【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】	2025年2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】	ＣＥＯ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】	野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型） 野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり
【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】	野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型） 2兆円を上限とします。 野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり 2兆円を上限とします。
【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、2024年8月29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(2025年1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%

２投資方針

（１）投資方針

＜更新後＞

[1]「高利回り社債オープン　マザーファンド」への投資を通じて、主として米国ドル建ての高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）に実質的に投資し、中長期的に、高水準のインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得を目指します。

◆投資するハイ・イールド・ボンドは主としてBB格相当以下の格付が付与されているもの(格付がない場合は同等の信用度を有すると判断されるものを含みます。)とします。

◆米国ドル建て以外のハイ・イールド・ボンドに投資する場合もあります。

[2]投資対象の徹底したクレジット分析と分散投資により、ポートフォリオ全体のリスクの低減を目指します。

◆ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、投資対象の徹底したクレジット分析を行なうことにより、信用リスクのコントロールを行ないます。

◆ポートフォリオによる分散投資によりリスクの低減を図ることを基本とします。

◆同一発行体の発行するハイ・イールド・ボンドへの投資割合は、マザーファンドの純資産総額の10%以内とします。

◆投資対象を40業種に分類し、1業種あたりの投資割合は、原則としてマザーファンドの純資産総額の

25%以内とします。

[3]「野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）」は原則として為替ヘッジを行なわず、「野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり」は原則として為替ヘッジを行ないます。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）	野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり
実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。	実質組入外貨建資産については、原則として為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを目指します。

[4]ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク(NCRAM社)に、運用の指図に関する権限の一部を委託します。

◆マザーファンドの運用にあたっては、「ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク」(NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC.)に運用の指図に関する権限の一部を委託します。

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考)NCRAM社について

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

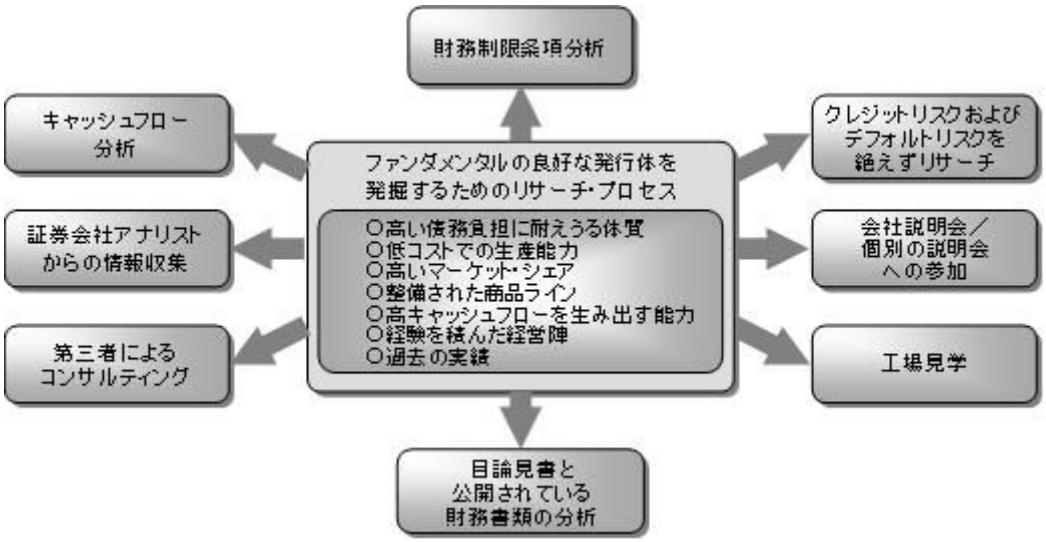
◆NCRAM社は、クレジットリスクを有する債券の運用において充実した体制を整えています。

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

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

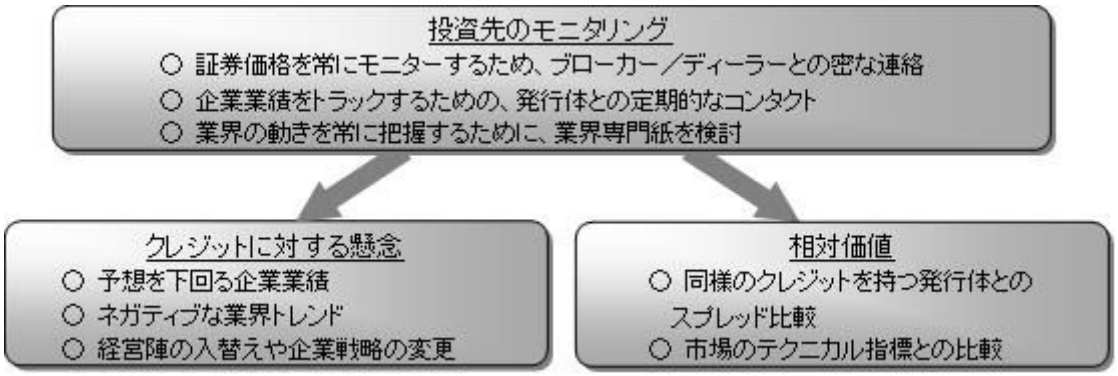
■NCRAM社のリサーチプロセス■

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



■投資先のモニタリングと規律ある売却■

◆投資先は継続的にモニターされ、状況に応じてポートフォリオを修正します。



３投資リスク

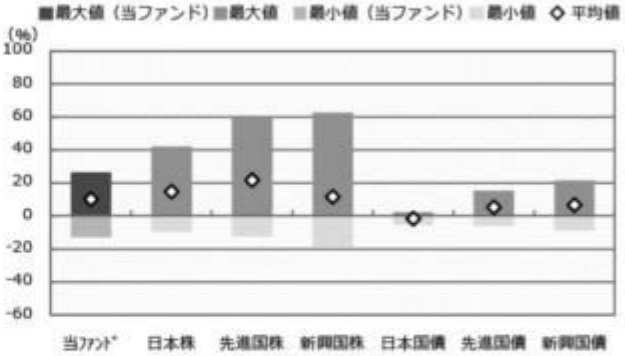
＜更新後＞

リスクの定量的比較（2020年1月末～2024年12月末：月次）

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

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



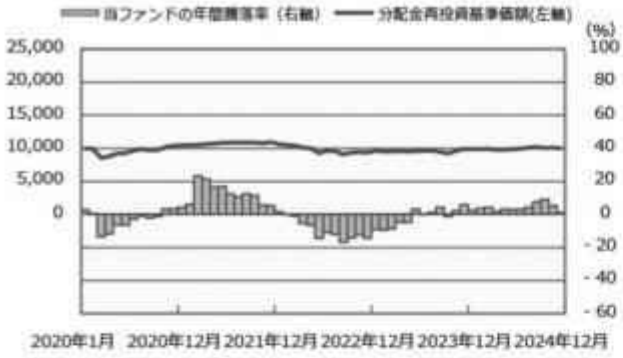
	当ﾌｧﾝﾄﾞ	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値（%）	**26.5**	42.1	59.8	62.7	2.3	15.3	21.5
最小値（%）	**△ 12.9**	△ 9.5	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値（%）	**10.3**	14.7	21.7	11.7	△ 1.7	5.3	6.6

＊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。2020年1月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2020年1月から2024年12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。

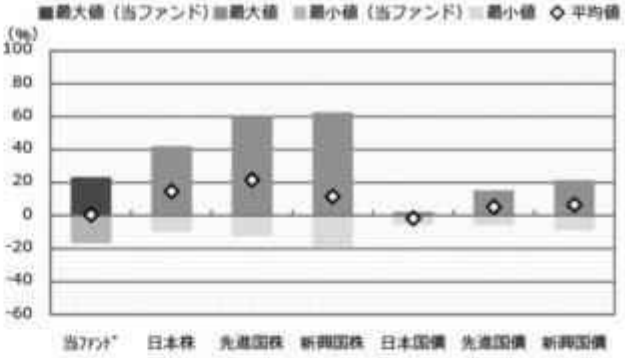
＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2020年1月から2024年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

▮野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

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（%）	**23.3**	42.1	59.8	62.7	2.3	15.3	21.5
最小値（%）	**△16.9**	△9.5	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値（%）	**0.5**	14.7	21.7	11.7	△1.7	5.3	6.6

＊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。2020年1月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2020年1月から2024年12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。
＊2020年1月から2024年12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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（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）に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」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）に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸ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ＪＰＸ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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（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、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメークを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
JPMSLLCはNASD, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

