

【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】	2024年6月27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・イールド ボンド オープンCコース
【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】	ハイ・イールド ボンド オープンDコース
	ハイ・イールド ボンド オープンCコース
	1兆円を上限とします。
	ハイ・イールド ボンド オープンDコース
	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、2023年12月27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】

（４）発行（売出）価格

<訂正前>

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、午後３時までに、取得申込みが行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。

「基準価額」とは、純資産総額をその時の受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては１万口当りの価額で表示されます。

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/>

<訂正後>

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額をその時の受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては１万口当りの価額で表示されます。

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/>

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(2024年5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

野村證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%

3 投資リスク

< 更新後 >

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

パフォーマンスの考査

投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査（分析、評価）の結果の報告、審議を行ないます。

運用リスクの管理

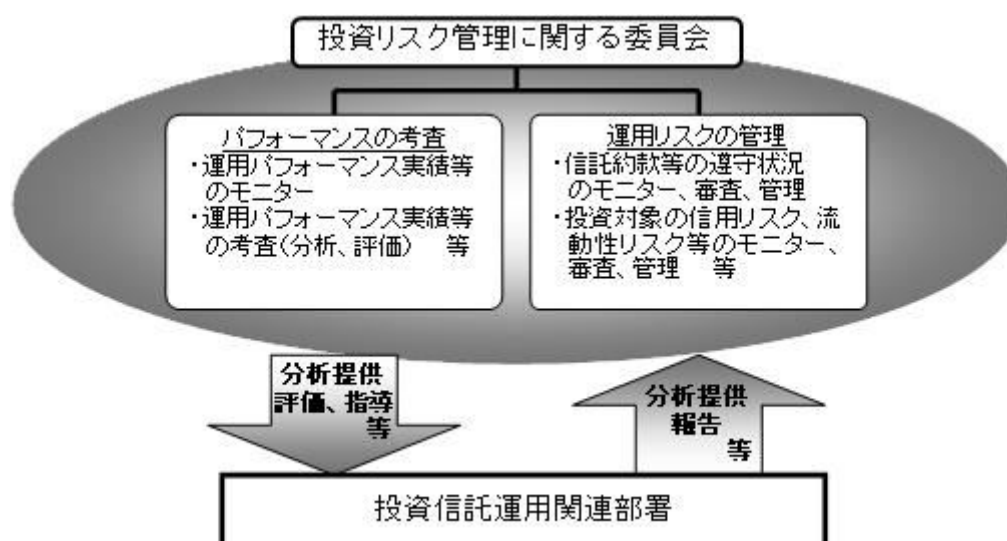
投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

流動性リスク管理について

流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。リスク管理関連の委員会が、流

動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について監督します。

リスク管理体制図



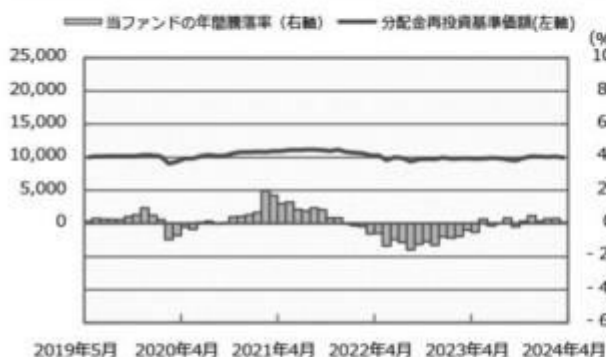
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

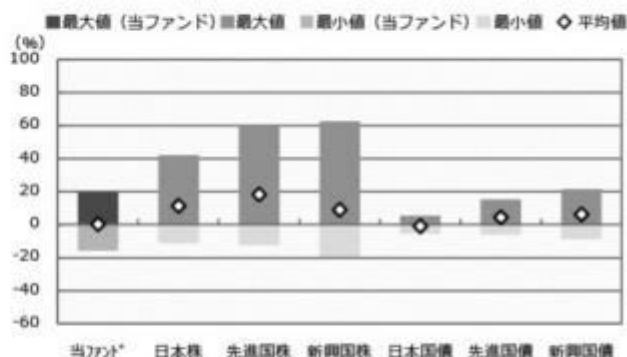
■ リスクの定量的比較 (2019年5月末～2024年4月末：月次)

ICコース

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 (%)	19.7	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値 (%)	△ 15.8	△ 11.4	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値 (%)	0.3	11.4	18.3	8.9	△ 0.9	4.5	6.3

* 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。2019年5月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2019年5月から2024年4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。

* 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。

* 2019年5月から2024年4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。

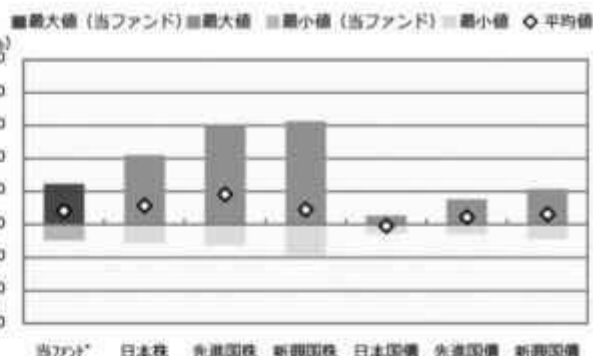
* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

IDコース

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 (%)	24.6	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値 (%)	△ 9.6	△ 11.4	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値 (%)	8.2	11.4	18.3	8.9	△ 0.9	4.5	6.3

- * 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。2019年5月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2019年5月から2024年4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。

- * 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。
- * 2019年5月から2024年4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。

※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。

<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）・・・配当込みTOPIX（「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」といいます。）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標は、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」といいます。）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）に係る標準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。本商品には、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、知的所有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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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値や値段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、JP Morgan 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、または買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「JPMS LLC」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。
- JPMS LLCはNASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPMI、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》
・ 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 ・ 譲渡益 ・ 譲渡損	・ 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。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。

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。

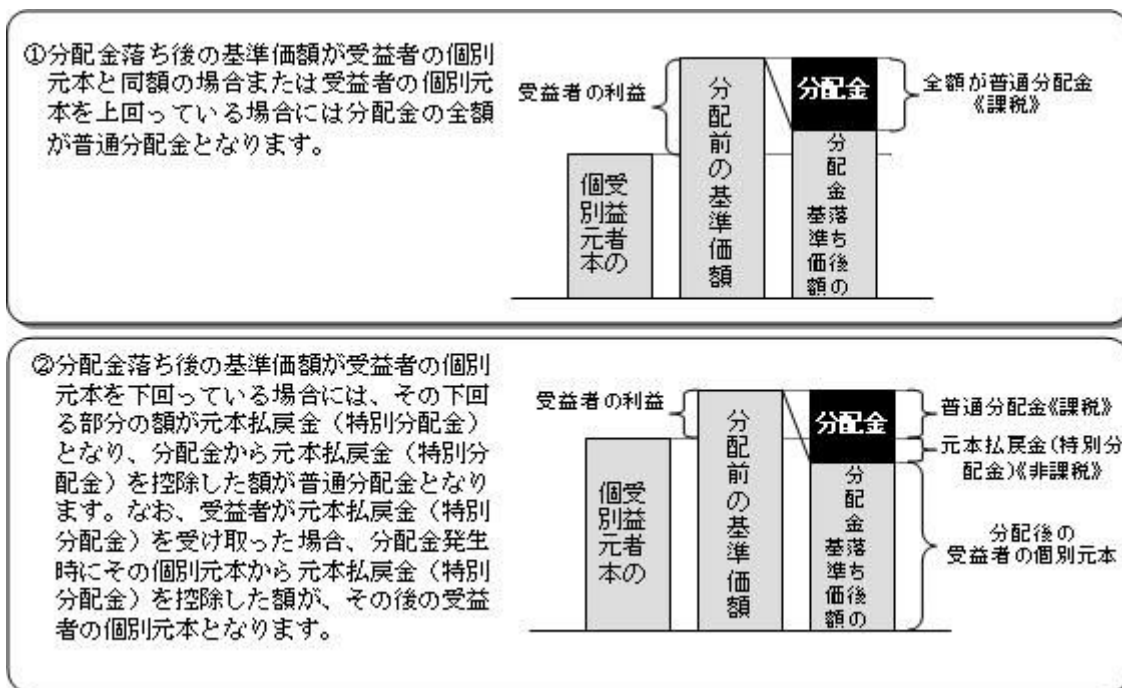
■ 個別元本について ■

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。

上記は2024年4月末現在の情報に基づくものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更される場合があります。

< 更新後 >

（参考情報）ファンドの総経費率

（単位：％）

	総経費率（①＋②）	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
Cコース	1.77	1.72	0.05
Dコース	1.78	1.72	0.06

（2023年9月29日～2024年3月28日）

- * 総経費率の算出にあたっては、作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除しています。
- * 交付運用報告書に記載している1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- * 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
- * 各比率は、年率換算した値です。
- * マザーファンドが支払った費用を含みます。
- * その他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。
- * 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
- * 最新の詳細費用につきましては、委託会社ホームページに掲載している交付運用報告書をご覧ください。

5 運用状況

以下は2024年4月30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・イールド ボンド オープンCコース**

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	45,915,842	100.69
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	317,805	0.69
合計（純資産総額）		45,598,037	100.00

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

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	1,239,683,738	99.16
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	10,402,705	0.83
合計（純資産総額）		1,250,086,443	100.00

（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	43,092,808,207	94.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,274,166,954	5.01
合計（純資産総額）		45,366,975,161	100.00

（２）投資資産**投資有価証券の主要銘柄****ハイ・イールド ボンド オープンCコース**

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	3,462,211	12.8886	44,623,053	13.2620	45,915,842	100.69
---	----	---------------	-----------------------------	-----------	---------	------------	---------	------------	--------

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	100.69
合 計	100.69

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

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	93,476,379	12.8886	1,204,779,659	13.2620	1,239,683,738	99.16

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	99.16
合 計	99.16

（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	PICARD MIDCO INC	1,425,000	14,883.52	212,090,243	14,946.73	212,990,904	6.5	2029/3/31	0.46
2	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	1,375,000	15,534.06	213,593,435	15,405.40	211,824,259	5.75	2027/3/1	0.46
3	アメリカ	社債券	PRIME SECSRV BRW/FINANC	1,275,000	15,403.53	196,395,132	15,376.20	196,046,569	6.25	2028/1/15	0.43
4	アメリカ	社債券	PERFORMANCE FOOD GROUP I	1,275,000	15,372.42	195,998,358	15,210.57	193,934,768	5.5	2027/10/15	0.42
5	アメリカ	社債券	MOZART DEBT MERGER SUB	1,350,000	14,304.54	193,111,397	14,193.63	191,614,119	3.875	2029/4/1	0.42
6	アメリカ	社債券	WEATHERFORD INTERNATIONA	1,150,000	16,388.01	188,462,137	16,352.83	188,057,657	8.625	2030/4/30	0.41
7	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	1,200,000	15,367.18	184,406,176	15,309.78	183,717,467	5.5	2027/11/15	0.40
8	アメリカ	社債券	OLYMPUS WTR US HLDG CORP	1,000,000	16,753.86	167,538,683	16,691.02	166,910,220	9.75	2028/11/15	0.36
9	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	1,075,000	15,329.85	164,795,956	15,219.64	163,611,151	5.125	2027/11/1	0.36
10	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	950,000	17,174.14	163,154,410	17,074.84	162,211,041	10.5	2030/6/1	0.35
11	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	1,050,000	15,526.67	163,030,070	15,313.72	160,794,085	6	2029/5/1	0.35
12	アメリカ	社債券	IMOLA MERGER CORP	1,100,000	14,691.25	161,603,783	14,463.99	159,103,902	4.75	2029/5/15	0.35
13	アメリカ	社債券	UBER TECHNOLOGIES INC	1,075,000	14,927.38	160,469,433	14,666.59	157,665,909	4.5	2029/8/15	0.34
14	アメリカ	社債券	GENESIS ENERGY LP/FIN	987,000	15,869.08	156,627,890	15,925.60	157,185,682	8	2027/1/15	0.34
15	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	1,050,000	14,633.88	153,655,750	14,522.14	152,482,502	4.875	2029/5/1	0.33
16	アメリカ	社債券	SS&C TECHNOLOGIES INC	975,000	15,319.42	149,364,425	15,312.67	149,298,543	5.5	2027/9/30	0.32
17	アメリカ	社債券	SPRINT CORP	875,000	15,897.62	139,104,184	15,809.95	138,337,076	7.625	2025/2/15	0.30
18	アメリカ	社債券	DIRECTV HOLDINGS/FING	925,000	14,852.67	137,387,199	14,701.27	135,986,830	5.875	2027/8/15	0.29
19	アメリカ	社債券	GLOBAL AIR LEASE CO LTD	908,106	14,858.42	134,930,294	14,850.92	134,862,130	6.5	2024/9/15	0.29
20	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	900,000	15,208.20	136,873,822	14,979.86	134,818,765	5.113	2029/5/3	0.29

21	アメリカ	社債券	IRON MOUNTAIN INC	900,000	14,849.80	133,648,204	14,599.59	131,396,385	5.25	2030/7/15	0.28
22	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FINANCE CORP	825,000	15,995.57	131,963,522	15,907.27	131,235,020	7.125	2026/3/15	0.28
23	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	825,000	15,683.59	129,389,673	15,671.22	129,287,621	6.25	2027/2/1	0.28
24	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	1,000,000	13,192.73	131,927,357	12,801.18	128,011,823	4.5	2030/8/15	0.28
25	アメリカ	社債券	CAESARS ENTERTAIN INC	900,000	14,368.53	129,316,770	14,038.35	126,345,162	4.625	2029/10/15	0.27
26	アメリカ	社債券	SRM ESCROW ISSUER LLC	825,000	15,354.89	126,677,878	15,237.54	125,709,778	6	2028/11/1	0.27
27	アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	1,025,000	12,136.46	124,398,759	12,244.59	125,507,101	4.75	2031/2/15	0.27
28	アメリカ	社債券	EQM MIDSTREAM PARTNERS L	875,000	14,592.53	127,684,691	14,341.23	125,485,827	4.75	2031/1/15	0.27
29	アメリカ	社債券	LIFE TIME INC	800,000	15,587.97	124,703,832	15,529.24	124,233,935	5.75	2026/1/15	0.27
30	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	800,000	15,648.60	125,188,841	15,494.91	123,959,347	6.125	2028/10/1	0.27

