,004円
負債総額	2,499,948円
純資産総額(-)	1,479,546,056円
発行済口数	1,527,523,898口

1口当たり純資産額(/)	0.9686円
----------------	---------

(参考) 海外アクティブ債券マザーファンド

2022年10月31日現在

資産総額	57,878,197,025円
負債総額	16,723,619,410円
純資産総額(-)	41,154,577,615円
発行済口数	17,685,598,612口
1口当たり純資産額(/)	2.3270円

(参考) ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

2022年10月31日現在

資産総額	31,944,738,580円
負債総額	654円
純資産総額(-)	31,944,737,926円
発行済口数	2,916,691,155口
1口当たり純資産額(/)	10.9524円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2022年10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

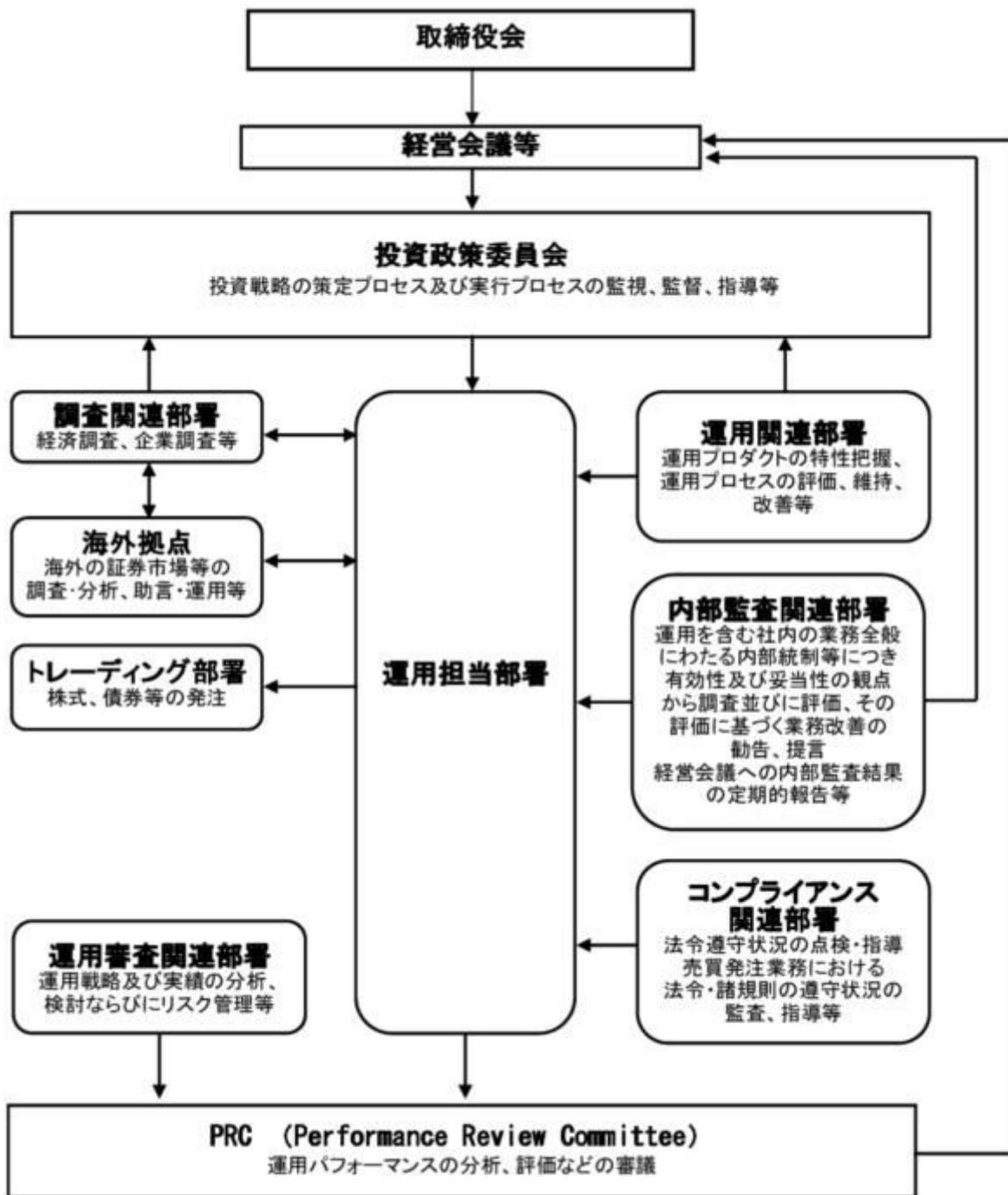
代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2022年9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,011	37,520,719
単体型株式投資信託	198	733,969
追加型公社債投資信託	14	6,232,195
単体型公社債投資信託	496	1,260,025
合計	1,719	45,746,908