４手数料等及び税金

（５）課税上の取扱い

＜更新後＞

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

＜収益分配金に対する課税＞

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

なお、配当控除は適用されません。

＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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

≪損益通算について≫

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

《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。

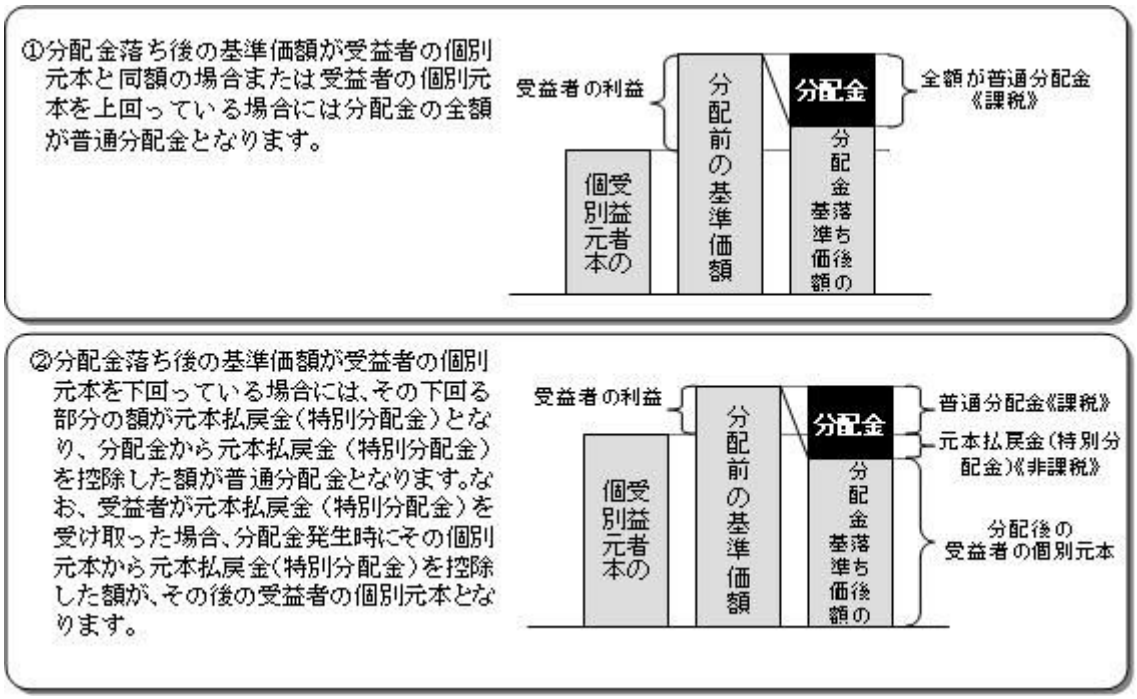
■個別元本について■

◆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12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
米ハイ	1.91	1.86	0.05
米ハイ・ヘッジあり	1.94	1.86	0.08

（2024年1月13日～2024年7月12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12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

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

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	13,579,953,766	99.12
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	119,984,219	0.87
合計（純資産総額）		13,699,937,985	100.00

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

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	1,191,890,660	99.40
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	7,125,181	0.59
合計（純資産総額）		1,199,015,841	100.00

（参考）高利回り社債オープン　マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	400,899,489	0.91
新株予約権証券	アメリカ	776,980	0.00
社債券	アメリカ	42,263,289,035	96.35
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	1,197,112,606	2.72
合計（純資産総額）		43,862,078,110	100.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

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	高利回り社債オープン　マザーファンド	2,369,643,639	5.5804	13,223,559,364	5.7308	13,579,953,766	99.12

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	99.12
合　　計	99.12

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

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	高利回り社債オープン　マザーファンド	207,979,804	5.5804	1,160,610,499	5.7308	1,191,890,660	99.40

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	99.40
合　　計	99.40

（参考）高利回り社債オープン　マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	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	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	—	2,811,000	12,768.61	358,925,671	13,608.88	382,545,623	4.5	2032/5/1	0.87
2	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	—	2,250,000	15,604.45	351,100,282	15,795.38	355,396,269	5.75	2027/3/1	0.81
3	アメリカ	社債券	WEATHERFORD INTERNATIONA	—	1,475,000	16,401.65	241,924,375	16,353.39	241,212,529	8.625	2030/4/30	0.54
4	アメリカ	社債券	METIS MERGER SUB LLC	—	1,392,000	14,823.97	206,349,771	15,151.28	210,905,828	6.5	2029/5/15	0.48
5	アメリカ	社債券	INNOPHOS HOLDINGS INC	—	1,275,000	13,441.20	171,375,300	15,814.56	201,635,735	9.375	2028/2/15	0.45
6	アメリカ	社債券	DORNOCH DEBT MERGER SUB	—	1,475,000	13,487.38	198,938,943	12,715.32	187,550,991	6.625	2029/10/15	0.42
7	アメリカ	社債券	CP ATLAS BUYER INC	—	1,338,000	13,484.96	180,428,813	13,910.41	186,121,319	7	2028/12/1	0.42
8	アメリカ	社債券	SFA ISSUER LLC	—	1,200,000	15,632.63	187,591,593	15,323.90	183,886,811	11	2029/12/15	0.41
9	アメリカ	社債券	SCIH SALT HOLDINGS INC	—	1,210,000	14,881.84	180,070,264	15,095.99	182,661,599	6.625	2029/5/1	0.41
10	アメリカ	社債券	WERNER FINCO LP/INC	—	1,103,497	15,760.37	173,915,271	15,957.04	176,085,459	8.75	2028/10/15	0.40
11	アメリカ	社債券	SIRIUS XM RADIO INC	—	1,200,000	14,332.74	171,992,999	14,653.06	175,836,830	4	2028/7/15	0.40
12	アメリカ	社債券	NCL CORPORATION LTD	—	1,100,000	15,670.70	172,377,783	15,811.59	173,927,531	5.875	2026/3/15	0.39
13	アメリカ	社債券	LEVEL 3 FINANCING INC	—	1,400,000	5,832.88	81,660,424	12,377.58	173,286,189	3.75	2029/7/15	0.39
14	アメリカ	社債券	ADAMS HOMES INC	—	1,050,000	16,236.66	170,484,958	16,425.23	172,464,940	9.25	2028/10/15	0.39
15	アメリカ	社債券	ATHENAHEALTH GROUP INC	—	1,125,000	14,495.92	163,079,140	15,044.84	169,254,501	6.5	2030/2/15	0.38
16	アメリカ	社債券	VISTRA OPERATIONS CO LLC	—	1,000,000	16,509.44	165,094,459	16,617.25	166,172,519	7.75	2031/10/15	0.37
17	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	—	1,050,000	15,743.65	165,308,381	15,746.44	165,337,662	6.125	2028/10/1	0.37
18	アメリカ	社債券	TERRAFORM POWER OPERATIN	—	1,100,000	14,435.98	158,795,830	14,670.02	161,370,252	4.75	2030/1/15	0.36

19	アメリカ	社債券	CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO	—	1,150,000	13,261.55	152,507,918	13,745.96	158,078,638	7.5	2029/6/1	0.36
20	アメリカ	社債券	WR GRACE HOLDING LLC	—	1,075,000	14,447.62	155,311,984	14,558.44	156,503,309	5.625	2029/8/15	0.35
21	アメリカ	社債券	MOLINA HEALTHCARE INC	—	1,125,000	13,679.40	153,893,322	13,708.64	154,222,267	3.875	2032/5/15	0.35
22	アメリカ	株式	TALEN ENERGY CORP	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	4,847	18,813.92	91,191,115	31,654.98	153,431,696	—	—	0.34
23	アメリカ	社債券	CIVITAS RESOURCES INC	—	925,000	16,976.63	157,033,861	16,566.99	153,244,718	8.625	2030/11/1	0.34
24	アメリカ	社債券	L BRANDS INC	—	950,000	15,700.47	149,154,470	16,063.63	152,604,512	6.75	2036/7/1	0.34
25	アメリカ	社債券	OLYMPUS WTR US HLDG CORP	—	900,000	16,745.94	150,713,482	16,796.07	151,164,670	9.75	2028/11/15	0.34
26	アメリカ	社債券	FOUNDATION BUILDING M	—	1,075,000	13,978.30	150,266,794	13,901.42	149,440,315	6	2029/3/1	0.34
27	アメリカ	社債券	DELEK LOG PART/FINANCE	—	900,000	16,307.72	146,769,528	16,355.58	147,200,244	8.625	2029/3/15	0.33
28	アメリカ	社債券	DIRECTV HOLDINGS/FING	—	950,000	14,988.23	142,388,204	15,406.07	146,357,673	5.875	2027/8/15	0.33
29	アメリカ	社債券	HAT HOLDINGS I LLC/HAT	—	1,039,000	13,829.67	143,690,349	13,958.04	145,024,056	3.75	2030/9/15	0.33
30	アメリカ	社債券	CLOUD SOFTWARE GRP INC	—	900,000	15,366.31	138,296,797	16,076.81	144,691,299	9	2029/9/30	0.32