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	94.98
合 計	94.98

投資不動産物件

ハイ・イールド ボンド オープンCコース

該当事項はありません。

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

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・イールド ボンド オープンCコース

該当事項はありません。

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

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。

（3）運用実績

純資産の推移

ハイ・イールド ボンド オープンCコース

2024年4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26特定期間	(2014年 9月29日)	137	139	1.0410	1.0505
第27特定期間	(2015年 3月30日)	134	135	1.0213	1.0308
第28特定期間	(2015年 9月28日)	111	113	0.9557	0.9652
第29特定期間	(2016年 3月28日)	105	106	0.9184	0.9279
第30特定期間	(2016年 9月28日)	140	141	0.9577	0.9672
第31特定期間	(2017年 3月28日)	147	149	0.9476	0.9571
第32特定期間	(2017年 9月28日)	160	162	0.9491	0.9586
第33特定期間	(2018年 3月28日)	139	140	0.9113	0.9183
第34特定期間	(2018年 9月28日)	138	139	0.9058	0.9098
第35特定期間	(2019年 3月28日)	131	132	0.8941	0.8981
第36特定期間	(2019年 9月30日)	139	139	0.9000	0.9040
第37特定期間	(2020年 3月30日)	120	121	0.7792	0.7832
第38特定期間	(2020年 9月28日)	135	135	0.8703	0.8743
第39特定期間	(2021年 3月29日)	135	136	0.9153	0.9193
第40特定期間	(2021年 9月28日)	124	124	0.9325	0.9365
第41特定期間	(2022年 3月28日)	112	113	0.8677	0.8717
第42特定期間	(2022年 9月28日)	50	50	0.7645	0.7685
第43特定期間	(2023年 3月28日)	61	61	0.7780	0.7820
第44特定期間	(2023年 9月28日)	55	55	0.7628	0.7668
第45特定期間	(2024年 3月28日)	57	57	0.7831	0.7871
	2023年 4月末日	62	—	0.7903	—
	5月末日	60	—	0.7774	—
	6月末日	61	—	0.7816	—
	7月末日	61	—	0.7834	—
	8月末日	57	—	0.7816	—
	9月末日	55	—	0.7626	—
	10月末日	53	—	0.7495	—
	11月末日	55	—	0.7768	—
	12月末日	58	—	0.7947	—
	2024年 1月末日	57	—	0.7864	—
	2月末日	57	—	0.7827	—
	3月末日	56	—	0.7832	—
	4月末日	45	—	0.7726	—

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

2024年4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26特定期間	(2014年 9月29日)	2,406	2,426	0.9027	0.9102
第27特定期間	(2015年 3月30日)	2,377	2,395	0.9696	0.9771
第28特定期間	(2015年 9月28日)	2,073	2,089	0.9239	0.9314
第29特定期間	(2016年 3月28日)	1,761	1,776	0.8450	0.8525
第30特定期間	(2016年 9月28日)	1,640	1,655	0.7909	0.7984

第31特定期間	(2017年 3月28日)	1,733	1,748	0.8709	0.8784
第32特定期間	(2017年 9月28日)	1,690	1,704	0.8995	0.9070
第33特定期間	(2018年 3月28日)	1,478	1,492	0.8127	0.8202
第34特定期間	(2018年 9月28日)	1,518	1,528	0.8725	0.8785
第35特定期間	(2019年 3月28日)	1,426	1,436	0.8438	0.8498
第36特定期間	(2019年 9月30日)	1,366	1,376	0.8359	0.8419
第37特定期間	(2020年 3月30日)	1,134	1,144	0.7207	0.7267
第38特定期間	(2020年 9月28日)	1,217	1,227	0.7849	0.7909
第39特定期間	(2021年 3月29日)	1,251	1,259	0.8532	0.8592
第40特定期間	(2021年 9月28日)	1,235	1,243	0.8746	0.8806
第41特定期間	(2022年 3月28日)	1,228	1,236	0.8895	0.8955
第42特定期間	(2022年 9月28日)	1,171	1,178	0.9277	0.9337
第43特定期間	(2023年 3月28日)	1,079	1,087	0.8695	0.8755
第44特定期間	(2023年 9月28日)	1,199	1,207	0.9960	1.0020
第45特定期間	(2024年 3月28日)	1,230	1,237	1.0647	1.0707
2023年 4月末日		1,128	—	0.9098	—
5月末日		1,155	—	0.9348	—
6月末日		1,200	—	0.9783	—
7月末日		1,176	—	0.9578	—
8月末日		1,208	—	0.9945	—
9月末日		1,197	—	0.9956	—
10月末日		1,181	—	0.9832	—
11月末日		1,198	—	1.0072	—
12月末日		1,180	—	1.0013	—
2024年 1月末日		1,216	—	1.0339	—
2月末日		1,224	—	1.0544	—
3月末日		1,230	—	1.0642	—
4月末日		1,250	—	1.0936	—

分配の推移

ハイ・イールド ボンド オープンCコース

	計算期間	1口当たりの分配金
第26特定期間	2014年 3月29日～2014年 9月29日	0.0285円
第27特定期間	2014年 9月30日～2015年 3月30日	0.0285円
第28特定期間	2015年 3月31日～2015年 9月28日	0.0285円
第29特定期間	2015年 9月29日～2016年 3月28日	0.0285円
第30特定期間	2016年 3月29日～2016年 9月28日	0.0285円
第31特定期間	2016年 9月29日～2017年 3月28日	0.0285円
第32特定期間	2017年 3月29日～2017年 9月28日	0.0285円
第33特定期間	2017年 9月29日～2018年 3月28日	0.0210円
第34特定期間	2018年 3月29日～2018年 9月28日	0.0150円
第35特定期間	2018年 9月29日～2019年 3月28日	0.0120円

第36特定期間	2019年 3月29日～2019年 9月30日	0.0120円
第37特定期間	2019年10月 1日～2020年 3月30日	0.0120円
第38特定期間	2020年 3月31日～2020年 9月28日	0.0120円
第39特定期間	2020年 9月29日～2021年 3月29日	0.0120円
第40特定期間	2021年 3月30日～2021年 9月28日	0.0120円
第41特定期間	2021年 9月29日～2022年 3月28日	0.0120円
第42特定期間	2022年 3月29日～2022年 9月28日	0.0120円
第43特定期間	2022年 9月29日～2023年 3月28日	0.0120円
第44特定期間	2023年 3月29日～2023年 9月28日	0.0120円
第45特定期間	2023年 9月29日～2024年 3月28日	0.0120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。

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

	計算期間	1口当たりの分配金
第26特定期間	2014年 3月29日～2014年 9月29日	0.0225円
第27特定期間	2014年 9月30日～2015年 3月30日	0.0225円
第28特定期間	2015年 3月31日～2015年 9月28日	0.0225円
第29特定期間	2015年 9月29日～2016年 3月28日	0.0225円
第30特定期間	2016年 3月29日～2016年 9月28日	0.0225円
第31特定期間	2016年 9月29日～2017年 3月28日	0.0225円
第32特定期間	2017年 3月29日～2017年 9月28日	0.0225円
第33特定期間	2017年 9月29日～2018年 3月28日	0.0225円
第34特定期間	2018年 3月29日～2018年 9月28日	0.0195円
第35特定期間	2018年 9月29日～2019年 3月28日	0.0180円
第36特定期間	2019年 3月29日～2019年 9月30日	0.0180円
第37特定期間	2019年10月 1日～2020年 3月30日	0.0180円
第38特定期間	2020年 3月31日～2020年 9月28日	0.0180円
第39特定期間	2020年 9月29日～2021年 3月29日	0.0180円
第40特定期間	2021年 3月30日～2021年 9月28日	0.0180円
第41特定期間	2021年 9月29日～2022年 3月28日	0.0180円
第42特定期間	2022年 3月29日～2022年 9月28日	0.0180円
第43特定期間	2022年 9月29日～2023年 3月28日	0.0180円
第44特定期間	2023年 3月29日～2023年 9月28日	0.0180円
第45特定期間	2023年 9月29日～2024年 3月28日	0.0180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・イールド ボンド オープンCコース

	計算期間	収益率
第26特定期間	2014年 3月29日～2014年 9月29日	0.0%
第27特定期間	2014年 9月30日～2015年 3月30日	0.8%
第28特定期間	2015年 3月31日～2015年 9月28日	3.6%

第29特定期間	2015年 9月29日～2016年 3月28日	0.9%
第30特定期間	2016年 3月29日～2016年 9月28日	7.4%
第31特定期間	2016年 9月29日～2017年 3月28日	1.9%
第32特定期間	2017年 3月29日～2017年 9月28日	3.2%
第33特定期間	2017年 9月29日～2018年 3月28日	1.8%
第34特定期間	2018年 3月29日～2018年 9月28日	1.0%
第35特定期間	2018年 9月29日～2019年 3月28日	0.0%
第36特定期間	2019年 3月29日～2019年 9月30日	2.0%
第37特定期間	2019年10月 1日～2020年 3月30日	12.1%
第38特定期間	2020年 3月31日～2020年 9月28日	13.2%
第39特定期間	2020年 9月29日～2021年 3月29日	6.5%
第40特定期間	2021年 3月30日～2021年 9月28日	3.2%
第41特定期間	2021年 9月29日～2022年 3月28日	5.7%
第42特定期間	2022年 3月29日～2022年 9月28日	10.5%
第43特定期間	2022年 9月29日～2023年 3月28日	3.3%
第44特定期間	2023年 3月29日～2023年 9月28日	0.4%
第45特定期間	2023年 9月29日～2024年 3月28日	4.2%

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。

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

	計算期間	収益率
第26特定期間	2014年 3月29日～2014年 9月29日	7.0%
第27特定期間	2014年 9月30日～2015年 3月30日	9.9%
第28特定期間	2015年 3月31日～2015年 9月28日	2.4%
第29特定期間	2015年 9月29日～2016年 3月28日	6.1%
第30特定期間	2016年 3月29日～2016年 9月28日	3.7%
第31特定期間	2016年 9月29日～2017年 3月28日	13.0%
第32特定期間	2017年 3月29日～2017年 9月28日	5.9%
第33特定期間	2017年 9月29日～2018年 3月28日	7.1%
第34特定期間	2018年 3月29日～2018年 9月28日	9.8%
第35特定期間	2018年 9月29日～2019年 3月28日	1.2%
第36特定期間	2019年 3月29日～2019年 9月30日	1.2%
第37特定期間	2019年10月 1日～2020年 3月30日	11.6%
第38特定期間	2020年 3月31日～2020年 9月28日	11.4%
第39特定期間	2020年 9月29日～2021年 3月29日	11.0%
第40特定期間	2021年 3月30日～2021年 9月28日	4.6%
第41特定期間	2021年 9月29日～2022年 3月28日	3.8%
第42特定期間	2022年 3月29日～2022年 9月28日	6.3%
第43特定期間	2022年 9月29日～2023年 3月28日	4.3%
第44特定期間	2023年 3月29日～2023年 9月28日	16.6%
第45特定期間	2023年 9月29日～2024年 3月28日	8.7%

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・イールド ボンド オープンＣコース

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第26特定期間	2014年 3月29日～2014年 9月29日	4,520,000	4,230,000	132,480,000
第27特定期間	2014年 9月30日～2015年 3月30日	3,956,156	5,220,000	131,216,156
第28特定期間	2015年 3月31日～2015年 9月28日	1,415,348	15,527,733	117,103,771
第29特定期間	2015年 9月29日～2016年 3月28日	3,990,478	5,995,617	115,098,632
第30特定期間	2016年 3月29日～2016年 9月28日	52,285,402	20,873,530	146,510,504
第31特定期間	2016年 9月29日～2017年 3月28日	10,534,729	1,302,406	155,742,827
第32特定期間	2017年 3月29日～2017年 9月28日	15,628,723	2,253,255	169,118,295
第33特定期間	2017年 9月29日～2018年 3月28日	9,356,292	25,142,360	153,332,227
第34特定期間	2018年 3月29日～2018年 9月28日	—	68,699	153,263,528
第35特定期間	2018年 9月29日～2019年 3月28日	4,246,322	10,246,765	147,263,085
第36特定期間	2019年 3月29日～2019年 9月30日	18,439,253	11,136,413	154,565,925
第37特定期間	2019年10月 1日～2020年 3月30日	1,533,762	1,276,682	154,823,005
第38特定期間	2020年 3月31日～2020年 9月28日	5,711,728	5,309,810	155,224,923
第39特定期間	2020年 9月29日～2021年 3月29日	2,295,325	8,959,708	148,560,540
第40特定期間	2021年 3月30日～2021年 9月28日	10,554	15,452,269	133,118,825
第41特定期間	2021年 9月29日～2022年 3月28日	105,577	3,009,482	130,214,920
第42特定期間	2022年 3月29日～2022年 9月28日	10,771,001	74,701,436	66,284,485
第43特定期間	2022年 9月29日～2023年 3月28日	12,785,193	273,793	78,795,885
第44特定期間	2023年 3月29日～2023年 9月28日	267,014	6,759,097	72,303,802
第45特定期間	2023年 9月29日～2024年 3月28日	1,343,331	573,880	73,073,253

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

ハイ・イールド ボンド オープンＤコース

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第26特定期間	2014年 3月29日～2014年 9月29日	2,450,000	166,030,000	2,665,620,000
第27特定期間	2014年 9月30日～2015年 3月30日	9,302,577	222,926,620	2,451,995,957
第28特定期間	2015年 3月31日～2015年 9月28日	13,444,882	221,674,011	2,243,766,828
第29特定期間	2015年 9月29日～2016年 3月28日	6,911,129	166,557,712	2,084,120,245
第30特定期間	2016年 3月29日～2016年 9月28日	79,489,907	89,827,053	2,073,783,099
第31特定期間	2016年 9月29日～2017年 3月28日	23,441,167	106,591,027	1,990,633,239
第32特定期間	2017年 3月29日～2017年 9月28日	11,470,000	123,198,869	1,878,904,370
第33特定期間	2017年 9月29日～2018年 3月28日	9,373,936	68,412,154	1,819,866,152
第34特定期間	2018年 3月29日～2018年 9月28日	9,230,855	89,289,237	1,739,807,770
第35特定期間	2018年 9月29日～2019年 3月28日	19,557,360	68,469,113	1,690,896,017
第36特定期間	2019年 3月29日～2019年 9月30日	10,657,113	66,604,721	1,634,948,409
第37特定期間	2019年10月 1日～2020年 3月30日	4,863,122	65,570,950	1,574,240,581

第38特定期間	2020年 3月31日～2020年 9月28日	12,616,521	35,364,336	1,551,492,766
第39特定期間	2020年 9月29日～2021年 3月29日	4,066,752	89,373,994	1,466,185,524
第40特定期間	2021年 3月30日～2021年 9月28日	13,066,769	66,660,981	1,412,591,312
第41特定期間	2021年 9月29日～2022年 3月28日	11,471,343	43,265,274	1,380,797,381
第42特定期間	2022年 3月29日～2022年 9月28日	5,593,555	123,803,317	1,262,587,619
第43特定期間	2022年 9月29日～2023年 3月28日	5,653,747	26,588,632	1,241,652,734
第44特定期間	2023年 3月29日～2023年 9月28日	12,685,655	49,622,958	1,204,715,431
第45特定期間	2023年 9月29日～2024年 3月28日	5,958,065	54,769,872	1,155,903,624