3 委託会社等の経理状況

< 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		14	15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産		2,666	1,744
建物	2	1,935	1,219
器具備品	2	731	525
無形固定資産		5,429	5,210

ソフトウェア		5,428		5,209	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		1,767		2,201	
関係会社株式		9,942		9,214	
長期差入保証金		330		443	
長期前払費用		15		13	
前払年金費用		1,301		1,297	
繰延税金資産		3,008		2,784	
その他		122		112	
固定資産計			24,583		23,023
資産合計			125,080		124,440

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			123		120
未払金			16,948		17,615
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		8		17	
未払手数料		7,256		8,357	
関係会社未払金		8,671		8,149	
その他未払金		1,011		1,089	
未払費用	1		9,171		9,512
未払法人税等			2,113		1,319
前受収益			22		22
賞与引当金			3,795		4,416
その他			-		121
流動負債計			32,175		33,127
固定負債					
退職給付引当金			3,299		3,194
時効後支払損引当金			580		588
資産除去債務			1,371		1,123
固定負債計			5,250		4,905
負債合計			37,425		38,033
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			87,596		86,232
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,686		55,322
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		56,001		54,637	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		31,395		30,030	
評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174

純資産合計		87,654	86,407
負債・純資産合計		125,080	124,440

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		106,355	115,733
運用受託報酬		16,583	17,671
その他営業収益		428	530
営業収益計		123,367	133,935
営業費用			
支払手数料		34,739	39,087
広告宣伝費		1,005	804
公告費		0	0
調査費		24,506	26,650
調査費		5,532	4,867
委託調査費		18,974	21,783
委託計算費		1,358	1,384
営業雑経費		4,149	3,094
通信費		73	72
印刷費		976	918
協会費		88	79
諸経費		3,011	2,023
営業費用計		65,760	71,021
一般管理費			
給料		10,985	12,033
役員報酬		147	229
給料・手当		7,156	7,375
賞与		3,682	4,427
交際費		35	47
旅費交通費		64	65
租税公課		1,121	1,049
不動産賃借料		1,147	1,432
退職給付費用		1,267	1,212
固定資産減価償却費		2,700	2,525
諸経費		10,739	11,190
一般管理費計		28,063	29,556
営業利益		29,542	33,357

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
--	--	--

区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,540		3,530	
受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	2	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			290		171
当期純利益			26,276		24,904

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

当期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									

当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	116	116	116
当期変動額合計	116	116	1,247
当期末残高	174	174	86,407

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法						
4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						
5. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						

6．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。

退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。

(4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

7．収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

8．消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。

9. 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>
--------------	--

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[会計方針の変更]

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識しています。

これにより、営業外収益に計上しておりますシステム利用サービスに係る収益について、従来は、当該システム利用サービスに係るシステム関連費用を控除し、純額で認識しておりましたが、控除せず、総額で収益を認識する方法に変更しております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識に関する注記」については記載しておりません。

（時価の算定に関する会計基準の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

[未適用の会計基準等]

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業基準委員会から公表されたものです。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。
未払費用 1,256百万円	未払費用 1,223百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 346百万円	建物 589百万円
器具備品 643	器具備品 618
合計 990	合計 1,207