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	石油・ガス・消耗燃料	0.11
		自動車用部品	0.06
		専門小売り	0.00
		医薬品	0.00
		コンピュータ・周辺機器	0.08
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.34
		その他の業種	0.29
新株予約権証券	—	—	0.00
社債券	—	—	96.35
合　　計			97.27

②投資不動産物件

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）
該当事項はありません。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり
該当事項はありません。

（参考）高利回り社債オープン　マザーファンド
該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）
該当事項はありません。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり
該当事項はありません。

（参考）高利回り社債オープン　マザーファンド

該当事項はありません。

（３）運用実績

①純資産の推移

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

2024年12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8特定期間　(2015年 6月12日)	21,544	21,761	1.4862	1.5012
第9特定期間　(2015年12月14日)	16,597	16,799	1.2295	1.2445
第10特定期間　(2016年 6月13日)	12,695	12,874	1.0637	1.0787
第11特定期間　(2016年12月12日)	13,932	14,115	1.1394	1.1544
第12特定期間　(2017年 6月12日)	18,813	19,080	1.0564	1.0714
第13特定期間　(2017年12月12日)	25,750	26,132	1.0125	1.0275
第14特定期間　(2018年 6月12日)	25,890	26,319	0.9057	0.9207
第15特定期間　(2018年12月12日)	21,523	21,648	0.8639	0.8689
第16特定期間　(2019年 6月12日)	18,971	19,085	0.8290	0.8340
第17特定期間　(2019年12月12日)	17,035	17,140	0.8116	0.8166
第18特定期間　(2020年 6月12日)	14,043	14,139	0.7332	0.7382
第19特定期間　(2020年12月14日)	14,251	14,345	0.7605	0.7655
第20特定期間　(2021年 6月14日)	14,022	14,108	0.8103	0.8153
第21特定期間　(2021年12月13日)	13,344	13,426	0.8129	0.8179
第22特定期間　(2022年 6月13日)	13,323	13,403	0.8346	0.8396
第23特定期間　(2022年12月12日)	12,686	12,764	0.8131	0.8181
第24特定期間　(2023年 6月12日)	12,759	12,836	0.8238	0.8288
第25特定期間　(2023年12月12日)	12,945	13,020	0.8609	0.8659
第26特定期間　(2024年 6月12日)	13,723	13,796	0.9398	0.9448
第27特定期間　(2024年12月12日)	13,412	13,484	0.9346	0.9396
2023年12月末日	12,948	—	0.8639	—
2024年 1月末日	13,291	—	0.8927	—
2月末日	13,431	—	0.9075	—
3月末日	13,509	—	0.9172	—
4月末日	13,708	—	0.9355	—
5月末日	13,775	—	0.9371	—
6月末日	14,096	—	0.9659	—
7月末日	13,476	—	0.9246	—
8月末日	12,930	—	0.8900	—
9月末日	12,898	—	0.8861	—
10月末日	13,580	—	0.9388	—
11月末日	13,298	—	0.9250	—

12月末日	13,699	—	0.9587	—

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

2024年12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6特定期間 (2015年 6月12日)	5,829	5,856	1.0054	1.0099
第7特定期間 (2015年12月14日)	4,117	4,138	0.8798	0.8843
第8特定期間 (2016年 6月13日)	3,758	3,777	0.9023	0.9068
第9特定期間 (2016年12月12日)	3,844	3,863	0.9387	0.9432
第10特定期間 (2017年 6月12日)	3,729	3,746	0.9530	0.9575
第11特定期間 (2017年12月12日)	3,677	3,695	0.9332	0.9377
第12特定期間 (2018年 6月12日)	3,341	3,358	0.9083	0.9128
第13特定期間 (2018年12月12日)	2,896	2,906	0.8510	0.8540
第14特定期間 (2019年 6月12日)	2,660	2,669	0.8519	0.8549
第15特定期間 (2019年12月12日)	2,401	2,410	0.8367	0.8397
第16特定期間 (2020年 6月12日)	2,110	2,119	0.7706	0.7736
第17特定期間 (2020年12月14日)	2,218	2,226	0.8304	0.8334
第18特定期間 (2021年 6月14日)	2,070	2,077	0.8516	0.8546
第19特定期間 (2021年12月13日)	1,909	1,916	0.8386	0.8416
第20特定期間 (2022年 6月13日)	1,635	1,642	0.7334	0.7364
第21特定期間 (2022年12月12日)	1,532	1,538	0.7003	0.7033
第22特定期間 (2023年 6月12日)	1,555	1,562	0.6863	0.6893
第23特定期間 (2023年12月12日)	1,460	1,465	0.6788	0.6808
第24特定期間 (2024年 6月12日)	1,304	1,308	0.6798	0.6818
第25特定期間 (2024年12月12日)	1,224	1,228	0.6900	0.6920
2023年12月末日	1,408	—	0.6972	—
2024年 1月末日	1,373	—	0.6919	—
2月末日	1,355	—	0.6883	—
3月末日	1,344	—	0.6911	—
4月末日	1,308	—	0.6793	—
5月末日	1,314	—	0.6794	—
6月末日	1,285	—	0.6808	—
7月末日	1,274	—	0.6856	—
8月末日	1,284	—	0.6930	—
9月末日	1,281	—	0.6986	—
10月末日	1,235	—	0.6880	—
11月末日	1,232	—	0.6898	—
12月末日	1,199	—	0.6810	—

②分配の推移

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

	計算期間	1口当たりの分配金

第8特定期間	2014年12月13日～2015年 6月12日	0.0900円
第9特定期間	2015年 6月13日～2015年12月14日	0.0900円
第10特定期間	2015年12月15日～2016年 6月13日	0.0900円
第11特定期間	2016年 6月14日～2016年12月12日	0.0900円
第12特定期間	2016年12月13日～2017年 6月12日	0.0900円
第13特定期間	2017年 6月13日～2017年12月12日	0.0900円
第14特定期間	2017年12月13日～2018年 6月12日	0.0900円
第15特定期間	2018年 6月13日～2018年12月12日	0.0400円
第16特定期間	2018年12月13日～2019年 6月12日	0.0300円
第17特定期間	2019年 6月13日～2019年12月12日	0.0300円
第18特定期間	2019年12月13日～2020年 6月12日	0.0300円
第19特定期間	2020年 6月13日～2020年12月14日	0.0300円
第20特定期間	2020年12月15日～2021年 6月14日	0.0300円
第21特定期間	2021年 6月15日～2021年12月13日	0.0300円
第22特定期間	2021年12月14日～2022年 6月13日	0.0300円
第23特定期間	2022年 6月14日～2022年12月12日	0.0300円
第24特定期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	0.0300円
第25特定期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	0.0300円
第26特定期間	2023年12月13日～2024年 6月12日	0.0300円
第27特定期間	2024年 6月13日～2024年12月12日	0.0300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。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

	計算期間	1口当たりの分配金
第6特定期間	2014年12月13日～2015年 6月12日	0.0270円
第7特定期間	2015年 6月13日～2015年12月14日	0.0270円
第8特定期間	2015年12月15日～2016年 6月13日	0.0270円
第9特定期間	2016年 6月14日～2016年12月12日	0.0270円
第10特定期間	2016年12月13日～2017年 6月12日	0.0270円
第11特定期間	2017年 6月13日～2017年12月12日	0.0270円
第12特定期間	2017年12月13日～2018年 6月12日	0.0270円
第13特定期間	2018年 6月13日～2018年12月12日	0.0195円
第14特定期間	2018年12月13日～2019年 6月12日	0.0180円
第15特定期間	2019年 6月13日～2019年12月12日	0.0180円
第16特定期間	2019年12月13日～2020年 6月12日	0.0180円
第17特定期間	2020年 6月13日～2020年12月14日	0.0180円
第18特定期間	2020年12月15日～2021年 6月14日	0.0180円
第19特定期間	2021年 6月15日～2021年12月13日	0.0180円
第20特定期間	2021年12月14日～2022年 6月13日	0.0180円
第21特定期間	2022年 6月14日～2022年12月12日	0.0180円
第22特定期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	0.0180円
第23特定期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	0.0120円
第24特定期間	2023年12月13日～2024年 6月12日	0.0120円