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

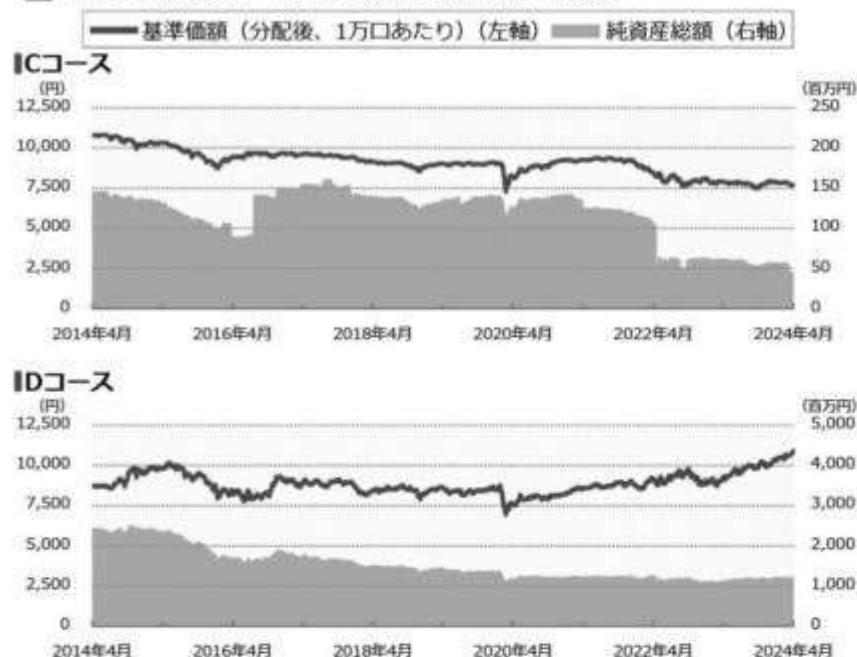
参考情報

< 更新後 >



運用実績（2024年4月30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）

ICコース	
2024年3月	40 円
2024年1月	40 円
2023年11月	40 円
2023年9月	40 円
2023年7月	40 円
直近1年間累計	240 円
設定来累計	9,375 円

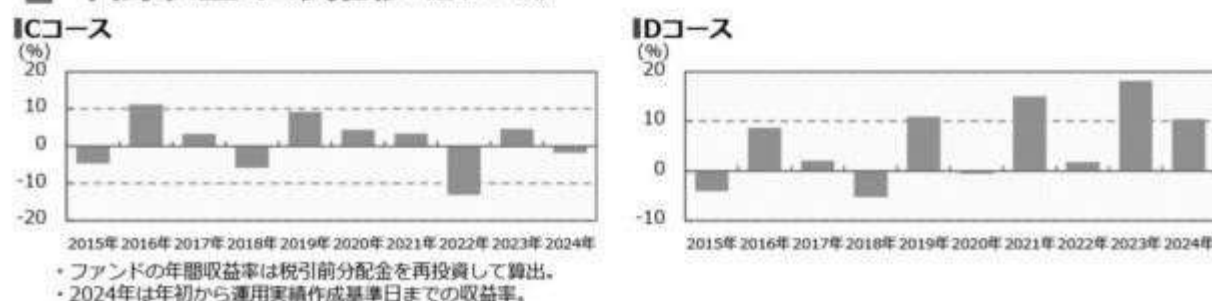
IDコース	
2024年3月	60 円
2024年1月	60 円
2023年11月	60 円
2023年9月	60 円
2023年7月	60 円
直近1年間累計	360 円
設定来累計	10,910 円

■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	種類	投資比率（％）	
			Cコース	Dコース
1	PICARD MIDCO INC	社債券	0.5	0.5
2	CARNIVAL CORP	社債券	0.5	0.5
3	PRIME SECSRVC BRW/FINANC	社債券	0.4	0.4
4	PERFORMANCE FOOD GROUP I	社債券	0.4	0.4
5	MOZART DEBT MERGER SUB	社債券	0.4	0.4
6	WEATHERFORD INTERNATIONA	社債券	0.4	0.4
7	TRANSDIGM INC	社債券	0.4	0.4
8	OLYMPUS WTR US HLDG CORP	社債券	0.4	0.4
9	TENET HEALTHCARE CORP	社債券	0.4	0.4
10	CARNIVAL CORP	社債券	0.4	0.3

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



●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。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

第2【管理及び運営】

1 申込（販売）手続等

< 訂正前 >

(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。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

(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) 販売単位

1万口以上1口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。

(4) 販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

(5) 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販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

(6) スイッチング

「Cコース」「Dコース」間でスイッチングができます。

なお、「ハイ・イールド ボンド オープンAコース」「ハイ・イールド ボンド オープンBコース」の一般コースの換金代金をもって、「Cコース」「Dコース」へのスイッチングが可能です。スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

（販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。）

(7) 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」という場合があります。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（スイッチングの申込みを含みます）の受け付けを中止すること、および既に受付けた取得申込み（スイッチングの申込みを含みます）の受け付けを取り消す場合があります。

上記の取得申込みの受け付けの中止等を行なう事情等によっては、スイッチングのお申込みについては可能な場合もあります。

(8) 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。

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/>

購入およびスイッチング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。

< 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。
販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

(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。

（注）2024年11月5日以降は以下に変更となる予定です。

原則、午後3時30分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。

（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。）

(3) 販売単位

1万口以上1口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。

(4) 販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

(5) 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販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

(6) スイッチング

「Cコース」「Dコース」間でスイッチングができます。

なお、「ハイ・イールド ボンド オープンAコース」「ハイ・イールド ボンド オープンBコース」の一般コースの換金代金をもって、「Cコース」「Dコース」へのスイッチングが可能です。スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

（販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。）

(7) 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」

という場合があります、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(スイッチングの申込みを含みます)の受付けを中止すること、および既に受付けた取得申込み(スイッチングの申込みを含みます)の受付けを取り消す場合があります。

上記の取得申込みの受付けの中止等を行なう事情等によっては、スイッチングのお申込みについては可能な場合もあります。

(8) 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。

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/>

購入およびスイッチング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 >

(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が完了したものを当日の申込み分とします。

(3) 換金単位

1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。

(4) 換金価額

解約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5億円を超える一部解約はできません。また、別途換金制限を設ける場合があります。

(6)換金代金の支払い

原則として解約申込みの受付日から起算して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、当該受け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け付けたものとします。

(8)受益権の買取り(買取請求制)

買取単位、買取請求の受け付け、買取価額、買取制限、買取代金の支払い、買取りの受け付けの中止および取り消しは、一部解約の実行の請求の場合と同様です。

買取請求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。

ただし、受益権の管理方法等の一定の要件下では上記の買取価額が適用とならない場合があります。

また、買取価額と取得価額との差額については譲渡所得の取り扱いとなります。

(9)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。

< 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が完了したものを当日の申込み分とします。

（注）2024年11月5日以降は以下に変更となる予定です。

一部解約の実行の請求の受け付けについては、原則、午後3時30分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が完了したものを当日の申込み分とします。

（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。）

（3）換金単位

1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。

（4）換金価額

解約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5億円を超える一部解約はできません。また、別途換金制限を設ける場合があります。

（6）換金代金の支払い

原則として解約申込みの受付日から起算して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、当該受け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。

（8）受益権の買取り（買取請求制）

買取単位、買取請求の受け付け、買取価額、買取制限、買取代金の支払い、買取りの受け付けの中止および取り消しは、一部解約の実行の請求の場合と同様です。

買取請求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。

ただし、受益権の管理方法等の一定の要件下では上記の買取価額が適用とされない場合があります。

また、買取価額と取得価額との差額については譲渡所得の取り扱いとなります。

（9）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。

第3【ファンドの経理状況】

ハイ・イールド ボンド オープンCコース
ハイ・イールド ボンド オープンDコース

(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(2023年9月29日から2024年3月28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・イールド ボンド オープンCコース

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	前期 (2023年 9月28日現在)	当期 (2024年 3月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	553,639	1,033,522
親投資信託受益証券	54,405,341	57,128,938
未収入金	1,360,000	400,000
未収利息	-	2
流動資産合計	56,318,980	58,562,462
資産合計	56,318,980	58,562,462
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	686,938	878,646
未払金	18,636	8,458
未払収益分配金	289,215	292,293
未払受託者報酬	5,481	5,080
未払委託者報酬	166,470	154,560
未払利息	1	-
その他未払費用	197	185
流動負債合計	1,166,938	1,339,222
負債合計	1,166,938	1,339,222
純資産の部		
元本等		
元本	72,303,802	73,073,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	17,151,760	15,850,013
(分配準備積立金)	5,066,457	5,513,902
元本等合計	55,152,042	57,223,240
純資産合計	55,152,042	57,223,240
負債純資産合計	56,318,980	58,562,462

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
営業収益		
受取利息	-	10
有価証券売買等損益	10,009,989	5,303,597

	前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
為替差損益	9,672,047	2,485,787
営業収益合計	337,942	2,817,820
営業費用		
支払利息	223	16
受託者報酬	16,814	15,456
委託者報酬	510,976	470,023
その他費用	6,538	569
営業費用合計	534,551	486,064
営業利益又は営業損失（ ）	196,609	2,331,756
経常利益又は経常損失（ ）	196,609	2,331,756
当期純利益又は当期純損失（ ）	196,609	2,331,756
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（ ）	39,537	640
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,491,366	17,151,760
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,469,802	135,288
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,469,802	135,288
剰余金減少額又は欠損金増加額	58,264	292,736
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	58,264	292,736
分配金	914,860	871,921
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,151,760	15,850,013

（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。 為替予約取引 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。
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。 為替差損益 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。 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。
4.その他	当該財務諸表の特定期間は、2023年 9月29日から2024年 3月28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 2023年 9月28日現在	当期 2024年 3月28日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 72,303,802口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 73,073,253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 17,151,760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 15,850,013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 0.7628円 (10,000口当たり純資産額) (7,628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 0.7831円 (10,000口当たり純資産額) (7,831円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
1.運用の外部委託費用 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 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。 支払金額 90,828,105円	1.運用の外部委託費用 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 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。 支払金額 102,431,909円

2. 分配金の計算過程

2023年 3月29日から2023年 5月29日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	413,206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	27,201,584円
分配準備積立金額	D	5,051,209円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	32,665,999円
当ファンドの期末残存口数	F	78,275,129口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,173円
10,000口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	313,100円

2023年 5月30日から2023年 7月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	548,506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	27,153,671円
分配準備積立金額	D	5,141,993円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	32,844,170円
当ファンドの期末残存口数	F	78,136,493口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,203円
10,000口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	312,545円

2023年 7月29日から2023年 9月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	394,988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	25,142,980円
分配準備積立金額	D	4,960,684円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,498,652円
当ファンドの期末残存口数	F	72,303,802口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,218円
10,000口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	289,215円

2. 分配金の計算過程

2023年 9月29日から2023年11月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	468,204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	24,980,388円
分配準備積立金額	D	5,033,605円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	30,482,197円
当ファンドの期末残存口数	F	71,834,975口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,243円
10,000口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	287,339円

2023年11月29日から2024年 1月29日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	479,988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	25,512,760円
分配準備積立金額	D	5,207,050円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,199,798円
当ファンドの期末残存口数	F	73,072,253口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,269円
10,000口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	292,289円

2024年 1月30日から2024年 3月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	411,515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	25,513,251円
分配準備積立金額	D	5,394,680円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,319,446円
当ファンドの期末残存口数	F	73,073,253口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,286円
10,000口当たり分配金額	H	40円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	292,293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 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
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。 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、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。 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。 当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。 ○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っております。 ○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っております。 ○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っております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2023年 9月28日現在	当期 2024年 3月28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 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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 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。	1．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2．時価の算定方法 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28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 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
期首元本額 78,795,885円	期首元本額 72,303,802円
期中追加設定元本額 267,014円	期中追加設定元本額 1,343,331円
期中一部解約元本額 6,759,097円	期中一部解約元本額 573,880円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28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	3,107,592	1,906,424
合計	3,107,592	1,906,424

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	前期(2023年 9月28日現在)				当期(2024年 3月28日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	52,270,687	-	52,957,625	686,938	54,820,573	-	55,699,219	878,646
米ドル	52,270,687	-	52,957,625	686,938	54,820,573	-	55,699,219	878,646
合計	52,270,687	-	52,957,625	686,938	54,820,573	-	55,699,219	878,646

（注）時価の算定方法

1 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。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2024年3月28日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2024年3月28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	4,432,517	57,128,938	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 99.8%	4,432,517	57,128,938 100.0%	
	合計			57,128,938	

(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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	前期 (2023年 9月28日現在)	当期 (2024年 3月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,168,069	12,064,940
親投資信託受益証券	1,186,032,533	1,218,364,655
未収入金	12,500,000	12,800,000
未収利息	-	24
流動資産合計	1,210,700,602	1,243,229,619
資産合計	1,210,700,602	1,243,229,619
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,228,292	6,935,421
未払解約金	-	2,180,760
未払受託者報酬	112,023	108,285
未払委託者報酬	3,405,485	3,291,840
未払利息	27	-
その他未払費用	4,455	4,313
流動負債合計	10,750,282	12,520,619
負債合計	10,750,282	12,520,619
純資産の部		
元本等		
元本	1,204,715,431	1,155,903,624
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,765,111	74,805,376
(分配準備積立金)	128,910,806	133,404,669
元本等合計	1,199,950,320	1,230,709,000
純資産合計	1,199,950,320	1,230,709,000
負債純資産合計	1,210,700,602	1,243,229,619

(2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
営業収益		
受取利息	4	195
有価証券売買等損益	188,232,406	112,032,122
営業収益合計	188,232,410	112,032,317
営業費用		
支払利息	2,830	958
受託者報酬	323,954	330,145
委託者報酬	9,848,294	10,036,364
その他費用	12,894	13,146
営業費用合計	10,187,972	10,380,613
営業利益又は営業損失（ ）	178,044,438	101,651,704
経常利益又は経常損失（ ）	178,044,438	101,651,704
当期純利益又は当期純損失（ ）	178,044,438	101,651,704
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（ ）	1,619,923	194,389
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	162,070,902	4,765,111
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,570,988	124,176
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,570,988	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	124,176
剰余金減少額又は欠損金増加額	674,024	878,864
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	878,864
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	674,024	-
分配金	22,015,688	21,132,140
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,765,111	74,805,376

（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、2023年 9月29日から2024年 3月28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 2023年 9月28日現在	当期 2024年 3月28日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 1,204,715,431口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 1,155,903,624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 4,765,111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 0.9960円 (10,000口当たり純資産額) (9,960円)	2. 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 1.0647円 (10,000口当たり純資産額) (10,647円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
1. 運用の外部委託費用 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 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。 支払金額 90,828,105円	1. 運用の外部委託費用 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 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。 支払金額 102,431,909円

2. 分配金の計算過程

2023年 3月29日から2023年 5月29日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,405,556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	164,109,573円
分配準備積立金額	D	122,654,612円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	297,169,741円
当ファンドの期末残存口数	F	1,236,102,236口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,404円
10,000口当たり分配金額	H	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,416,613円

2023年 5月30日から2023年 7月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,596,001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	163,649,750円
分配準備積立金額	D	124,337,160円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	298,582,911円
当ファンドの期末残存口数	F	1,228,463,952口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,430円
10,000口当たり分配金額	H	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,370,783円