損益計算書関係

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 3,525百万円
2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 2 ソフトウェア 102 合計 105	2. 固定資産除却損 建物 346百万円 器具備品 28 ソフトウェア - 合計 374

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

金融商品関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとん

どないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引

先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的と

して、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2) その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

(注) 1 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注) 2 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（ ）1.2	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

- () 1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。
2 非上場株式等について、当事業年度において727百万円減損処理を行っております。

(注) 3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

区分	貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）（ ）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

() 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

有価証券関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2021年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

非上場株式（貸借対照表計上額312百万円）及び投資事業有限責任組合への出資金（貸借対照表計上額1,455百万円）は、記載しておりません。

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．売買目的有価証券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2022年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載してありません。

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

デリバティブ取引関係

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	121	121

退職給付関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	626
年金資産の期末残高	19,349
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	19,959 百万円
年金資産	19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	1,521
退職給付の支払額	904
その他	14
退職給付債務の期末残高	21,967

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	672
年金資産の期末残高	19,687

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	18,807 百万円
年金資産	19,687
	879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	45
確定給付制度に係る退職給付費用	959
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	百万円		百万円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,176	賞与引当金	1,381
退職給付引当金	1,022	退職給付引当金	990
関係会社株式評価減	784	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	430	未払事業税	285
投資有価証券評価減	428	投資有価証券評価減	110
減価償却超過額	223	減価償却超過額	272
時効後支払損引当金	179	時効後支払損引当金	182
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	135	ゴルフ会員権評価減	92
資産除去債務	425	資産除去債務	348
未払社会保険料	95	未払社会保険料	114
その他	358	その他	84
繰延税金資産小計	5,410	繰延税金資産小計	5,376
評価性引当額	1,530	評価性引当額	1,795
繰延税金資産合計	3,879	繰延税金資産合計	3,581
繰延税金負債		繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	361	資産除去債務に対応する除去費用	233
関係会社株式評価益	80	関係会社株式評価益	81
その他有価証券評価差額金	25	その他有価証券評価差額金	78
前払年金費用	403	前払年金費用	402
繰延税金負債合計	871	繰延税金負債合計	796
繰延税金資産の純額	3,008	繰延税金資産の純額	2,784
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%
タックスヘイブン税制	1.9%	タックスヘイブン税制	1.8%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%
その他	0.3%	その他	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	自	2020年4月 1日 至 2021年3月31日	自	2021年4月 1日 至 2022年3月31日
期首残高		-		1,371
有形固定資産の取得に伴う増加		1,371		48
資産除去債務の履行による減少		-		296
期末残高		1,371		1,123

収益認識に関する注記

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

セグメント情報等

前事業年度（自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

関連当事者情報

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)

親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	ノムラ・エー ム・ファイ ナンス・イン ク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付 金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息 の受取	9	未収利息	4

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	29,119	未払手数料	6,013

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	17,018円01銭	1株当たり純資産額	16,775円81銭
1株当たり当期純利益	5,101円61銭	1株当たり当期純利益	4,835円10銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	26,276百万円	損益計算書上の当期純利益	24,904百万円
普通株式に係る当期純利益	26,276百万円	普通株式に係る当期純利益	24,904百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社 (再信託受託者：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2022年9月末現在

(2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
株式会社北日本銀行 株式会社千葉銀行	7,761百万円 145,069百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 2022年9月末現在

(3) 投資顧問会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメント U.K.リミテッド)	4,744,391	英国の1986年金融サービス業法に基づき英国金融サービス庁に登録された当該法律の定める範囲内で行う投資顧問業およびそれに付随する一切の業務を営んでいます。
NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC. (ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク)	53,990,965米ドル	米国の1940年投資顧問法に基づき合衆国証券取引委員会(SEC)に登録され当該法律の定める範囲内で行なう投資顧問業およびそれに付随する一切の業務を営んでいます。

* 2022年3月末現在

独立監査人の監査報告書

2022年11月25日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド・インカムオープンの2022年3月16日から2022年9月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド・インカムオープンの2022年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原	尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村	健二郎
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水永	真太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。