第25特定期間	2024年 6月13日～2024年12月12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。

③収益率の推移

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

	計算期間	収益率
第8特定期間	2014年12月13日～2015年 6月12日	6.9%
第9特定期間	2015年 6月13日～2015年12月14日	△11.2%
第10特定期間	2015年12月15日～2016年 6月13日	△6.2%
第11特定期間	2016年 6月14日～2016年12月12日	15.6%
第12特定期間	2016年12月13日～2017年 6月12日	0.6%
第13特定期間	2017年 6月13日～2017年12月12日	4.4%
第14特定期間	2017年12月13日～2018年 6月12日	△1.7%
第15特定期間	2018年 6月13日～2018年12月12日	△0.2%
第16特定期間	2018年12月13日～2019年 6月12日	△0.6%
第17特定期間	2019年 6月13日～2019年12月12日	1.5%
第18特定期間	2019年12月13日～2020年 6月12日	△6.0%
第19特定期間	2020年 6月13日～2020年12月14日	7.8%
第20特定期間	2020年12月15日～2021年 6月14日	10.5%
第21特定期間	2021年 6月15日～2021年12月13日	4.0%
第22特定期間	2021年12月14日～2022年 6月13日	6.4%
第23特定期間	2022年 6月14日～2022年12月12日	1.0%
第24特定期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	5.0%
第25特定期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	8.1%
第26特定期間	2023年12月13日～2024年 6月12日	12.6%
第27特定期間	2024年 6月13日～2024年12月12日	2.6%

※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。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

	計算期間	収益率
第6特定期間	2014年12月13日～2015年 6月12日	3.1%
第7特定期間	2015年 6月13日～2015年12月14日	△9.8%
第8特定期間	2015年12月15日～2016年 6月13日	5.6%
第9特定期間	2016年 6月14日～2016年12月12日	7.0%
第10特定期間	2016年12月13日～2017年 6月12日	4.4%
第11特定期間	2017年 6月13日～2017年12月12日	0.8%
第12特定期間	2017年12月13日～2018年 6月12日	0.2%
第13特定期間	2018年 6月13日～2018年12月12日	△4.2%
第14特定期間	2018年12月13日～2019年 6月12日	2.2%
第15特定期間	2019年 6月13日～2019年12月12日	0.3%
第16特定期間	2019年12月13日～2020年 6月12日	△5.7%

第17特定期間	2020年 6月13日～2020年12月14日	10.1%
第18特定期間	2020年12月15日～2021年 6月14日	4.7%
第19特定期間	2021年 6月15日～2021年12月13日	0.6%
第20特定期間	2021年12月14日～2022年 6月13日	△10.4%
第21特定期間	2022年 6月14日～2022年12月12日	△2.1%
第22特定期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	0.6%
第23特定期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	0.7%
第24特定期間	2023年12月13日～2024年 6月12日	1.9%
第25特定期間	2024年 6月13日～2024年12月12日	3.3%

※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

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第8特定期間	2014年12月13日～2015年 6月12日	4,539,012,468	4,154,295,551	14,496,523,141
第9特定期間	2015年 6月13日～2015年12月14日	2,470,199,891	3,467,697,136	13,499,025,896
第10特定期間	2015年12月15日～2016年 6月13日	1,308,709,361	2,871,790,522	11,935,944,735
第11特定期間	2016年 6月14日～2016年12月12日	1,884,995,730	1,593,305,056	12,227,635,409
第12特定期間	2016年12月13日～2017年 6月12日	7,550,076,475	1,968,184,813	17,809,527,071
第13特定期間	2017年 6月13日～2017年12月12日	9,554,432,555	1,931,679,082	25,432,280,544
第14特定期間	2017年12月13日～2018年 6月12日	5,321,600,533	2,167,651,532	28,586,229,545
第15特定期間	2018年 6月13日～2018年12月12日	2,409,501,586	6,081,445,300	24,914,285,831
第16特定期間	2018年12月13日～2019年 6月12日	650,260,138	2,680,959,058	22,883,586,911
第17特定期間	2019年 6月13日～2019年12月12日	440,721,946	2,333,954,083	20,990,354,774
第18特定期間	2019年12月13日～2020年 6月12日	342,793,579	2,179,243,393	19,153,904,960
第19特定期間	2020年 6月13日～2020年12月14日	316,372,690	730,898,418	18,739,379,232
第20特定期間	2020年12月15日～2021年 6月14日	311,431,339	1,745,868,943	17,304,941,628
第21特定期間	2021年 6月15日～2021年12月13日	248,709,191	1,138,761,507	16,414,889,312
第22特定期間	2021年12月14日～2022年 6月13日	399,004,458	849,824,660	15,964,069,110
第23特定期間	2022年 6月14日～2022年12月12日	384,139,266	746,875,303	15,601,333,073
第24特定期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	501,219,374	614,115,752	15,488,436,695
第25特定期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	404,637,953	857,094,760	15,035,979,888
第26特定期間	2023年12月13日～2024年 6月12日	511,692,580	946,171,634	14,601,500,834
第27特定期間	2024年 6月13日～2024年12月12日	406,081,710	655,785,609	14,351,796,935

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第6特定期間	2014年12月13日～2015年 6月12日	192,913,665	1,788,982,836	5,798,828,994
第7特定期間	2015年 6月13日～2015年12月14日	79,357,364	1,198,417,023	4,679,769,335
第8特定期間	2015年12月15日～2016年 6月13日	69,360,435	583,230,653	4,165,899,117

第9特定期間	2016年 6月14日～2016年12月12日	570,723,726	640,660,507	4,095,962,336
第10特定期間	2016年12月13日～2017年 6月12日	627,837,124	810,469,678	3,913,329,782
第11特定期間	2017年 6月13日～2017年12月12日	388,128,703	360,458,275	3,941,000,210
第12特定期間	2017年12月13日～2018年 6月12日	97,568,838	359,482,303	3,679,086,745
第13特定期間	2018年 6月13日～2018年12月12日	89,928,880	365,726,883	3,403,288,742
第14特定期間	2018年12月13日～2019年 6月12日	27,088,826	307,456,354	3,122,921,214
第15特定期間	2019年 6月13日～2019年12月12日	60,440,364	313,079,530	2,870,282,048
第16特定期間	2019年12月13日～2020年 6月12日	26,447,690	157,454,217	2,739,275,521
第17特定期間	2020年 6月13日～2020年12月14日	28,885,087	96,845,348	2,671,315,260
第18特定期間	2020年12月15日～2021年 6月14日	20,783,911	260,954,870	2,431,144,301
第19特定期間	2021年 6月15日～2021年12月13日	16,744,747	170,848,323	2,277,040,725
第20特定期間	2021年12月14日～2022年 6月13日	48,597,029	94,833,974	2,230,803,780
第21特定期間	2022年 6月14日～2022年12月12日	70,463,954	112,904,240	2,188,363,494
第22特定期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	195,630,878	117,756,321	2,266,238,051
第23特定期間	2023年 6月13日～2023年12月12日	51,326,060	165,473,062	2,152,091,049
第24特定期間	2023年12月13日～2024年 6月12日	46,031,511	279,394,621	1,918,727,939
第25特定期間	2024年 6月13日～2024年12月12日	45,162,343	188,680,871	1,775,209,411

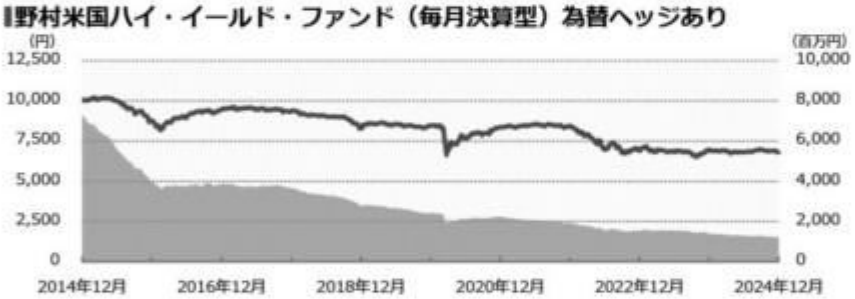
※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