2023年 7月29日から2023年 9月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,271,332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	160,739,672円
分配準備積立金額	D	124,867,766円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	296,878,770円
当ファンドの期末残存口数	F	1,204,715,431口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,464円
10,000口当たり分配金額	H	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,228,292円

2. 分配金の計算過程

2023年 9月29日から2023年11月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,165,587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	158,947,083円
分配準備積立金額	D	127,084,268円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	296,196,938円
当ファンドの期末残存口数	F	1,189,618,523口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,489円
10,000口当たり分配金額	H	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,137,711円

2023年11月29日から2024年 1月29日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,442,939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	157,427,653円
分配準備積立金額	D	128,453,872円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	296,324,464円
当ファンドの期末残存口数	F	1,176,501,417口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,518円
10,000口当たり分配金額	H	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,059,008円

2024年 1月30日から2024年 3月28日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,023,428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	154,894,915円
分配準備積立金額	D	129,316,662円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	295,235,005円
当ファンドの期末残存口数	F	1,155,903,624口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,554円
10,000口当たり分配金額	H	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,935,421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 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
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。 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。 3. 金融商品に係るリスク管理体制 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。 ○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っております。 ○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っております。 ○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っております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2023年 9月28日現在	当期 2024年 3月28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 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。 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。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法 同左
---	--

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28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 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日
期首元本額 1,241,652,734円	期首元本額 1,204,715,431円
期中追加設定元本額 12,685,655円	期中追加設定元本額 5,958,065円
期中一部解約元本額 49,622,958円	期中一部解約元本額 54,769,872円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年 3月29日 至 2023年 9月28日	当期 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28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	68,321,032	40,676,435
合計	68,321,032	40,676,435

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(2024年3月28日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年3月28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	94,530,411	1,218,364,655	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：99.0%	94,530,411	1,218,364,655 100.0%	
	合計			1,218,364,655	

(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）

「ハイ・イールド ボンド オープンCコース」および「ハイ・イールド ボンド オープンDコース」は「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。

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）

(2024年 3月28日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,471,558,788
コール・ローン	707,224,938
社債券	41,854,319,143
未収利息	651,475,117
前払費用	21,142,546
流動資産合計	44,705,720,532
資産合計	44,705,720,532
負債の部	
流動負債	
未払金	338,765,158
未払解約金	247,000,000
流動負債合計	585,765,158
負債合計	585,765,158
純資産の部	
元本等	
元本	3,423,189,566
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	40,696,765,808
元本等合計	44,119,955,374
純資産合計	44,119,955,374
負債純資産合計	44,705,720,532

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相場の中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）

2024年 3月28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	12.8886円
(10,000口当たり純資産額)	(128,886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 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日	
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。
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、附属明細表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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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。

○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。

○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。

○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。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2024年 3月28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

社債券

（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。

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。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2024年 3月28日現在

期首	2023年 9月29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	3,268,802,384円
同期中における追加設定元本額	588,983,064円
同期中における一部解約元本額	434,595,882円
期末元本額	3,423,189,566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	89,090,331円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース	307,231,178円
ハイ・イールド ボンド オープンCコース	4,432,517円
ハイ・イールド ボンド オープンDコース	94,530,411円
ハイブリッド・インカムオープン	57,452,528円
ハイ・イールド ボンド オープンAコース（野村SMA向け）	106,197,767円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース（野村SMA向け）	161,952,419円
ハイ・イールド ボンド オープン Aコース（野村SMA・EW向け）	827,567,815円
ハイ・イールド ボンド オープン Bコース（野村SMA・EW向け）	1,774,734,600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(2024年3月28日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年3月28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	74,902.38	
		1011778 BC / NEW RED FIN	675,000.00	636,978.87	
		1011778 BC / NEW RED FIN	725,000.00	646,358.74	
		AAR ESCROW ISSUER LLC	150,000.00	151,727.70	
		ABERCROMBIE & FITCH MANA	250,000.00	253,039.00	
		ACRISURE LLC / FIN INC	725,000.00	652,610.92	
		ACURIS FIN US/ACURIS FIN	200,000.00	182,252.26	
		ACUSHNET CO	75,000.00	77,757.00	
		ADAMS HOMES INC	425,000.00	442,510.85	
		ADIENT GLOBAL HOLDINGS	250,000.00	264,583.85	
		ADT SEC CORP	225,000.00	206,151.77	
		ADTALEM GLOBAL EDUCATION	287,000.00	273,613.34	
		AETHON UN/AETHIN UN FIN	275,000.00	278,665.20	

AFFINITY GAMING	650,000.00	607,812.40	
AG ISSUER LLC	350,000.00	343,208.32	
AG TTMT ESCROW ISSUER	50,000.00	51,824.75	
AIR CANADA	175,000.00	166,698.22	
ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	175,000.00	173,443.60	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	675,000.00	653,143.56	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	300,000.00	303,147.36	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	175,000.00	157,855.68	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	75,000.00	71,371.61	
ALCOA NEDERLAND HOLDING	225,000.00	225,442.37	
ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000.00	204,382.20	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	150,000.00	147,975.01	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	175,000.00	164,835.49	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	325,000.00	301,673.35	
ALLIED UNI HLD / ALL FIN	200,000.00	182,673.66	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	432,000.00	431,466.52	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	375,000.00	379,539.78	
ALLISON TRANSMISSION INC	100,000.00	96,342.59	
ALLISON TRANSMISSION INC	175,000.00	173,285.50	
ALTICE FINANCING SA	400,000.00	389,316.28	
ALTICE FINANCING SA	400,000.00	331,242.96	
ALTICE FINANCING SA	325,000.00	259,679.42	
ALTICE FRANCE SA	600,000.00	470,595.84	
ALTICE FRANCE SA	225,000.00	163,135.64	
ALTICE FRANCE SA	400,000.00	273,833.72	
ALTICE FRANCE SA	400,000.00	273,631.08	
AMC NETWORKS INC	50,000.00	50,000.00	
AMC NETWORKS INC	350,000.00	249,832.76	
AMERICAN AIRLINES INC	725,000.00	736,552.15	
AMERICAN AIRLINES INC	375,000.00	396,364.23	
AMERICAN AIRLINES/AADVAN	800,000.00	786,249.28	
AMERIGAS PART/FIN CORP	300,000.00	300,170.10	
AMERIGAS PART/FIN CORP	200,000.00	199,854.74	
AMERIGAS PART/FIN CORP	200,000.00	195,553.84	
AMERITEX HOLDCO INTERMED	450,000.00	485,254.80	
AMN HEALTHCARE INC	475,000.00	426,765.22	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	300,000.00	306,432.90	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	150,000.00	148,227.61	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	175,000.00	172,260.41	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	200,000.00	200,972.80	
ANTERO RESOURCES CORP	175,000.00	168,203.49	
ANTERO RESOURCES MIDSTRE	225,000.00	216,439.96	
	672,200.00	598,520.15	

ANYWHERE REAL EST			
APACHE CORP	200,000.00	170,923.32	
API ESCROW CORP	100,000.00	92,100.04	
API GROUP DE INC	150,000.00	135,297.52	
APX GROUP INC	225,000.00	216,664.74	
ARAMARK SERVICES INC	400,000.00	386,145.36	
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	525,000.00	518,771.19	
ARCONIC INC	200,000.00	202,972.80	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	193,664.04	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	181,231.52	
ARSENAL AIC PARENT LLC	175,000.00	184,579.36	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	100,000.00	92,367.85	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	100,000.00	90,444.49	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	275,000.00	275,801.90	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	175,000.00	220,339.87	
ASGN INCORPORATED	650,000.00	614,815.50	
ASHTON WOODS USA/FINANCE	150,000.00	138,452.22	
ASHTON WOODS USA/FINANCE	600,000.00	547,780.98	
ASTON MARTIN CAPITAL HOL	200,000.00	203,551.00	
ATI INC	125,000.00	129,425.00	
ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI	200,000.00	181,959.80	
AVANTOR FUNDING INC	500,000.00	474,450.20	
AVANTOR FUNDING INC	450,000.00	405,972.00	
AVIENT CORP	175,000.00	179,818.27	
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	525,000.00	508,560.57	
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	100,000.00	96,343.77	
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	450,000.00	416,364.25	
BALL CORP	275,000.00	271,782.88	
BALL CORP	225,000.00	231,382.35	
BALL CORP	300,000.00	303,157.56	
BALL CORP	350,000.00	297,417.43	
BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	100,715.00	
BANK OF AMERICA CORP	125,000.00	125,430.62	
BAUSCH & LOMB ESCROW COR	350,000.00	363,286.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	175,000.00	109,104.62	
BAUSCH HEALTH COS INC	300,000.00	173,329.50	
BAYTEX ENERGY CORP	575,000.00	600,250.55	
BEACON ROOFING SUPPLY IN	100,000.00	97,173.34	
BEACON ROOFING SUPPLY IN	200,000.00	181,554.54	
BEACON ROOFING SUPPLY IN	125,000.00	126,894.87	
BEAZER HOMES USA	400,000.00	405,558.40	
BEAZER HOMES USA	75,000.00	75,839.32	
BELLRING BRANDS INC	300,000.00	309,953.52	

BENTELER INTERNATIONAL A	200,000.00	216,622.80	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	300,000.00	294,403.95	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	250,000.00	247,679.60	
BERRY GLOBAL INC	465,000.00	452,155.25	
BLACKSTONE MORTGAGE TR	175,000.00	156,509.72	
BLUE RACER MID LLC/FINAN	175,000.00	176,078.00	
BLUE RACER MID LLC/FINAN	325,000.00	324,621.21	
BOMBARDIER INC	150,000.00	152,314.95	
BOMBARDIER INC	675,000.00	676,453.95	
BOMBARDIER INC	50,000.00	49,272.12	
BOMBARDIER INC	750,000.00	773,123.25	
BOMBARDIER INC	150,000.00	160,511.88	
BOMBARDIER INC	125,000.00	125,625.31	
BONANZA CREEK ENERGY INC	150,000.00	146,580.63	
BORR IHC LTD / BORR FIN	200,000.00	208,536.80	
BORR IHC LTD / BORR FIN	200,000.00	209,000.00	
BOYD GAMING CORP	700,000.00	644,002.03	
BOYNE USA INC	475,000.00	438,791.46	
BRAND INDUSTRIAL SERVICE	225,000.00	243,248.28	
BREAD FINANCIAL HLDGS	200,000.00	208,455.60	
BRINK'S CO/THE	500,000.00	474,679.65	
BRISTOW GROUP INC	650,000.00	635,534.31	
BROOKFIELD RESID PROPERT	200,000.00	181,923.10	
BROOKFIELD RESID PROPERT	150,000.00	134,875.44	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	100,000.00	95,481.85	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	825,000.00	738,387.70	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	250,000.00	253,930.25	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	225,000.00	226,442.79	
CAESARS ENTERTAIN INC	900,000.00	824,198.66	
CAESARS ENTERTAIN INC	650,000.00	666,946.15	
CAESARS ENTERTAIN INC	275,000.00	277,663.65	
CALLON PETROLEUM CO	150,000.00	151,594.50	
CALLON PETROLEUM CO	100,000.00	106,118.20	
CALPINE CORP	141,000.00	139,694.59	
CALPINE CORP	425,000.00	403,163.33	
CALPINE CORP	550,000.00	527,450.44	
CALPINE CORP	150,000.00	138,843.82	
CALPINE CORP	100,000.00	92,304.60	
CARLYLE AVIATION ELEVATE	200,000.00	199,318.02	
CARNIVAL CORP	425,000.00	430,594.95	
CARNIVAL CORP	1,375,000.00	1,361,334.83	
CARNIVAL CORP	1,050,000.00	1,039,069.92	

CARNIVAL CORP	950,000.00	1,039,862.40
CARNIVAL HLDGS BM LTD	150,000.00	163,670.10
CARPENTER TECHNOLOGY	275,000.00	274,731.79
CASTLELAKE AVIATION FIN	225,000.00	217,342.10
CATALENT PHARMA SOLUTION	400,000.00	383,987.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	675,000.00	643,023.22
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	800,000.00	744,954.08
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	205,510.92
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	375,000.00	355,590.33
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	400,000.00	343,916.80
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	1,000,000.00	840,837.20
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	400,000.00	325,963.60
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	350,000.00	342,789.09
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	550,000.00	449,520.28
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	875,000.00	702,795.62
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	425,000.00	332,049.48
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	169,717.86
CDI ESCROW ISSUER INC	225,000.00	217,347.18
CDW LLC/CDW FINANCE	250,000.00	245,368.15
CDW LLC/CDW FINANCE	150,000.00	143,629.65
CEDAR FAIR LP	275,000.00	260,687.35
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	300,000.00	299,090.13
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	350,000.00	345,022.51
CENTENE CORP	725,000.00	692,047.51
CENTENE CORP	550,000.00	521,810.96
CENTRAL GARDEN & PET CO	150,000.00	132,158.04
CENTURY COMMUNITIES	325,000.00	327,118.35
CENTURY COMMUNITIES	100,000.00	90,093.98
CENTURYLINK INC	150,000.00	92,383.50
CHAMPIONS FINANCING INC	125,000.00	130,836.51
CHARLES RIVER LABORATORI	150,000.00	141,835.81
CHARLES RIVER LABORATORI	550,000.00	491,607.82
CHART INDUSTRIES INC	250,000.00	259,684.00
CHART INDUSTRIES INC	225,000.00	245,444.40
CHEMOURS CO	625,000.00	581,327.56
CHEMOURS CO	325,000.00	283,889.58
CHENIERE ENERGY PARTNERS	525,000.00	477,112.02
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	112,000.00	111,792.31
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	625,000.00	576,214.50
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	425,000.00	371,294.45
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	375,000.00	306,268.42
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	1,025,000.00	792,853.79
CHURCHILL DOWNS INC	175,000.00	171,798.58

CINEMARK USA INC	625,000.00	592,176.56	
CITGO PETROLEUM CORP	500,000.00	499,908.70	
CITGO PETROLEUM CORP	300,000.00	301,127.40	
CITGO PETROLEUM CORP	250,000.00	262,292.00	
CITIGROUP INC	400,000.00	391,793.44	
CITIGROUP INC	175,000.00	168,173.25	
CITIGROUP INC	50,000.00	50,191.35	
CIVITAS RESOURCES INC	200,000.00	210,623.06	
CIVITAS RESOURCES INC	175,000.00	188,024.21	
CIVITAS RESOURCES INC	225,000.00	241,177.32	
CLEAN HARBORS INC	200,000.00	201,431.40	
CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO	225,000.00	223,968.42	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	550,000.00	518,621.62	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	725,000.00	687,038.56	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	100,000.00	85,988.28	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	100,000.00	84,359.21	
CLEVELAND-CLIFFS INC	225,000.00	224,955.33	
CLEVELAND-CLIFFS INC	375,000.00	340,732.98	
CNX RESOURCES CORP	225,000.00	220,684.63	
COEUR MINING INC	225,000.00	213,373.21	
COINBASE GLOBAL INC	375,000.00	305,083.12	
COLT MERGER SUB INC	450,000.00	461,050.11	
COMMERCIAL METALS CO	100,000.00	92,086.17	
COMMERCIAL METALS CO	75,000.00	66,911.43	
COMMERCIAL METALS CO	100,000.00	90,291.01	
COMMScope FINANCE LLC	200,000.00	183,250.00	
COMMScope FINANCE LLC	300,000.00	140,418.15	
COMMScope INC	200,000.00	78,730.48	
COMMScope INC	350,000.00	251,125.00	
COMPASS GROUP DIVERSIFIE	250,000.00	237,880.92	
COMPASS GROUP DIVERSIFIE	100,000.00	89,555.18	
COMPASS MINERALS INTERNA	175,000.00	168,859.35	
COMSTOCK RESOURCES INC	700,000.00	634,691.75	
CONNECT FINCO SARL/CONNE	400,000.00	392,459.96	
CONSENSUS CLOUD SOLUTION	200,000.00	191,112.00	
CONSENSUS CLOUD SOLUTION	225,000.00	199,305.00	
CONSOLIDATED ENERGY FIN	300,000.00	250,960.38	
CONSTELLUM SE	250,000.00	224,680.57	
COTY/HFC PRESTIGE/INT US	400,000.00	405,901.20	
COVANTA HOLDING CORP	200,000.00	176,452.10	
CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN	500,000.00	473,275.60	
CREDIT ACCEPTANC	125,000.00	134,681.50	

CRESCENT ENERGY FINANCE	50,000.00	50,475.76
CRESTWOOD MID PARTNER LP	350,000.00	353,018.40
CRESTWOOD MID PARTNER LP	400,000.00	419,187.20
CROCS INC	425,000.00	388,417.65
CROWN AMERICAS LLC	275,000.00	266,086.53
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	200,000.00	199,702.70
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	150,000.00	148,295.98
CSC HOLDINGS LLC	400,000.00	356,860.16
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	198,424.28
CSC HOLDINGS LLC	400,000.00	400,816.52
CSC HOLDINGS LLC	350,000.00	300,017.97
CSC HOLDINGS LLC	500,000.00	265,954.25
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	142,350.06
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	101,740.08
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	101,068.86
CSC HOLDINGS LLC	600,000.00	426,144.12
CTR PARTNERSHIP/CARETRST	225,000.00	208,782.72
CUSHMAN & WAKEFIELD US	150,000.00	148,209.03
CUSHMAN & WAKEFIELD US	75,000.00	79,275.37
DANA INC	200,000.00	176,495.92
DARLING INGREDIENTS INC	600,000.00	595,024.80
DAVITA INC	600,000.00	536,582.04
DAVITA INC	370,000.00	310,228.42
DELEK LOG PART/FINANCE	175,000.00	171,043.14
DELEK LOG PART/FINANCE	275,000.00	282,339.97
DELTA AIR LINES INC	225,000.00	220,947.95
DELTA AIR LINES INC	100,000.00	103,262.80
DELTA AIR LINES INC	625,000.00	604,637.31
DIAMOND FRGN/DIAMOND FIN	50,000.00	52,784.30
DIRECTV FINANCING LLC	150,000.00	149,769.54
DIRECTV HOLDINGS/FING	925,000.00	875,635.43
DISH DBS CORP	450,000.00	355,601.65
DISH DBS CORP	350,000.00	241,227.35
DISH NETWORK CORP	375,000.00	384,666.82
DIVERSIFIED HEALTHCARE T	224,000.00	224,584.39
DOLYA HOLDCO 18 DAC	200,000.00	183,258.32
DREAM FINDERS HOMES INC	125,000.00	130,769.10
DT MIDSTREAM INC	250,000.00	225,690.85
EDGEWELL PERSONAL CARE	300,000.00	293,009.55
EDGEWELL PERSONAL CARE	250,000.00	229,404.85
EMERALD DEBT MERGER	675,000.00	681,570.18
ENCORE CAPITAL GROUP INC	200,000.00	206,240.62
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	700,000.00	705,689.81

ENERFLEX LTD	330,000.00	338,397.84	
ENLINK MIDSTREAM LLC	75,000.00	74,290.21	
ENLINK MIDSTREAM LLC	200,000.00	196,116.00	
ENLINK MIDSTREAM LLC	100,000.00	102,748.60	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	400,000.00	392,343.12	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	475,000.00	420,824.16	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	400,000.00	344,811.72	
ENTEGRIS ESCROW CORP	275,000.00	272,009.48	
ENTEGRIS INC	175,000.00	164,946.25	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	200,000.00	200,319.40	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	125,000.00	128,733.87	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	450,000.00	454,914.90	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	175,000.00	164,076.65	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	150,000.00	151,136.26	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	125,000.00	133,562.50	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	875,000.00	813,796.63	
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	50,000.00	50,176.50	
ESAB CORP	100,000.00	100,598.16	
EVERI HOLDINGS INC	400,000.00	396,108.20	
FAIR ISAAC CORP	150,000.00	140,174.11	
FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	350,000.00	343,455.21	
FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	525,000.00	502,591.47	
FERTITTA ENTERTAINMENT	325,000.00	298,134.49	
FIRSTCASH INC	275,000.00	274,818.03	
FMG RESOURCES AUG 2006	400,000.00	396,006.84	
FORD MOTOR COMPANY	150,000.00	175,986.55	
FORD MOTOR COMPANY	725,000.00	735,082.43	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000.00	396,832.16	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000.00	385,315.36	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	204,139.42	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	204,532.06	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	600,000.00	583,329.78	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	186,749.14	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	187,774.56	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	210,064.28	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000.00	415,928.32	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	900,000.00	872,363.43	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	213,329.74	
FORESTAR GROUP INC	200,000.00	192,138.22	
FORESTAR GROUP INC	125,000.00	120,217.06	
FORTRESS TRANS & INFRAST	416,000.00	415,645.48	
FORTRESS TRANS & INFRAST	450,000.00	436,052.47	

FORTRESS TRANS & INFRAST	50,000.00	52,589.55
FOXTROT ESCROW ISSUER	172,000.00	172,645.00
FREEDOM MORTGAGE	275,000.00	267,151.72
FREEDOM MORTGAGE CORP	450,000.00	449,944.29
FREEDOM MORTGAGE CORP	300,000.00	327,561.99
FREEDOM MORTGAGE CORP	300,000.00	328,893.00
FREEDOM MORTGAGE HOLD	100,000.00	102,343.10
FRONT RANGE BIDCO INC	375,000.00	309,007.20
FRONTIER COMMUNICATIONS	475,000.00	459,198.84
FRONTIER COMMUNICATIONS	400,000.00	370,998.08
FRONTIER COMMUNICATIONS	275,000.00	281,165.22
FRONTIER COMMUNICATIONS	200,000.00	203,792.44
GAP INC/THE	175,000.00	153,685.98
GAP INC/THE	400,000.00	338,954.35
GARDA WORLD SECURITY	675,000.00	646,095.21
GARDA WORLD SECURITY	125,000.00	127,602.00
GCI LLC	250,000.00	229,855.32
GENESIS ENERGY LP/FIN	987,000.00	998,265.71
GENESIS ENERGY LP/FIN	325,000.00	326,090.37
GENESIS ENERGY LP/FIN	150,000.00	157,083.45
GENWORTH MORTGAGE HLDING	200,000.00	200,048.00
GFL ENVIRONMENTAL INC	350,000.00	322,172.37
GFL ENVIRONMENTAL INC	300,000.00	282,115.38
GFL ENVIRONMENTAL INC	175,000.00	179,422.63
GGAM FINANCE LTD	75,000.00	75,000.00
GLOBAL AIR LEASE CO LTD	1,033,106.00	978,445.49
GLOBAL AUTO HO/AAG FH UK	200,000.00	195,463.04
GLOBAL AUTO HO/AAG FH UK	200,000.00	193,622.06
GO DADDY OPCO/FINCO	425,000.00	416,088.94
GO DADDY OPCO/FINCO	250,000.00	225,300.20
GOEASY LTD	275,000.00	275,619.30
GOODYEAR TIRE & RUBBER	500,000.00	504,903.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER	575,000.00	556,153.39
GOODYEAR TIRE & RUBBER	550,000.00	514,522.63
GOODYEAR TIRE & RUBBER	175,000.00	159,724.25
GRAFTECH GLOBAL ENTERPRI	275,000.00	203,957.62
GRAHAM HOLDINGS CO	200,000.00	198,900.22
GRAY ESCROW II INC	200,000.00	131,433.92
GRAY ESCROW INC	575,000.00	534,667.20
GRAY TELEVISION INC	250,000.00	164,546.00
GREYSTAR REAL ESTATE PAR	275,000.00	288,224.75
GRIFFON CORPORATION	375,000.00	367,394.28
GTCR W-2 MERGER SUB LLC	600,000.00	628,502.40

HANESBRANDS INC	150,000.00	154,161.28	
HARVEST MIDSTREAM I LP	400,000.00	405,044.40	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT	225,000.00	224,193.98	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT	300,000.00	282,531.18	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT	275,000.00	286,897.60	
HAWAIIAN BRAND INTELLECT	200,000.00	188,138.84	
HCA INC	500,000.00	498,843.60	
HCA INC	450,000.00	452,371.14	
HEALTHEQUITY INC	450,000.00	416,425.99	
HELIX ENERGY SOLUTIONS	325,000.00	347,138.35	
HESS MIDSTREAM OPERATION	225,000.00	206,920.48	
HESS MIDSTREAM OPERATION	100,000.00	96,927.28	
HESS MIDSTREAM PARTNERS	275,000.00	266,227.72	
HF SINCLAIR	150,000.00	151,047.72	
HF SINCLAIR	175,000.00	169,990.46	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	200,000.00	194,884.42	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	150,000.00	146,919.63	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	600,000.00	585,023.82	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	150,000.00	147,971.22	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	450,000.00	487,957.18	
HILLENBRAND INC	225,000.00	195,177.73	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	150,000.00	150,240.82	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	150,000.00	149,847.54	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	100,000.00	91,795.96	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	350,000.00	335,253.55	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	375,000.00	336,246.11	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	375,000.00	323,630.10	
HILTON GRAND VAC BOR ESC	475,000.00	443,335.50	
HILTON GRAND VAC BOR ESC	325,000.00	291,323.82	
HOWARD HUGHES CORP	200,000.00	191,635.28	
HOWARD HUGHES CORP	150,000.00	135,004.72	
HOWARD HUGHES CORP	150,000.00	130,489.53	
HOWARD MIDSTREAM ENERGY	620,000.00	618,682.24	
HOWARD MIDSTREAM ENERGY	275,000.00	291,472.66	
HUB INTERNATIONAL LTD	450,000.00	462,602.25	
HUDBAY MINERALS INC	125,000.00	121,289.71	
HUDBAY MINERALS INC	150,000.00	148,425.51	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	225,000.00	132,209.48	
HUSKY INJECTION / TITAN	125,000.00	129,778.51	
IAMGOLD CORP	275,000.00	253,084.20	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	450,000.00	448,129.35	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	375,000.00	367,087.68	

ICAHN ENTERPRISES/FIN	400,000.00	371,184.92
ICAHN ENTERPRISES/FIN	175,000.00	182,824.09
ICAHN ENTERPRISES/FIN	175,000.00	149,157.40
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	525,000.00	445,410.21
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	175,000.00	126,323.31
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	225,000.00	157,197.73
II-VI INC	375,000.00	352,891.38
ILFC E-CAPITAL TRUST I	300,000.00	235,158.15
ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	197,962.52
ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	198,129.64
IMOLA MERGER CORP	825,000.00	776,292.00
INDIGO MERGER SUB INC	200,000.00	186,091.00
INTESA SANPAOLO SPA	200,000.00	149,285.40
IQVIA INC	350,000.00	341,814.90
IRON MOUNTAIN INC	575,000.00	557,105.88
IRON MOUNTAIN INC	125,000.00	119,512.23
IRON MOUNTAIN INC	225,000.00	229,185.22
IRON MOUNTAIN INC	475,000.00	446,008.28
IRON MOUNTAIN INC	900,000.00	851,805.00
IRON MOUNTAIN INC	350,000.00	314,653.29
IRON MOUNTAIN INC	150,000.00	141,637.30
IRON MOUNTAIN INFO MGMT	175,000.00	159,912.32
ITT HOLDINGS LLC	225,000.00	205,140.75
J2 GLOBAL	348,000.00	315,543.60
JACOBS ENTERTAINMENT INC	175,000.00	169,147.12
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	200,000.00	197,065.84
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	600,000.00	579,312.18
JANE STREET GRP/JSG FIN	200,000.00	185,566.08
JB POINDEXTER & CO INC	300,000.00	309,911.40
JEFFERSON CAPITAL HOLDIN	325,000.00	317,223.43
JEFFERSON CAPITAL HOLDIN	275,000.00	281,705.02
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	148,130.49
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	150,126.90
KAISER ALUMINUM CORP	175,000.00	164,184.45
KB HOME	150,000.00	154,889.25
KB HOME	100,000.00	103,508.40
KB HOME	175,000.00	154,904.62
KEHE DIST/FIN / NEXTWAVE	275,000.00	279,278.42
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	300,000.00	291,822.96
KINETIK HOLDINGS LP	225,000.00	220,728.78
KNIFE RIVER HOLD CO	125,000.00	131,035.37
KODIAK GAS SERVICES LLC	125,000.00	127,342.12
L BRANDS INC	44,000.00	45,992.71

L BRANDS INC	200,000.00	196,137.12	
L BRANDS INC	250,000.00	260,835.00	
L BRANDS INC	425,000.00	433,981.10	
L BRANDS INC	525,000.00	529,302.37	
LABL INC	200,000.00	197,204.34	
LABL INC	175,000.00	177,327.34	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	650,000.00	608,316.15	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	100,000.00	91,072.99	
LAMAR MEDIA CORP	225,000.00	210,844.95	
LAMAR MEDIA CORP	100,000.00	96,608.93	
LAMAR MEDIA CORP	225,000.00	204,711.54	
LAMAR MEDIA CORP	100,000.00	88,065.30	
LAMB WESTON HLD	150,000.00	136,895.98	
LAMB WESTON HLD	150,000.00	134,968.02	
LAREDO PETROLEUM INC	350,000.00	353,161.55	
LCM INVESTMENTS HOLDINGS	275,000.00	253,080.35	
LCM INVESTMENTS HOLDINGS	200,000.00	209,130.80	
LEEWARD RENEWABL	300,000.00	257,347.47	
LEVEL 3 FINANCING INC	375,000.00	185,625.00	
LEVEL 3 FINANCING INC	550,000.00	250,250.00	
LEVEL 3 FING INC	178,000.00	186,010.00	
LGI HOMES INC	225,000.00	237,662.55	
LIFE TIME INC	800,000.00	794,798.16	
LIFEPOINT HEALTH INC	100,000.00	95,437.93	
LIFEPOINT HEALTH INC	275,000.00	288,129.82	
LIFEPOINT HEALTH INC	125,000.00	133,658.87	
LIGHT & WONDER INTER	100,000.00	104,129.62	
LINDBLAD EXPEDITIONS LLC	300,000.00	302,167.80	
LITHIA MOTORS INC	425,000.00	382,977.78	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	100,000.00	99,353.19	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	200,000.00	197,954.72	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	615,000.00	586,482.32	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	100,000.00	92,649.45	
LSF9 ATL HLDG/VICTRA FIN	500,000.00	496,106.30	
MACQUARIE AIRFINANCE HLD	125,000.00	132,747.00	
MACQUARIE AIRFINANCE HLD	75,000.00	76,327.12	
MACQUARIE AIRFINANCE HLD	100,000.00	105,858.30	
MACQUARIE AIRFINANCE HLD	100,000.00	101,954.50	
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	250,000.00	245,162.50	
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	50,000.00	48,550.16	
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	75,000.00	73,070.31	
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	275,000.00	239,197.91	