≪参考情報≫

＜更新後＞

運用実績（2024年12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）

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

2024年12月	50 円
2024年11月	50 円
2024年10月	50 円
2024年9月	50 円
2024年8月	50 円
直近1年間累計	600 円
設定来累計	13,405 円

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

2024年12月	20 円
2024年11月	20 円
2024年10月	20 円
2024年9月	20 円
2024年8月	20 円
直近1年間累計	240 円
設定来累計	5,235 円

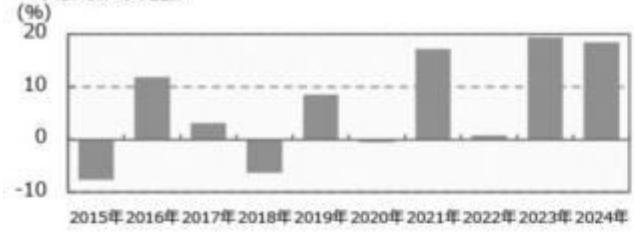
主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

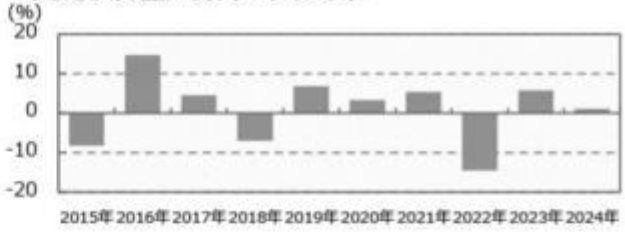
順位	銘柄	投資比率（%）	
		米ハイ	米ハイ・ヘッジあり
1	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	0.9	0.9
2	CARNIVAL CORP	0.8	0.8
3	WEATHERFORD INTERNATIONA	0.5	0.5
4	METIS MERGER SUB LLC	0.5	0.5
5	INNOPHOS HOLDINGS INC	0.4	0.4
6	DORNOCH DEBT MERGER SUB	0.4	0.4
7	CP ATLAS BUYER INC	0.4	0.4
8	SFA ISSUER LLC	0.4	0.4
9	SCIH SALT HOLDINGS INC	0.4	0.4
10	WERNER FINCO LP/INC	0.4	0.4

年間収益率の推移（暦年ベース）

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）



野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり



・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
・ファンドにベンチマークはありません。
・2024年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

(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口単位または1円単位（当初元本1口＝1円）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

販売会社の定める期日までに支払うものとします。

(6)スイッチング

スイッチングのお取扱いはありません。

(7)積立方式

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

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

(8)申込受け付けの中止および取り消し

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

(9)申込手続等に関する照会先

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

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　https://www.nomura-am.co.jp/

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

＜訂正後＞

(1)受益権の募集

申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。

(2)申込締切時間

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口単位または1円単位（当初元本1口＝1円）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

販売会社の定める期日までに支払うものとします。

(6)スイッチング

スイッチングのお取扱いはありません。

(7)積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約※を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。
※当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

(8)申込受け付けの中止および取り消し

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

(9)申込手続等に関する照会先

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

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　https://www.nomura-am.co.jp/

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

２換金（解約）手続等

＜訂正前＞

(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

換金のお申込み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行なえません。また、別途、大口解約について、1日1件5億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や一部解約の受付時間に制限を設ける場合があります。

(6)換金代金の支払い

原則として一部解約の実行の請求日から起算して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

金融商品取引所等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付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとします。

(8)換金手続等に関する照会先

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル　0120-753104(フリーダイヤル)

＜受付時間＞　営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ　https://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、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

換金のお申込み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行なえません。また、別途、大口解約について、1日1件5億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や一部解約の受付時間に制限を設ける場合があります。

(6)換金代金の支払い

原則として一部解約の実行の請求日から起算して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

金融商品取引所等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付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとします。

(8)換金手続等に関する照会先

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

野村アセットマネジメント株式会社
サポートダイヤル　0120-753104(フリーダイヤル)
＜受付時間＞　営業日の午前9時～午後5時
インターネットホームページ　https://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】

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）
野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

(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(2024年6月13日から2024年12月12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

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	前期 (2024年 6月12日現在)	当期 (2024年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	132,311,906	130,805,114
親投資信託受益証券	13,591,520,013	13,282,556,467
未収入金	100,698,000	99,757,000
未収利息	299	851
流動資産合計	13,824,530,218	13,513,119,432
資産合計	13,824,530,218	13,513,119,432
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	73,007,504	71,758,984
未払解約金	7,281,416	7,832,207
未払受託者報酬	620,135	609,695
未払委託者報酬	20,464,404	20,119,954
その他未払費用	24,792	24,377
流動負債合計	101,398,251	100,345,217
負債合計	101,398,251	100,345,217
純資産の部		
元本等		
元本	14,601,500,834	14,351,796,935
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△878,368,867	△939,022,720
（分配準備積立金）	1,272,157,218	1,407,158,053
元本等合計	13,723,131,967	13,412,774,215
純資産合計	13,723,131,967	13,412,774,215
負債純資産合計	13,824,530,218	13,513,119,432

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	前期 自　2023年12月13日 至　2024年 6月12日	当期 自　2024年 6月13日 至　2024年12月12日
営業収益		
受取利息	26,161	142,377
有価証券売買等損益	1,737,359,905	482,580,454
営業収益合計	1,737,386,066	482,722,831
営業費用		

	前期 自　2023年12月13日 至　2024年 6月12日	当期 自　2024年 6月13日 至　2024年12月12日
支払利息	4,480	-
受託者報酬	3,682,836	3,690,939
委託者報酬	121,533,538	121,801,065
その他費用	147,252	147,573
営業費用合計	125,368,106	125,639,577
営業利益又は営業損失（△）	1,612,017,960	357,083,254
経常利益又は経常損失（△）	1,612,017,960	357,083,254
当期純利益又は当期純損失（△）	1,612,017,960	357,083,254
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（△）	8,973,557	△394,315
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△2,090,954,830	△878,368,867
剰余金増加額又は欠損金減少額	99,073,073	50,098,108
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	99,073,073	50,098,108
剰余金減少額又は欠損金増加額	47,031,632	33,496,558
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	47,031,632	33,496,558
分配金	442,499,881	434,732,972
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△878,368,867	△939,022,720

（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、2024年 6月13日から2024年12月12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 2024年 6月12日現在	当期 2024年12月12日現在
１．　特定期間の末日における受益権の総数 14,601,500,834口	１．　特定期間の末日における受益権の総数 14,351,796,935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　878,368,867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　939,022,720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　0.9398円 (10,000口当たり純資産額)　(9,398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　0.9346円 (10,000口当たり純資産額)　(9,346円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期
自 2023年12月13日
至 2024年 6月12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高利回り社債オープン 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　126,085,369円

２.分配金の計算過程
2023年12月13日から2024年 1月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	66,227,290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	61,263,510円
収益調整金額	C	2,133,747,780円
分配準備積立金額	D	322,688,148円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,583,926,728円
当ファンドの期末残存口数	F	14,937,703,214口

当期
自 2024年 6月13日
至 2024年12月12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高利回り社債オープン 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　123,622,174円

２.分配金の計算過程
2024年 6月13日から2024年 7月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	72,454,241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	260,474,345円
収益調整金額	C	2,114,937,544円
分配準備積立金額	D	1,264,216,427円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,712,082,557円
当ファンドの期末残存口数	F	14,579,280,154口

10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,729円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	74,688,516円

2024年 1月13日から2024年 2月13日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	72,752,073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	362,697,794円
収益調整金額	C	2,124,335,823円
分配準備積立金額	D	371,461,518円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,931,247,208円
当ファンドの期末残存口数	F	14,856,366,714口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,973円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	74,281,833円

2024年 2月14日から2024年 3月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	48,020,450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	2,116,326,581円
分配準備積立金額	D	725,544,199円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,889,891,230円
当ファンドの期末残存口数	F	14,777,130,256口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,955円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	73,885,651円

2024年 3月13日から2024年 4月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	71,517,958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	205,192,953円
収益調整金額	C	2,108,039,734円
分配準備積立金額	D	692,569,729円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,077,320,374円
当ファンドの期末残存口数	F	14,695,520,515口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,094円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	73,477,602円

2024年 4月13日から2024年 5月13日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	74,000,295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	300,888,766円
収益調整金額	C	2,102,994,242円
分配準備積立金額	D	887,983,371円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,365,866,674円
当ファンドの期末残存口数	F	14,631,755,049口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,300円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	73,158,775円