MAGIC MERGERCO INC	200,000.00	169,632.70
MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN	200,000.00	196,614.74
MASONITE INTERNATIONAL C	250,000.00	250,610.00
MASONITE INTERNATIONAL C	175,000.00	154,909.37
MATADOR RESOURCES CO	250,000.00	250,298.00
MATADOR RESOURCES CO	375,000.00	384,183.45
MATADOR RESOURCES CO	50,000.00	50,000.00
MATCH GROUP HLD II LLC	400,000.00	339,833.80
MATCH GROUP INC	425,000.00	407,777.98
MATCH GROUP INC	100,000.00	94,291.48
MATTAMY GROUP CORP	250,000.00	227,030.62
MATTEL INC	125,000.00	119,682.40
MATTEL INC	100,000.00	100,482.40
MATTEL INC	125,000.00	115,188.66
MATTEL INC	200,000.00	185,297.44
MATTHEWS INTERNATIONAL C	425,000.00	417,837.34
MAUSER PACKAGING SOLUT	275,000.00	279,870.25
MEDLINE BORROWER/MEDL CO	100,000.00	100,508.60
MEG ENERGY CORP	550,000.00	539,996.54
MERCER INTL INC	475,000.00	416,542.27
MERITAGE HOMES CORP	203,000.00	202,896.32
MERLIN ENTERTAINMENTS GR	200,000.00	201,555.32
METHANEX CORP	450,000.00	435,610.80
MGIC INVESTMENT CORP	425,000.00	412,743.85
MGM RESORTS INTL	250,000.00	250,159.07
MGM RESORTS INTL	394,000.00	393,707.17
MGM RESORTS INTL	211,000.00	208,426.66
MGM RESORTS INTL	300,000.00	285,480.21
MGM RESORTS INTL	225,000.00	224,732.90
MIDCAP FINANCIAL	200,000.00	171,871.56
MIDWEST GAMING BORROWER	200,000.00	185,396.56
MILLENNIUM ESCROW CORP	100,000.00	58,901.25
MINERAL RESOURCES LTD	325,000.00	343,041.72
MINERAL RESOURCES LTD	450,000.00	465,182.50
MITER BRAND / MIWD BORR	200,000.00	201,362.58
MIWD HLDCO II/MIWD FIN	350,000.00	322,426.96
MOHEGAN GAMING & ENT	375,000.00	366,466.87
MOLINA HEALTHCARE INC	150,000.00	141,551.55
MOLINA HEALTHCARE INC	175,000.00	155,673.73
MOLINA HEALTHCARE INC	225,000.00	196,472.43
MOSS CREEK RESOURCES HLD	425,000.00	425,273.53
MOTION BONDCO DAC	400,000.00	387,048.44
MOZART DEBT MERGER SUB	1,350,000.00	1,230,792.84

MPH ACQUISITION HOLDINGS	200,000.00	170,281.94	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	200,000.00	157,322.74	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	425,000.00	355,937.50	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	625,000.00	480,004.93	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	475,000.00	326,388.31	
MSCI INC	75,000.00	69,115.38	
MSCI INC	250,000.00	222,270.70	
MSCI INC	175,000.00	151,867.34	
MURPHY OIL CORP	650,000.00	645,439.47	
MURPHY OIL CORP	225,000.00	226,525.72	
MURPHY OIL USA INC	300,000.00	283,731.39	
NABORS INDUSTRIES INC	225,000.00	224,746.51	
NABORS INDUSTRIES INC	125,000.00	129,872.25	
NATIONSTAR MTG HLD INC	100,000.00	98,661.27	
NATIONSTAR MTG HLD INC	200,000.00	191,621.24	
NATIONSTAR MTG HLD INC	100,000.00	90,720.54	
NATIONSTAR MTG HLD INC	75,000.00	69,278.00	
NATIONSTAR MTG HLD INC	125,000.00	124,420.40	
NAVIENT CORP	300,000.00	299,656.71	
NAVIENT CORP	425,000.00	428,817.35	
NAVIENT CORP	200,000.00	201,634.00	
NAVIENT CORP	100,000.00	95,796.31	
NAVIENT CORP	275,000.00	256,281.43	
NAVIENT CORP	275,000.00	294,654.36	
NAVIENT CORP	200,000.00	222,425.20	
NCL CORPORATION LTD	650,000.00	642,401.37	
NCL CORPORATION LTD	250,000.00	264,301.00	
NCR ATLEOS ESCROW CORP	450,000.00	480,922.20	
NCR CORP	200,000.00	186,556.96	
NCR CORP	500,000.00	464,530.25	
NCR CORP	525,000.00	475,574.03	
NEPTUNE BIDCO US INC	725,000.00	686,100.19	
NESCO HOLDINGS II INC	475,000.00	449,241.79	
NEW ENTERPRISE STONE & L	450,000.00	432,128.02	
NEW FORTRESS ENERGY INC	65,000.00	64,616.23	
NEW FORTRESS ENERGY INC	325,000.00	313,244.29	
NEW FORTRESS ENERGY INC	75,000.00	75,158.37	
NEWELL BRANDS INC	100,000.00	98,697.44	
NEWELL BRANDS INC	100,000.00	97,862.62	
NEWELL RUBBERMAID INC	750,000.00	736,139.85	
NEWELL RUBBERMAID INC	225,000.00	180,220.27	
NEWMARK GROUP INC	400,000.00	410,841.60	

NEWS CORP	500,000.00	457,328.65
NEWS CORP	425,000.00	399,155.79
NEXSTAR ESCROW INC	200,000.00	192,237.64
NEXTERA ENERGY OPERATING	250,000.00	247,908.42
NEXTERA ENERGY OPERATING	139,000.00	130,374.27
NEXTERA ENERGY OPERATING	325,000.00	304,584.34
NFP CORP	100,000.00	110,227.40
NGL ENERGY PARTNERS LP	200,000.00	204,990.66
NGL ENERGY PARTNERS LP	250,000.00	256,410.50
NMI HOLDINGS	300,000.00	303,165.90
NOBLE FINANCE II LLC	150,000.00	156,386.70
NORTHERN OIL AND GAS INC	275,000.00	280,446.65
NORTHERN OIL AND GAS INC	150,000.00	158,638.95
NORTONLIFELOCK INC	350,000.00	354,660.60
NORTONLIFELOCK INC	225,000.00	231,262.83
NOVA CHEMICALS CORP	675,000.00	637,443.20
NOVA CHEMICALS CORP	225,000.00	239,663.70
NOVA CHEMICALS CORP	125,000.00	106,969.48
NOVA CHEMICALS CORP	325,000.00	335,524.24
NOVELIS CORP	100,000.00	93,190.06
NOVELIS CORP	575,000.00	531,741.31
NOVELIS CORP	100,000.00	85,856.06
NRG ENERGY INC	175,000.00	187,756.27
NRG ENERGY INC	152,000.00	152,370.42
NRG ENERGY INC	150,000.00	133,237.09
NRG ENERGY INC	375,000.00	359,604.60
NRG ENERGY INC	525,000.00	449,975.34
NRG ENERGY INC	275,000.00	293,674.42
NUSTAR LOGISTICS LP	150,000.00	149,803.75
NUSTAR LOGISTICS LP	150,000.00	149,397.30
NUSTAR LOGISTICS LP	250,000.00	251,655.00
OCEANEERING INTL INC	125,000.00	122,185.71
OLIN CORP	225,000.00	222,714.83
OLIN CORP	300,000.00	284,621.34
OLYMPUS WTR US HLDG CORP	800,000.00	725,960.32
OLYMPUS WTR US HLDG CORP	1,000,000.00	1,067,805.50
ON SEMICONDUCTOR CORP	225,000.00	207,062.64
ONEMAIN FINANCE CORP	300,000.00	318,108.60
ONEMAIN FINANCE CORP	475,000.00	490,250.35
ONTARIO GAMING GTA LP	300,000.00	309,236.49
OPEN TEXT CORP	500,000.00	463,611.00
OPEN TEXT HOLDINGS INC	250,000.00	223,890.82
OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	275,000.00	245,021.92

OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	625,000.00	549,028.12	
ORGANON FINANCE 1 LLC	800,000.00	743,939.20	
ORGANON FINANCE 1 LLC	200,000.00	176,252.40	
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	825,000.00	795,069.24	
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	100,000.00	90,476.02	
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	275,000.00	246,961.46	
OWENS & MINOR INC	200,000.00	183,294.42	
OWENS & MINOR INC	150,000.00	148,896.12	
OWENS-BROCKWAY	400,000.00	402,481.20	
OWENS-BROCKWAY	94,000.00	94,005.40	
OWENS-BROCKWAY	175,000.00	177,884.35	
PANTHER ESCROW ISSUER	300,000.00	304,239.00	
PARK INTERMED HOLDINGS	225,000.00	225,646.87	
PARK INTERMED HOLDINGS	275,000.00	269,959.25	
PARK INTERMED HOLDINGS	175,000.00	162,958.25	
PARK-OHIO INDUSTRIES INC	375,000.00	351,273.86	
PARKLAND CORP/CANADA	359,000.00	332,200.36	
PARKLAND CORP/CANADA	350,000.00	323,304.13	
PARKLAND FUEL CORP	200,000.00	198,281.08	
PATRICK INDUSTRIES INC	200,000.00	187,287.20	
PAYSAFE FIN PLC/PAYSAFE	225,000.00	200,527.29	
PBF HOLDING CO LLC	700,000.00	689,447.08	
PBF HOLDING CO LLC	200,000.00	207,856.20	
PENNYMAC FIN SVCS INC	575,000.00	524,827.68	
PENNYMAC FIN SVCS INC	125,000.00	128,448.62	
PENNYMAC FIN SVCS INC	100,000.00	92,833.99	
PERFORMANCE FOOD GROUP I	975,000.00	958,192.85	
PERFORMANCE FOOD GROUP I	225,000.00	206,050.68	
PERMIAN RESOURC OPTG LLC	200,000.00	197,942.44	
PERMIAN RESOURC OPTG LLC	250,000.00	259,293.50	
PETSMART INC/PETSMART FI	250,000.00	233,984.77	
PG&E CORP	275,000.00	265,069.61	
PG&E CORP	275,000.00	262,253.69	
PGT INNOVATIONS INC	425,000.00	431,828.90	
PHINIA INC	50,000.00	50,000.00	
PICARD MIDCO INC	1,425,000.00	1,351,754.26	
PICASSO FINANCE SUB INC	121,000.00	120,605.22	
PLAYTIKA HOLDING CORP	275,000.00	238,195.81	
PM GENERAL PURCHASER LLC	300,000.00	306,556.20	
POLYONE CORP	200,000.00	199,126.84	
POST HOLDINGS INC	375,000.00	368,870.51	
POST HOLDINGS INC	150,000.00	144,859.18	

POST HOLDINGS INC	625,000.00	574,481.06
POST HOLDINGS INC	150,000.00	134,660.01
POST HOLDINGS INC	125,000.00	125,945.75
PRAIRIE ACQUIROR LP	175,000.00	180,582.30
PRECISION DRILLING CORP	250,000.00	249,379.92
PRESIDIO HOLDING INC	200,000.00	194,704.64
PRESTIGE BRANDS INC	325,000.00	316,806.19
PRESTIGE BRANDS INC	150,000.00	130,726.41
PRIME HEALTHCARE SERVICE	200,000.00	199,298.00
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	19,000.00	18,983.74
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	100,000.00	99,657.27
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	325,000.00	298,778.74
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	1,275,000.00	1,251,721.68
PRIME SECURITY ONE MS IN	675,000.00	612,285.21
PRIMO WATER HOLDINGS INC	475,000.00	437,139.27
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN	125,000.00	112,616.63
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN	375,000.00	326,295.00
QUINTILES IMS INC	250,000.00	244,597.70
QVC INC	125,000.00	121,326.53
QVC INC	175,000.00	140,033.77
RADIAN GROUP INC	225,000.00	223,236.36
RADIAN GROUP INC	250,000.00	244,304.55
RAIN CARBON INC	350,000.00	362,654.95
RAISING CANE'S RESTAURAN	125,000.00	135,178.50
RAKUTEN GROUP INC	200,000.00	212,196.88
RANGE RESOURCES CORP	425,000.00	441,926.90
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	375,000.00	266,679.90
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	16,000.00	10,915.94
RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	275,000.00	276,406.73
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	50,000.00	51,060.85
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	425,000.00	446,654.60
RLJ LODGING TRUST LP	175,000.00	166,674.09
RLJ LODGING TRUST LP	225,000.00	198,920.22
ROCKCLIFF ENERGY II LLC	175,000.00	163,929.78
ROCKETMTGE CO-ISSUER INC	125,000.00	115,642.55
ROCKIES EXPRESS PIPELINE	500,000.00	466,519.05
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	800,000.00	787,879.04
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	375,000.00	394,769.62
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	725,000.00	716,485.81
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	150,000.00	151,317.64
SBA COMMUNICATIONS CORP	800,000.00	758,649.76
SBA COMMUNICATIONS CORP	175,000.00	155,370.68
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	300,000.00	302,493.00