2024年 5月14日から2024年 6月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	67,098,513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	103,683,998円
収益調整金額	C	2,111,998,545円
分配準備積立金額	D	1,174,382,211円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,457,163,267円
当ファンドの期末残存口数	F	14,601,500,834口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,367円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	73,007,504円

10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,546円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	72,896,400円

2024年 7月13日から2024年 8月13日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	57,572,795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	2,114,346,806円
分配準備積立金額	D	1,511,147,904円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,683,067,505円
当ファンドの期末残存口数	F	14,523,699,820口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,535円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	72,618,499円

2024年 8月14日から2024年 9月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	52,658,749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	2,131,018,655円
分配準備積立金額	D	1,486,022,056円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,669,699,460円
当ファンドの期末残存口数	F	14,549,185,915口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,522円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	72,745,929円

2024年 9月13日から2024年10月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	74,074,799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	2,134,207,409円
分配準備積立金額	D	1,459,010,504円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,667,292,712円
当ファンドの期末残存口数	F	14,533,554,634口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,523円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	72,667,773円

2024年10月16日から2024年11月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	66,758,592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	2,121,113,970円
分配準備積立金額	D	1,442,840,258円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,630,712,820円
当ファンドの期末残存口数	F	14,409,077,543口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,519円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	72,045,387円

2024年11月13日から2024年12月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	50,940,982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	2,116,641,815円
分配準備積立金額	D	1,427,976,055円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,595,558,852円
当ファンドの期末残存口数	F	14,351,796,935口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,505円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	71,758,984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12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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。	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 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。	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 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。	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 2024年 6月12日現在	当期 2024年12月12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12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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12月13日 至 2024年 6月12日		当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12日	
期首元本額	15,035,979,888円	期首元本額	14,601,500,834円
期中追加設定元本額	511,692,580円	期中追加設定元本額	406,081,710円
期中一部解約元本額	946,171,634円	期中一部解約元本額	655,785,609円

２ 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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	191,020,600	△18,803,707
合計	191,020,600	△18,803,707

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12月12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12月12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	高利回り社債オープン　マザーファンド	2,380,215,839	13,282,556,467	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：99.0%	2,380,215,839	13,282,556,467 100.0%	
合計				13,282,556,467	

(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。

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

（１）貸借対照表

（単位：円）

	前期 (2024年 6月12日現在)	当期 (2024年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	37,310,610	12,197,686
親投資信託受益証券	1,300,188,307	1,196,748,259
未収入金	6,000,000	22,278,305
未収利息	84	79
流動資産合計	1,343,499,001	1,231,224,329
資産合計	1,343,499,001	1,231,224,329
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,087,713	310,852
未払金	677,746	-
未払収益分配金	3,837,455	3,550,418
未払解約金	2,517,173	620,234
未払受託者報酬	59,334	55,666
未払委託者報酬	1,958,047	1,837,007
その他未払費用	2,364	2,219
流動負債合計	39,139,832	6,376,396
負債合計	39,139,832	6,376,396
純資産の部		
元本等		
元本	1,918,727,939	1,775,209,411
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△614,368,770	△550,361,478
（分配準備積立金）	89,062,799	90,033,327
元本等合計	1,304,359,169	1,224,847,933
純資産合計	1,304,359,169	1,224,847,933
負債純資産合計	1,343,499,001	1,231,224,329

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	前期 自　2023年12月13日 至　2024年 6月12日	当期 自　2024年 6月13日 至　2024年12月12日
営業収益		
受取利息	4,481	29,909
有価証券売買等損益	177,146,221	50,859,952

	前期 自　2023年12月13日 至　2024年 6月12日	当期 自　2024年 6月13日 至　2024年12月12日
為替差損益	△136,796,639	2,477,401
営業収益合計	40,354,063	53,367,262
営業費用		
支払利息	711	-
受託者報酬	371,695	348,969
委託者報酬	12,266,005	11,516,163
その他費用	204,800	245,134
営業費用合計	12,843,211	12,110,266
営業利益又は営業損失（△）	27,510,852	41,256,996
経常利益又は経常損失（△）	27,510,852	41,256,996
当期純利益又は当期純損失（△）	27,510,852	41,256,996
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（△）	1,235,003	349,831
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△691,338,373	△614,368,770
剰余金増加額又は欠損金減少額	88,550,536	59,138,130
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	88,550,536	59,138,130
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,447,222	14,095,125
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,447,222	14,095,125
分配金	23,409,560	21,942,878
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△614,368,770	△550,361,478

（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、2024年 6月13日から2024年12月12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 2024年 6月12日現在	当期 2024年12月12日現在
１．　特定期間の末日における受益権の総数 1,918,727,939口	１．　特定期間の末日における受益権の総数 1,775,209,411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　614,368,770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　550,361,478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　0.6798円 (10,000口当たり純資産額)　(6,798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　0.6900円 (10,000口当たり純資産額)　(6,900円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2023年12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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高利回り社債オープン 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　126,085,369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高利回り社債オープン 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　123,622,174円

２.分配金の計算過程

2023年12月13日から2024年 1月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,108,098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	174,722,138円
分配準備積立金額	D	84,130,959円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	265,961,195円
当ファンドの期末残存口数	F	2,004,591,130口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,326円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	4,009,182円

2024年 1月13日から2024年 2月13日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,562,718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	172,473,455円
分配準備積立金額	D	85,615,768円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	263,651,941円
当ファンドの期末残存口数	F	1,974,899,079口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,334円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,949,798円

2024年 2月14日から2024年 3月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,035,130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	170,908,618円
分配準備積立金額	D	86,145,865円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	262,089,613円
当ファンドの期末残存口数	F	1,954,699,772口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,340円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,909,399円

2024年 3月13日から2024年 4月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,281,268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	168,766,194円
分配準備積立金額	D	85,829,460円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	259,876,922円
当ファンドの期末残存口数	F	1,927,497,135口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,348円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,854,994円

2024年 4月13日から2024年 5月13日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,686,172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	168,612,466円
分配準備積立金額	D	86,998,966円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	261,297,604円
当ファンドの期末残存口数	F	1,924,366,289口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,357円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,848,732円

2024年 5月14日から2024年 6月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,152,124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	168,987,047円
分配準備積立金額	D	87,748,130円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	261,887,301円
当ファンドの期末残存口数	F	1,918,727,939口

２.分配金の計算過程

2024年 6月13日から2024年 7月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,902,050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	165,516,378円
分配準備積立金額	D	87,075,717円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	258,494,145円
当ファンドの期末残存口数	F	1,878,116,274口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,376円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,756,232円

2024年 7月13日から2024年 8月13日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,370,751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	163,584,472円
分配準備積立金額	D	87,366,087円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	256,321,310円
当ファンドの期末残存口数	F	1,850,079,360口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,385円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,700,158円

2024年 8月14日から2024年 9月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	6,438,521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	164,110,855円
分配準備積立金額	D	88,567,188円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	259,116,564円
当ファンドの期末残存口数	F	1,850,329,479口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,400円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,700,658円

2024年 9月13日から2024年10月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,258,407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	162,130,425円
分配準備積立金額	D	89,935,607円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	257,324,439円
当ファンドの期末残存口数	F	1,826,022,978口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,409円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,652,045円

2024年10月16日から2024年11月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,571,024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	159,860,337円
分配準備積立金額	D	89,061,350円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	253,492,711円
当ファンドの期末残存口数	F	1,791,683,841口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,414円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,583,367円

2024年11月13日から2024年12月12日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,513,112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	158,546,783円
分配準備積立金額	D	89,070,633円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	252,130,528円
当ファンドの期末残存口数	F	1,775,209,411口

10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,364円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,837,455円

10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,420円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,550,418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12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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。	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 2024年 6月12日現在	当期 2024年12月12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12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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12月13日 至 2024年 6月12日		当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12日	
期首元本額	2,152,091,049円	期首元本額	1,918,727,939円
期中追加設定元本額	46,031,511円	期中追加設定元本額	45,162,343円
期中一部解約元本額	279,394,621円	期中一部解約元本額	188,680,871円

２ 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2023年12月13日 至 2024年 6月12日	当期 自 2024年 6月13日 至 2024年12月12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	18,273,360	△1,672,755
合計	18,273,360	△1,672,755

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(2024年 6月12日現在)				当期(2024年12月12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	1,244,011,540	－	1,274,099,253	△30,087,713	1,162,010,599	－	1,162,321,451	△310,852
米ドル	1,244,011,540	－	1,274,099,253	△30,087,713	1,162,010,599	－	1,162,321,451	△310,852
合計	1,244,011,540	－	1,274,099,253	△30,087,713	1,162,010,599	－	1,162,321,451	△310,852