SCIH SALT HOLDINGS INC	400,000.00	373,371.48	
SCIL IV LLC / SCIL USA H	200,000.00	194,740.46	
SCOTTS MIRACLE-GRO CO	275,000.00	236,742.19	
SEADRILL FINANCE LTD	200,000.00	209,571.00	
SEAGATE HDD CAYMAN	100,000.00	88,136.81	
SEAGATE HDD CAYMAN	346,500.00	395,332.52	
SEALED AIR CORP	375,000.00	373,819.35	
SEALED AIR CORP	225,000.00	211,024.21	
SEALED AIR CORP	50,000.00	50,092.95	
SEALED AIR CORP	50,000.00	48,054.37	
SEALED AIR CORP	300,000.00	312,015.30	
SEALED AIR/SEALED AIR US	100,000.00	104,052.60	
SEASPAN CORP	375,000.00	328,887.48	
SEAWORLD PARKS & ENTERTA	575,000.00	540,137.80	
SELECT MEDICAL CORP	325,000.00	325,860.60	
SENSATA TECH INC	400,000.00	362,661.92	
SENSATA TECHNOLOGIES INC	150,000.00	129,714.97	
SERVICE CORP INTL	300,000.00	292,504.68	
SERVICE CORP INTL	275,000.00	238,152.00	
SERVICE CORP INTL	200,000.00	177,223.48	
SERVICE PROPERTIES TRUST	200,000.00	202,597.40	
SERVICE PROPERTIES TRUST	175,000.00	169,515.57	
SERVICE PROPERTIES TRUST	175,000.00	163,037.38	
SERVICE PROPERTIES TRUST	100,000.00	95,247.59	
SERVICE PROPERTIES TRUST	925,000.00	758,722.18	
SERVICE PROPERTIES TRUST	150,000.00	114,520.50	
SERVICE PROPERTIES TRUST	75,000.00	79,850.32	
SHEA HOMES LP/FNDG CP	150,000.00	142,638.16	
SHEA HOMES LP/FNDG CP	150,000.00	141,208.78	
SHELF DRILL HOLD LTD	625,000.00	604,832.37	
SIMMONS FOOD INC/SIMMONS	200,000.00	176,201.14	
SINCLAIR TELEVISION GROU	375,000.00	344,673.75	
SINCLAIR TELEVISION GROU	125,000.00	90,823.12	
SINCLAIR TELEVISION GROU	275,000.00	200,213.75	
SIRIUS XM RADIO INC	350,000.00	327,499.93	
SIRIUS XM RADIO INC	800,000.00	769,508.00	
SIRIUS XM RADIO INC	275,000.00	251,288.64	
SIRIUS XM RADIO INC	775,000.00	738,504.70	
SIRIUS XM RADIO INC	450,000.00	375,768.27	
SIZZLING PLATT/FIN CO	375,000.00	379,805.25	
SLM CORP	200,000.00	195,219.86	
SLM CORP	90,000.00	74,757.74	

SM ENERGY CO	450,000.00	450,219.06
SOLARIS MIDSTREAM HOLDIN	200,000.00	202,217.60
SONIC AUTOMOTIVE INC	125,000.00	111,718.56
SONIC AUTOMOTIVE INC	250,000.00	218,442.02
SOUTHWESTERN ENERGY	375,000.00	364,412.47
SOUTHWESTERN ENERGY CO	37,000.00	36,839.19
SOUTHWESTERN ENERGY CO	100,000.00	103,756.20
SOUTHWESTERN ENERGY CO	450,000.00	433,391.40
SOUTHWESTERN ENERGY CO	350,000.00	321,971.26
SPECIALTY BUILDING PRODU	500,000.00	497,129.50
SPECTRUM BRANDS INC	75,000.00	73,568.25
SPECTRUM BRANDS INC	225,000.00	220,357.86
SPECTRUM BRANDS INC	175,000.00	169,031.69
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	300,000.00	327,092.10
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	200,000.00	223,740.00
SPRINGLEAF FINANCE CORP	775,000.00	783,532.67
SPRINGLEAF FINANCE CORP	825,000.00	841,067.70
SPRINGLEAF FINANCE CORP	200,000.00	200,752.20
SPRINGLEAF FINANCE CORP	25,000.00	23,489.00
SPRINT CORP	550,000.00	551,168.64
SPRINT CORP	875,000.00	886,578.61
SPRINT CORP	125,000.00	129,202.50
SRM ESCROW ISSUER LLC	825,000.00	807,379.72
SRS DISTRIBUTION INC	150,000.00	140,266.27
SS&C TECHNOLOGIES INC	625,000.00	612,822.12
STANDARD INDUSTRIES INC	125,000.00	121,521.93
STANDARD INDUSTRIES INC	775,000.00	740,160.10
STANDARD INDUSTRIES INC	425,000.00	381,861.26
STANDARD INDUSTRIES INC	275,000.00	231,018.92
STAPLES INC	650,000.00	634,397.40
STAPLES INC	375,000.00	356,091.78
STARWOOD PROPERTY TRUST	225,000.00	229,423.81
STENA INTERNATIONAL SA	200,000.00	199,698.90
STENA INTERNATIONAL SA	200,000.00	202,516.20
STL HOLDING CO LLC	150,000.00	153,666.15
STUDIO CITY FINANCE LTD	400,000.00	353,061.84
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	275,000.00	250,789.33
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	37,000.00	36,972.70
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	200,000.00	194,999.66
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	125,000.00	129,956.16
SUNNOVA ENERGY CORP	200,000.00	156,073.84
SUNOCO LP/FINANCE CORP	150,000.00	153,304.65
SUNOCO LP/FINANCE CORP	296,000.00	275,111.25

SUNOCO LP/FINANCE CORP	525,000.00	480,646.00	
SUPERIOR PLUS/GEN PRTNR	200,000.00	185,152.28	
SYNAPTICS INC	500,000.00	449,870.15	
SYNCHRONY FINANCIAL	150,000.00	149,071.90	
T-MOBILE USA INC	175,000.00	172,753.94	
T-MOBILE USA INC	400,000.00	369,605.84	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	175,000.00	187,552.52	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	150,000.00	147,683.28	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	200,000.00	201,118.10	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	275,000.00	261,053.62	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	175,000.00	163,347.22	
TALOS PRODUCTION INC	150,000.00	159,293.85	
TALOS PRODUCTION INC	150,000.00	159,986.73	
TASEKO MINES LTD	176,000.00	176,709.70	
TAYLOR MORRISON COMM	150,000.00	148,585.06	
TAYLOR MORRISON COMM	100,000.00	95,437.57	
TEGNA INC	125,000.00	114,642.13	
TEGNA INC	200,000.00	180,054.38	
TEINE ENERGY LTD	275,000.00	268,034.99	
TELECOM ITALIA CAPITAL	725,000.00	706,906.61	
TELESAT CANADA/TELESAT L	25,000.00	14,978.00	
TELESAT CANADA/TELESAT L	150,000.00	84,135.00	
TELESAT CANADA/TELESAT L	275,000.00	118,250.00	
TEMPUR SEALY INTL INC	150,000.00	136,057.98	
TEMPUR SEALY INTL INC	100,000.00	84,591.75	
TENET HEALTHCARE CORP	825,000.00	824,663.31	
TENET HEALTHCARE CORP	1,075,000.00	1,050,324.77	
TENET HEALTHCARE CORP	150,000.00	142,884.18	
TENET HEALTHCARE CORP	800,000.00	797,889.36	
TENET HEALTHCARE CORP	275,000.00	255,618.57	
TENET HEALTHCARE CORP	800,000.00	798,914.96	
TENET HEALTHCARE CORP	500,000.00	510,405.00	
TENNECO INC	175,000.00	159,504.13	
TERRAFORM POWER OPERATIN	175,000.00	166,845.35	
TERRAFORM POWER OPERATIN	350,000.00	320,892.67	
THOR INDUSTRIES	425,000.00	379,482.07	
TOPBUILD CORP	175,000.00	155,028.54	
TRANSALTA CORP	200,000.00	208,076.80	
TRANSDIGM INC	850,000.00	850,000.00	
TRANSDIGM INC	550,000.00	550,624.25	
TRANSDIGM INC	1,200,000.00	1,175,310.24	
TRANSDIGM INC	350,000.00	355,911.43	

TRANSDIGM INC	425,000.00	395,657.91
TRANSDIGM INC	325,000.00	326,744.49
TRANSDIGM INC	1,050,000.00	979,322.82
TRANSDIGM INC	175,000.00	180,793.07
TRANSDIGM INC	175,000.00	176,791.02
TRANSOCEAN AQUILA LTD	125,000.00	128,291.12
TRANSOCEAN INC	675,000.00	703,379.02
TRANSOCEAN POSEIDON	84,375.00	84,433.30
TRANSOCEAN TITAN FIN LTD	75,000.00	78,173.77
TRAVEL + LEISURE CO	200,000.00	183,841.48
TRI POINTE GROUP INC	200,000.00	195,534.94
TRI POINTE GROUP INC	125,000.00	123,096.97
TRI POINTE HOLDINGS INC	100,000.00	99,868.12
TRIMAS CORP	250,000.00	227,099.85
TRINITY INDUSTRIES INC	325,000.00	332,884.43
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	150,000.00	48,918.00
TRONOX INC	450,000.00	406,682.59
TTM TECHNOLOGIES INC	225,000.00	204,284.25
UBER TECHNOLOGIES INC	400,000.00	409,794.48
UBER TECHNOLOGIES INC	300,000.00	301,235.85
UBER TECHNOLOGIES INC	1,075,000.00	1,022,749.73
UKG INC	450,000.00	459,223.33
UNITED AIRLINES INC	500,000.00	483,096.70
UNITED AIRLINES INC	550,000.00	510,918.59
UNITED RENTALS NORTH AM	88,000.00	87,762.46
UNITED RENTALS NORTH AM	550,000.00	501,608.80
UNITED RENTALS NORTH AM	375,000.00	336,686.58
UNITED RENTALS NORTH AM	125,000.00	109,139.18
UNITED WHOLESALE MTGE LL	100,000.00	97,323.01
UNITED WHOLESALE MTGE LL	300,000.00	283,784.43
UNITI GROUP/CSL CAPITAL	600,000.00	620,963.10
UNIVISION COMMUNICATIONS	300,000.00	293,865.21
UNIVISION COMMUNICATIONS	450,000.00	458,847.90
UNIVISION COMMUNICATIONS	475,000.00	424,774.49
UNIVISION COMMUNICATIONS	550,000.00	544,087.11
UPC BROADBAND FINCO BV	400,000.00	357,636.00
US FOODS INC	125,000.00	128,084.25
US FOODS INC	575,000.00	546,799.70
US FOODS INC	125,000.00	130,257.82
USA COM PART/USA COM FIN	200,000.00	199,819.42
USA COM PART/USA COM FIN	200,000.00	200,767.10
USA COM PART/USA COM FIN	250,000.00	254,221.75
VALARIS LTD	300,000.00	309,004.80

VENTURE GLOBAL CALCASIEU	275,000.00	246,981.62	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	325,000.00	327,107.20	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	200,000.00	178,269.60	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	250,000.00	212,003.07	
VENTURE GLOBAL LNG INC	575,000.00	588,171.06	
VENTURE GLOBAL LNG INC	675,000.00	728,781.84	
VENTURE GLOBAL LNG INC	650,000.00	670,472.72	
VENTURE GLOBAL LNG INC	600,000.00	646,269.23	
VERICAST MERGER SUB INC	530,250.00	564,716.25	
VERMILION ENERGY INC	225,000.00	219,316.74	
VIASAT INC	150,000.00	141,833.59	
VICI PROPERTIES / NOTE	100,000.00	97,875.39	
VICI PROPERTIES / NOTE	150,000.00	144,367.83	
VICI PROPERTIES / NOTE	250,000.00	237,504.47	
VICI PROPERTIES / NOTE	100,000.00	91,191.86	
VICI PROPERTIES/NOTE	250,000.00	246,475.22	
VICI PROPERTIES/NOTE	650,000.00	649,958.72	
VICI PROPERTIES/NOTE	75,000.00	69,136.32	
VICTORIA'S SECRET & CO	325,000.00	267,132.15	
VIDEOTRON LTD	150,000.00	149,718.75	
VIDEOTRON LTD / LTEE	75,000.00	73,626.74	
VIDTRON LTD/VIDTRON LTEE	350,000.00	316,354.88	
VIKING CRUISES LTD	325,000.00	319,111.94	
VIKING CRUISES LTD	175,000.00	191,536.11	
VIKING OCEAN CRUISES SHI	325,000.00	316,366.50	
VISTRA CORP	225,000.00	223,041.55	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	750,000.00	739,719.67	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	375,000.00	362,943.71	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	375,000.00	348,382.95	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	500,000.00	524,028.60	
VITAL ENERGY INC	125,000.00	131,253.62	
VITAL ENERGY INC	125,000.00	136,730.37	
VITAL ENERGY INC	175,000.00	179,231.04	
VMED 02 UK FINAN	600,000.00	516,069.48	
VOC ESCROW LTD	300,000.00	288,880.77	
WASH MULTIFAM ACQ INC	700,000.00	687,796.27	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	1,150,000.00	1,201,160.85	
WESCO DISTRIBUTION INC	325,000.00	325,503.42	
WESCO DISTRIBUTION INC	300,000.00	306,695.70	
WESTERN DIGITAL CORP	275,000.00	268,622.77	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	250,000.00	228,676.40	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	200,000.00	173,443.74	

		WILLIAMS SCOTSMAN INTL	200,000.00	189,212.70	
		WINDSOR HOLDINGS III LLC	200,000.00	210,023.80	
		WMG ACQUISITION CORP	250,000.00	221,629.27	
		WMG ACQUISITION CORP	250,000.00	211,356.22	
		WR GRACE HOLDING LLC	550,000.00	523,333.63	
		WR GRACE HOLDING LLC	100,000.00	101,613.10	
		WYNDHAM DESTINATIONS INC	275,000.00	276,895.85	
		WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	550,000.00	539,436.15	
		WYNN RESORTS FINANCE LLC	400,000.00	379,137.60	
		WYNN RESORTS FINANCE LLC	225,000.00	232,969.81	
		XEROX HOLDINGS CORP	84,000.00	82,747.48	
		XEROX HOLDINGS CORP	175,000.00	159,573.83	
		XHR LP	200,000.00	200,336.14	
		XPO INC	250,000.00	256,585.00	
		XPO INC	125,000.00	128,785.21	
		YUM! BRANDS INC	150,000.00	132,993.07	
		YUM! BRANDS INC	300,000.00	277,227.39	
		YUM! BRANDS INC	550,000.00	533,126.77	
		ZF NA CAPITAL	150,000.00	158,563.50	
		ZIGGO BOND CO BV	200,000.00	171,428.52	
		ZIGGO BV	400,000.00	358,816.60	
	小計	銘柄数：926	290,013,431.00	276,229,667.00 (41,854,319,143)	
		組入時価比率：94.9%		100.0%	
合計				41,854,319,143 (41,854,319,143)	

(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・イールド ボンド オープンCコース

2024年4月30日現在

資産総額	89,656,871円
負債総額	44,058,834円
純資産総額 (-)	45,598,037円
発行済口数	59,022,246口
1口当たり純資産額 (/)	0.7726円

ハイ・イールド ボンド オープンDコース

2024年4月30日現在

資産総額	1,252,322,589円
負債総額	2,236,146円
純資産総額（ - ）	1,250,086,443円
発行済口数	1,143,092,394口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0936円

（参考）ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

2024年4月30日現在

資産総額	45,568,975,161円
負債総額	202,000,000円
純資産総額（ - ）	45,366,975,161円
発行済口数	3,420,830,323口
1口当たり純資産額（ / ）	13.2620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

2024年5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 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2024年4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	991	54,548,885
単位型株式投資信託	169	632,591
追加型公社債投資信託	14	6,920,406
単位型公社債投資信託	443	844,414
合計	1,617	62,946,296

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。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57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．財務諸表及び中間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(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(１) 貸借対照表