（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。

①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。

②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12月12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12月12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	高利回り社債オープン　マザーファンド	214,455,641	1,196,748,259	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：97.7%	214,455,641	1,196,748,259 100.0%	
合計				1,196,748,259	

(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。

（参考）

「野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）」および「野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり」は「高利回り社債オープン　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。

高利回り社債オープン　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2024年12月12日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	63,105,981
コール・ローン	371,739,802
株式	403,641,732
新株予約権証券	748,588
社債券	41,693,269,849
未収入金	384,854,731
未収利息	701,429,256
前払費用	17,103,779
流動資産合計	43,635,893,718
資産合計	43,635,893,718
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,840
未払金	309,531,182
未払解約金	167,137,000
流動負債合計	476,704,022
負債合計	476,704,022
純資産の部	
元本等	
元本	7,734,033,289
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	35,425,156,407
元本等合計	43,159,189,696
純資産合計	43,159,189,696
負債純資産合計	43,635,893,718

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	株式 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 新株予約権証券 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 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。 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.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。

（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12月12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	5.5804円
(10,000口当たり純資産額)	(55,804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 2024年 6月13日
至 2024年12月12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、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。
当ファンドは、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12月12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
株式
（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。
新株予約権証券
（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。
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。
派生商品評価勘定
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。
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12月12日現在	
期首	2024年 6月13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	8,259,126,263円
同期中における追加設定元本額	422,136,330円
同期中における一部解約元本額	947,229,304円
期末元本額	7,734,033,289円
期末元本額の内訳＊	
高利回り社債オープン	3,768,804,918円
高利回り社債オープン・為替ヘッジ	959,304,193円
野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）	2,380,215,839円
野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり	214,455,641円
高利回り社債オープン・為替ヘッジ（年１回決算型）	51,824,316円
高利回り社債オープン（年１回決算型）	72,556,566円
野村米国ハイ・イールド・ファンド（年１回決算型）	176,689,292円
野村米国ハイ・イールド・ファンド（年１回決算型）為替ヘッジあり	24,073,424円
ラップ専用・米国ハイ・イールド債券アクティブ	76,586,479円
高利回り社債オープンＶＡ（適格機関投資家専用）	9,522,621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12月12日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	

株式	米ドル	CARNELIAN POINT HOLDINGS COM	528	3.28	1,735.53	
		CARNELIAN POINT HOLDINGS LP A1 B COM	91,702	3.28	301,424.47	
		CURO GROUP HOLDINGS LLC COMMON SHS	3,572	5.00	17,860.00	
		ENDO GUC TRUST-CL A	80,870	0.32	26,084.09	
		ENDO INC	9,335	23.52	219,559.20	
		INTELSAT SA/LUXEMBOURG COMMON	5,715	30.00	171,450.00	
		TPC HOLDINGS INC COM	2,392	35.00	83,720.00	
		CLOUD PEAK ENERGY INC	1,250	0.00	0.00	
		GULFPORT ENERGY CORP	1,832	179.25	328,386.00	
		UC HOLDINGS INC	43,025	4.00	172,100.00	
		DIRECTBUY HOLDINGS INC	4,851	0.00	0.00	
		MALLINCKRODT PLC	306	78.00	23,868.00	
		DIEBOLD NIXDORF INC	5,690	49.38	280,972.20	
		TALEN ENERGY CORP	4,847	210.73	1,021,408.31	
	小計	銘柄数：14 組入時価比率：0.9%			2,648,567.80 (403,641,732) 100.0%	
合計					403,641,732 (403,641,732)	

(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。

(2)株式以外の有価証券(2024年12月12日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	米ドル	CHPPR HOLDINGS 1145 DOT WARR	140.00	4,900.00	
		CHPPR HOLDINGS TRANCHE 1 WARR	778.00	0.00	
		CHPPR HOLDINGS TRANCHE 2 WARR	368.00	0.00	
		CURO GROUP HOLDINGS LLC WRT	6,241.00	0.00	
		INTELSAT SA/LUXEMBOURG WARRANT	8.00	12.00	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.0%	7,535.00	4,912.00 (748,588) 0.0%	
	合計			748,588 (748,588)	
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	800,000.00	773,165.44	
		1011778 BC / NEW RED FIN	800,000.00	732,708.32	
		1839688 ALBERTA ULC	145,376.00	0.00	
		AAR ESCROW ISSUER LLC	150,000.00	154,227.75	
		ACRISURE LLC / FIN INC	325,000.00	338,820.30	
		ACRISURE LLC / FIN INC	500,000.00	476,877.30	
		ACRISURE LLC / FIN INC	275,000.00	289,760.35	
		ACRISURE LLC / FIN INC	375,000.00	386,762.25	

		ACUSHNET CO	100,000.00	104,361.33
		ADAMS HOMES INC	1,050,000.00	1,108,304.40
		ADIENT GLOBAL HOLDINGS	225,000.00	235,532.47
		ADT SEC CORP	425,000.00	400,491.05
		ADVANCED DRAINAGE SYSTEM	275,000.00	278,904.45
		AES CORP/THE	175,000.00	181,445.19
		AES CORP/THE	75,000.00	74,683.30
		AETHON UN/AETHIN UN FIN	325,000.00	337,657.45
		AFFINITY GAMING	525,000.00	407,605.69
		AIR CANADA	300,000.00	292,182.09
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	400,000.00	406,255.84
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	250,000.00	229,761.77
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	425,000.00	408,934.06
		ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000.00	211,190.56
		ALLEGHENY TECHNOLOGIES	500,000.00	484,566.35
		ALLEGHENY TECHNOLOGIES	327,000.00	313,819.21
		ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR	275,000.00	96,475.50
		ALLIANT HOLD / CO-ISSUER	100,000.00	102,249.12
		ALLIED UNIVERSAL	1,000,000.00	922,186.10
		ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	650,000.00	655,686.20
		ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	750,000.00	769,576.50
		ALLY FINANCIAL INC	150,000.00	154,246.44
		ALPHA GENERATION LLC	175,000.00	177,685.72
		ALTA EQUIPMENT GROUP	150,000.00	144,611.25
		ALTAGAS LTD	25,000.00	25,562.82
		ALTICE FINANCING SA	200,000.00	186,496.90
		ALTICE FINANCING SA	800,000.00	641,658.64
		ALTICE FRANCE HOLDING SA	1,100,000.00	316,602.44
		ALTICE FRANCE HOLDING SA	600,000.00	161,301.24
		ALTICE FRANCE SA	525,000.00	405,045.79
		ALTICE FRANCE SA	800,000.00	618,170.48
		AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	336,000.00	341,290.82
		AMC NETWORKS INC	50,000.00	53,339.25
		AMC NETWORKS INC	575,000.00	443,578.86
		AMENTUM ESCROW CORP	300,000.00	309,561.12
		AMERICAN AIRLINES INC	225,000.00	231,951.51
		AMERICAN AIRLINES INC	450,000.00	477,843.30
		AMERICAN ELECTRIC POWER	175,000.00	182,299.60
		AMERICAN ELECTRIC POWER	125,000.00	130,771.87
		AMERITEX HOLDCO INTERMED	350,000.00	374,067.57
		AMN HEALTHCARE INC	200,000.00	191,943.30
		AMN HEALTHCARE INC	375,000.00	342,561.71
			100,000.00	101,938.05