		前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			2,006		1,865
金銭の信託			35,894		42,108
有価証券			29,300		21,900
前払金			11		11
前払費用			454		775
未収入金			694		1,775
未収委託者報酬			27,176		26,116
未収運用受託報酬			4,002		3,780
短期貸付金			1,835		1,001
未収還付法人税等			-		2,083
その他			57		84
貸倒引当金			15		15
流動資産計			101,417		101,486
固定資産					
有形固定資産			1,744		1,335
建物	2	1,219		906	
器具備品	2	525		428	
無形固定資産			5,210		5,563
ソフトウェア		5,209		5,562	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,067		16,336
投資有価証券		2,201		1,793	
関係会社株式		9,214		10,025	
長期差入保証金		443		520	
長期前払費用		13		10	
前払年金費用		1,297		1,553	
繰延税金資産		2,784		2,340	
その他		112		92	
固定資産計			23,023		23,235
資産合計			124,440		124,722

		前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					

預り金			120		124
未払金			17,615		17,879
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		17		57	
未払手数料		8,357		8,409	
関係会社未払金		8,149		8,911	
その他未払金		1,089		500	
未払費用	1		9,512		9,682
未払法人税等			1,319		1,024
前受収益			22		22
賞与引当金			4,416		3,635
その他			121		46
流動負債計			33,127		32,414
固定負債					
退職給付引当金			3,194		2,940
時効後支払損引当金			588		595
資産除去債務			1,123		1,123
固定負債計			4,905		4,659
負債合計			38,033		37,074
(純資産の部)					
株主資本			86,232		87,419
資本金			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			55,322		56,509
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,637		55,823	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,030		31,217	
評価・換算差額等			174		229
その他有価証券評価差額金			174		229
純資産合計			86,407		87,648
負債・純資産合計			124,440		124,722

(2) 損益計算書

		前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		115,733	113,491
運用受託報酬		17,671	18,198
その他営業収益		530	331
営業収益計		133,935	132,021
営業費用			
支払手数料		39,087	38,684
広告宣伝費		804	1,187
公告費		0	0
調査費		26,650	29,050

調査費		4,867		6,045	
委託調査費		21,783		23,004	
委託計算費			1,384		1,363
営業雑経費			3,094		3,302
通信費		72		89	
印刷費		918		903	
協会費		79		83	
諸経費		2,023		2,225	
営業費用計			71,021		73,587
一般管理費					
給料			12,033		11,316
役員報酬		229		226	
給料・手当		7,375		7,752	
賞与		4,427		3,337	
交際費			47		78
寄付金			73		115
旅費交通費			65		283
租税公課			1,049		963
不動産賃借料			1,432		1,232
退職給付費用			1,212		829
固定資産減価償却費			2,525		2,409
諸経費			11,116		12,439
一般管理費計			29,556		29,669
営業利益			33,357		28,763

		前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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	3,530		7,645	
受取利息		10		45	
為替差益		-		49	
その他		1,268		637	
営業外収益計			4,809		8,377
営業外費用					
金銭の信託運用損		1,387		1,736	
時効後支払損引当金繰入額		12		10	
為替差損		23		-	
その他		266		8	
営業外費用計			1,689		1,755
経常利益			36,477		35,385
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		10	
株式報酬受入益		53		46	
固定資産売却益		9		-	
資産除去債務履行差額		141		-	

特別利益計			230		57
特別損失					
投資有価証券等売却損		0		16	
関係会社株式評価損		727		-	
固定資産除却損	2	374		52	
資産除去債務履行差額		0		-	
事務所移転費用		54		-	
特別損失計			1,158		69
税引前当期純利益			35,549		35,374
法人税、住民税及び事業税			10,474		8,890
法人税等調整額			171		419
当期純利益			24,904		26,064

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(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			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						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	30,030	55,322	86,232
当期変動額									
剰余金の配当							24,877	24,877	24,877
当期純利益							26,064	26,064	26,064
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,186	1,186	1,186
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,217	56,509	87,419

(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	174	174	86,407
当期変動額			
剰余金の配当			24,877
当期純利益			26,064
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	54	54	54
当期変動額合計	54	54	1,240
当期末残高	229	229	87,648

[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 市場価格のない ... 時価法 株式等以外のもの (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) 市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等						
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><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。
----------------	---

[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]

（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の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。

これにより、「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。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、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]

該当事項はありません。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2022年3月31日)	当事業年度末 (2023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。 未払費用 1,223百万円	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 1,350百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 901百万円 器具備品 657 合計 1,559

損益計算書関係

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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 3,525百万円	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 7,634百万円
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	2. 固定資産除却損 建物 0百万円 器具備品 0 ソフトウェア 52 合計 52

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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

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

(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

2023年5月23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	55,782百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	10,830円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月30日

金融商品関係

前事業年度(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、自ら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。

	前事業年度（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、前事業年度において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）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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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

2023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	42,108	42,108	-
資産計	42,108	42,108	-
(2)その他（デリバティブ取引）	46	46	-
負債計	46	46	-

(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（ ）	10,261
組合出資金等	1,557
合計	11,819

（ ）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。

- （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	1,865	-	-	-
金銭の信託	42,108	-	-	-
未収委託者報酬	26,116	-	-	-
未収運用受託報酬	3,780	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	21,900	-	-	-
短期貸付金	1,001			
合計	96,772	-	-	-

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）	-	42,108	-	42,108
資産計	-	42,108	-	42,108
デリバティブ取引（通貨関連）	-	46	-	46
負債計	-	46	-	46

- （注）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。構成物のレベルに基づき、レベル2の時価に分類しております。

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 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	前事業年度 (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、記載しておりません。

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。

当事業年度（自 2022年4月 1 日 至 2023年3月31日）

１．売買目的有価証券(2023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(2023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(2023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	9,919
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2023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	21,900	21,900	-
小計	21,900	21,900	-
合計	21,900	21,900	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額235百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,557百万円）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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	66	-	16
合計	66	-	16

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 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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	952	-	46	46

退職給付関係

前事業年度(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	23,270 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	2.35%

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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	21,967 百万円
勤務費用	853
利息費用	188
数理計算上の差異の発生額	1,476
退職給付の支払額	1,133
その他	83
退職給付債務の期末残高	20,314

(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	19,687 百万円
期待運用収益	462
数理計算上の差異の発生額	716
事業主からの拠出額	819
退職給付の支払額	874
年金資産の期末残高	19,378

(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	17,386 百万円
年金資産	19,378

	1,991
--	-------

非積立型制度の退職給付債務	2,927
---------------	-------

未積立退職給付債務	935
-----------	-----

未認識数理計算上の差異	398
-------------	-----

未認識過去勤務費用	53
-----------	----

貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387
----------------------	-------

退職給付引当金	2,940
---------	-------

前払年金費用	1,553
--------	-------

貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387
----------------------	-------

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	853 百万円
------	---------

利息費用	188
------	-----

期待運用収益	462
--------	-----

数理計算上の差異の費用処理額	127
----------------	-----

過去勤務費用の費用処理額	52
--------------	----

確定給付制度に係る退職給付費用	653
-----------------	-----

(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	34%
----	-----

株式	27%
----	-----

生保一般勘定	11%
--------	-----

生保特別勘定	7%
--------	----

その他	21%
-----	-----

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

確定給付型企业年金制度の割引率	1.4%
-----------------	------

退職一時金制度の割引率	1.1%
-------------	------

長期期待運用収益率	2.35%
-----------	-------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

税効果会計関係

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

前事業年度末 (2022年3月31日)	当事業年度末 (2023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	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,381	賞与引当金	1,138
退職給付引当金	990	退職給付引当金	911
関係会社株式評価減	1,010	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	285	未払事業税	227
投資有価証券評価減	110	投資有価証券評価減	11
減価償却超過額	272	減価償却超過額	331
時効後支払損引当金	182	時効後支払損引当金	184
関係会社株式売却損	505	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	92	ゴルフ会員権評価減	78
資産除去債務	348	資産除去債務	348
未払社会保険料	114	未払社会保険料	85
その他	84	その他	44
繰延税金資産小計	5,376	繰延税金資産小計	4,878
評価性引当額	1,795	評価性引当額	1,696
繰延税金資産合計	3,581	繰延税金資産合計	3,181
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	233	資産除去債務に対応する除去費用	171
関係会社株式評価益	81	関係会社株式評価益	84
その他有価証券評価差額金	78	その他有価証券評価差額金	102
前払年金費用	402	前払年金費用	481
繰延税金負債合計	796	繰延税金負債合計	840
繰延税金資産の純額	2,784	繰延税金資産の純額	2,340
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	0.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.4%
タックスヘイブン税制	1.8%	タックスヘイブン税制	2.1%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.6%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
その他	0.1%	その他	0.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.3%

2. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
期首残高	1,371	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加	48	-
資産除去債務の履行による減少	296	-
期末残高	1,123	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

前事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

区分	前事業年度 (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。

当事業年度（自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）

区分	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	113,491百万円
運用受託報酬	17,245百万円
成功報酬（注）	952百万円
その他営業収益	331百万円
合計	132,021百万円

（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 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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 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	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上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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	5,736	短期貸付 金	1,001
							資金の返済	6,489		
							貸付金利息	44	未収利息	11

(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 及び売上の取 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)	27,180	未払手 数 料	5,773

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1 株当たり純資産額	16,775円81銭	1 株当たり純資産額	17,016円74銭
1 株当たり当期純利益	4,835円10銭	1 株当たり当期純利益	5,060円34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いません。		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いません。	
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	24,904百万円	損益計算書上の当期純利益	26,064百万円
普通株式に係る当期純利益	24,904百万円	普通株式に係る当期純利益	26,064百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		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。		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

中間財務諸表

中間貸借対照表

		2023年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		7,755
金銭の信託		42,741
未収委託者報酬		28,981
未収運用受託報酬		5,565
短期貸付金		747
その他		1,398
貸倒引当金		17
流動資産計		87,173
固定資産	1	
有形固定資産		1,140
無形固定資産		5,519
ソフトウェア		5,518
その他		0
投資その他の資産		16,784
投資有価証券		1,862
関係会社株式		10,025
長期差入保証金		519
前払年金費用		1,721
繰延税金資産		1,761
その他		893
固定資産計		23,444
資産合計		110,617

		2023年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
短期借入金		29,900
未払金		12,829
未払収益分配金		1
未払償還金		40
未払手数料		9,305
関係会社未払金		2,395
その他未払金	2	1,085
未払費用		10,122
未払法人税等		2,521
賞与引当金		1,993
その他		201
流動負債計		57,568
固定負債		
退職給付引当金		2,855
時効後支払損引当金		601
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,579
負債合計		62,148
(純資産の部)		
株主資本		48,142
資本金		17,180

資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		17,232
利益準備金		685
その他利益剰余金		16,547
繰越利益剰余金		16,547
評価・換算差額等		325
その他有価証券評価差額金		325
純資産合計		48,468
負債・純資産合計		110,617

中間損益計算書

		自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		59,892
運用受託報酬		10,062
その他営業収益		156
営業収益計		70,111
営業費用		
支払手数料		20,743
調査費		15,670
その他営業費用		2,845
営業費用計		39,259
一般管理費	1	15,475
営業利益		15,376
営業外収益	2	7,161
営業外費用	3	715
経常利益		21,822
特別利益	4	11
特別損失	5	10
税引前中間純利益		21,823
法人税、住民税及び事業税		4,781
法人税等調整額		536
中間純利益		16,505

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金合計
						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	31,217	56,509	87,419
当中間期変動額									
剰余金の配当							55,782	55,782	55,782
中間純利益							16,505	16,505	16,505
別途積立金の取崩						24,606	24,606	-	-
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	24,606	14,669	39,276	39,276
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	-	16,547	17,232	48,142

（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	229	229	87,648
当中間期変動額			
剰余金の配当			55,782
中間純利益			16,505
別途積立金の取崩			-
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	96	96	96
当中間期変動額合計	96	96	39,179
当中間期末残高	325	325	48,468

[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 市場価格のない ... 時価法 株式等以外のもの (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) 市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等						
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、中間会計期間末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> <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 債権の貸倒損失に備えるため、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、支払見込額に基づき当中間会計期間に見合う分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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 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中間会計期間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。
----------------	---

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2023年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,754百万円
2 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

中間損益計算書関係

自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	196百万円
無形固定資産	958百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	6,692百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
金銭の信託運用損	627百万円
4 特別利益の内訳	
株式報酬受入益	11百万円
5 特別損失の内訳	
固定資産除却損	10百万円

中間株主資本等変動計算書関係

自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日				
1	発行済株式に関する事項			
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 5,150,693株
2	配当に関する事項			
	配当金支払額			
	2023年5月23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			
	(1) 配当金の総額		55,782百万円	
	(2) 1株当たり配当額		10,830円	
	(3) 基準日		2023年3月31日	
	(4) 効力発生日		2023年6月30日	

金融商品関係

1．金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、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)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	42,741	42,741	-
資産計	42,741	42,741	-
(2)その他（デリバティブ取引）	60	60	-
負債計	60	60	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期貸付金、短期借入金、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。当該金融商品の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)
市場価格のない株式等（ ）	10,266
組合出資金等	1,621
合計	11,888

() 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．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。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（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）	-	42,741	-	42,741
資産計	-	42,741	-	42,741
デリバティブ取引（通貨関連）	-	60	-	60
負債計	-	60	-	60

（注）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。構成物のレベルに基づき、レベル2の時価に分類しております。

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

当中間会計期間末（2023年9月30日）

1．売買目的有価証券(2023年9月30日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2023年9月30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(2023年9月30日)

市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表 計上額（百万円）
子会社株式	9,919
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2023年9月30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

当中間会計期間（2023年9月30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	684	-	60	60

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

当該資産除去債務の総額の増減 (単位：百万円)

	自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日
期首残高	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加	-
時の経過による調整額	-
中間期末残高	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

区分	当中間会計期間 (自2023年4月 1日 至2023年9月30日)
委託者報酬	59,884百万円
運用受託報酬	9,422百万円
成功報酬（注）	646百万円
その他営業収益	156百万円
合計	70,111百万円

（注）成功報酬は、中間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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間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

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30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、中間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

営業収益

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間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中間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、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先が識別されていないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

1 株当たり情報

	自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日
1 株当たり純資産額	9,410円05銭
1 株当たり中間純利益	3,204円61銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、潜在株式がないため、記載していません。	
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。	
中間純利益	16,505百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	16,505百万円
期中平均株式数	5,150千株

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。

* 2024年4月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	54,323百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	

* 2024年4月末現在

(3) 運用の委託先

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
-------	-----------------------	----------

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）	62,631,798.00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。
---	------------------	--

* 2023年9月末現在

3 資本関係

< 訂正前 >

(2023年3月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 運用の委託先

該当事項はありません。

< 訂正後 >

(2023年9月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 運用の委託先

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2024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

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・イールド ボンド オープンコースの2023年9月29日から2024年3月28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・イールド ボンド オープンコースの2024年3月28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

2024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

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・イールド ボンド オープンDコースの2023年9月29日から2024年3月28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・イールド ボンド オープンDコースの2024年3月28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

2023年6月9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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水 永 真太郎
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、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64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2023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。

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、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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月24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

水 永 真太郎

中間監査意見

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の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。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の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。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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．上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。