		AMWINS GROUP INC			
		ANTERO MIDSTREAM PART/FI	225,000.00	230,725.62	
		ANYWHERE REAL EST	558,800.00	520,787.79	
		APH/APH2/APH3/AQUARIAN	700,000.00	708,288.00	
		ARCHES BUYER INC	375,000.00	350,423.21	
		ARCOSA INC	100,000.00	103,777.40	
		ARD FINANCE SA	1,622,686.00	232,547.13	
		ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	400,000.00	225,310.00	
		ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	400,000.00	225,310.00	
		ARKO CORP	150,000.00	138,940.89	
		ARSENAL AIC PARENT LLC	225,000.00	237,458.92	
		ASCENT RESOURCES/ARU FIN	352,000.00	425,543.36	
		ASCENT RESOURCES/ARU FIN	350,000.00	358,116.22	
		ASCENT RESOURCES/ARU FIN	125,000.00	125,438.12	
		ASHTON WOODS USA/FINANCE	300,000.00	301,922.70	
		ASHTON WOODS USA/FINANCE	250,000.00	235,802.37	
		ASHTON WOODS USA/FINANCE	300,000.00	279,438.96	
		ASSUREDPARTNERS INC	225,000.00	227,111.89	
		ASSUREDPARTNERS INC	125,000.00	135,300.62	
		ASTON MARTIN CAPITAL HOL	200,000.00	196,169.94	
		ATHENAHEALTH GROUP INC	1,125,000.00	1,071,036.67	
		ATI INC	175,000.00	183,051.92	
		ATLANTICA SUSTAIN INFRA	325,000.00	309,155.53	
		ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI	400,000.00	380,676.16	
		AUSTIN BIDCO INC	625,000.00	604,908.31	
		AVANTOR FUNDING INC	900,000.00	839,563.74	
		AVIENT CORP	275,000.00	285,124.67	
		AVIENT CORP	725,000.00	734,059.60	
		AVIS BUDGET CAR/FINANCE	625,000.00	594,927.43	
		AVIS BUDGET CAR/FINANCE	275,000.00	287,984.40	
		AZORRA FINANCE	175,000.00	177,175.95	
		B&G FOODS INC	100,000.00	103,578.60	
		BAFFINLAND IRON CORP/LP	750,000.00	702,509.17	
		BALDWIN INSUR GRP/FIN	200,000.00	206,257.04	
		BARCLAYS PLC	200,000.00	211,128.60	
		BARCLAYS PLC	200,000.00	223,979.20	
		BASIC ENERGY ESCROW	200,000.00	2,500.00	
		BAUSCH & LOMB ESCROW COR	450,000.00	471,982.50	
		BAUSCH HEALTH AMERICAS	250,000.00	210,202.50	
		BAUSCH HEALTH COS INC	300,000.00	278,128.50	
		BAUSCH HEALTH COS INC	725,000.00	703,010.75	
		BAUSCH HEALTH COS INC	75,000.00	47,531.25	
		BAUSCH HEALTH COS INC	725,000.00	429,888.09	

		BAYTEX ENERGY CORP	775,000.00	798,998.10	
		BCPE ULYSSES INTERMEDIAT	275,000.00	270,130.98	
		BEACON ROOFING SUPPLY IN	775,000.00	798,238.37	
		BEAZER HOMES USA	425,000.00	435,078.45	
		BEAZER HOMES USA	100,000.00	102,321.70	
		BELRON UK FINANCE PLC	200,000.00	200,718.00	
		BIG RIVER STEEL/BRS FIN	230,000.00	231,907.39	
		BLACKSTONE MORTGAGE TR	75,000.00	77,241.63	
		BLOCK INC	475,000.00	489,722.15	
		BLUE RACER MID LLC/FINAN	100,000.00	103,215.80	
		BLUE RACER MID LLC/FINAN	50,000.00	52,215.10	
		BOEING CO	225,000.00	240,167.11	
		BOEING CO	375,000.00	410,255.58	
		BOEING CO	150,000.00	164,646.66	
		BOMBARDIER INC	850,000.00	852,005.15	
		BOMBARDIER INC	200,000.00	210,294.00	
		BOMBARDIER INC	175,000.00	191,045.80	
		BOMBARDIER INC	150,000.00	157,112.10	
		BOMBARDIER INC	200,000.00	206,951.00	
		BORR IHC LTD / BORR FIN	185,365.85	185,344.06	
		BORR IHC LTD / BORR FIN	190,291.26	191,104.75	
		BOYD GAMING CORP	700,000.00	658,662.13	
		BRAND INDUSTRIAL SERVICE	225,000.00	234,140.40	
		BREAD FINANCIAL HLDGS	225,000.00	242,969.64	
		BRINK'S CO/THE	225,000.00	230,531.40	
		BRINK'S CO/THE	300,000.00	308,634.90	
		BRISTOW GROUP INC	850,000.00	847,210.89	
		BUCKEYE PARTNERS LP	300,000.00	308,133.60	
		BUILDERS FIRSTSOURCE INC	400,000.00	387,931.40	
		BUILDERS FIRSTSOURCE INC	575,000.00	524,138.49	
		BUILDERS FIRSTSOURCE INC	550,000.00	564,062.07	
		BUILDERS FIRSTSOURCE INC	275,000.00	280,708.61	
		CAESARS ENTERTAIN INC	200,000.00	189,330.14	
		CALDERYS FINANCING II	200,000.00	206,264.20	
		CALIFORNIA BUYER/ATLANTI	300,000.00	301,422.30	
		CALIFORNIA RESOURCES CRP	575,000.00	591,367.49	
		CALPINE CORP	275,000.00	266,586.23	
		CALPINE CORP	300,000.00	288,597.96	
		CALPINE CORP	325,000.00	309,264.05	
		CARNIVAL CORP	2,250,000.00	2,256,601.50	
		CARNIVAL CORP	375,000.00	377,440.12	
		CARNIVAL CORP	200,000.00	214,947.20	

		CARPENTER TECHNOLOGY	300,000.00	302,508.60	
		CASTLE US HOLDING CORP	379,000.00	176,235.00	
		CATALENT PHARMA SOLUTION	550,000.00	548,998.28	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	525,000.00	483,031.60	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	125,000.00	112,360.93	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000.00	104,188.06	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	400,000.00	361,173.64	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	2,811,000.00	2,485,722.88	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	275,000.00	238,451.40	
		CCO HLDGS LLC/CAP CORP	675,000.00	568,144.12	
		CDI ESCROW ISSUER INC	375,000.00	372,915.26	
		CEMEX SAB DE CV	200,000.00	197,830.58	
		CHAMP ACQUISITION CORP	75,000.00	77,821.80	
		CHAMPIONS FINANCING INC	150,000.00	149,028.15	
		CHART INDUSTRIES INC	325,000.00	340,410.52	
		CHART INDUSTRIES INC	400,000.00	432,624.00	
		CHEMOURS CO	50,000.00	49,257.42	
		CHEMOURS CO	725,000.00	691,524.43	
		CHEMOURS CO	150,000.00	151,017.66	
		CHESAPEAKE ESCROW ISSUER	150,000.00	150,253.63	
		CHOBANI HOLDCO II LLC	50,000.00	53,613.86	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	525,000.00	510,240.93	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	325,000.00	301,083.90	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	525,000.00	422,235.81	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	625,000.00	467,638.06	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	575,000.00	492,053.60	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	825,000.00	671,460.07	
		CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	575,000.00	606,591.07	
		CIENA CORP	600,000.00	555,439.86	
		CIMPRESS PLC	150,000.00	151,603.65	
		CINEMARK USA INC	150,000.00	156,161.55	
		CITGO PETROLEUM CORP	575,000.00	575,394.45	
		CITGO PETROLEUM CORP	325,000.00	336,823.17	
		CITIGROUP INC	625,000.00	624,191.75	
		CITIGROUP INC	325,000.00	318,161.61	
		CIVITAS RESOURCES INC	925,000.00	977,808.34	
		CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO	1,150,000.00	1,028,620.95	
		CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO	250,000.00	260,189.85	
		CLEARWAY ENERGY OP LLC	346,000.00	335,587.68	
		CLEARWAY ENERGY OP LLC	255,000.00	227,452.91	
		CLEARWAY ENERGY OP LLC	150,000.00	131,783.62	
		CLEVELAND-CLIFFS INC	200,000.00	200,703.40	
		CLEVELAND-CLIFFS INC	275,000.00	259,978.04	

		CLEVELAND-CLIFFS INC	225,000.00	227,211.07	
		CLEVELAND-CLIFFS INC	200,000.00	184,348.04	
		CLEVELAND-CLIFFS INC	175,000.00	179,949.63	
		CLOUD PEAK ENRGY	1,400,000.00	0.00	
		CLOUD SOFTWARE GRP INC	900,000.00	924,030.54	
		CLOUD SOFTWARE GRP INC	600,000.00	626,059.32	
		CLYDESDALE ACQUISITION	50,000.00	50,679.65	
		CLYDESDALE ACQUISITION	75,000.00	76,175.77	
		CLYDESDALE ACQUISITION	225,000.00	227,354.31	
		CNT PRNT/CDK GLO II/FIN	100,000.00	102,406.10	
		CNX RESOURCES CORP	425,000.00	422,685.36	
		COEUR MINING INC	400,000.00	383,082.60	
		COGENT COMMS GRP / FIN	125,000.00	125,975.51	
		COINBASE GLOBAL INC	740,000.00	673,969.80	
		COINBASE GLOBAL INC	525,000.00	455,810.56	
		COMMSCOPE INC	350,000.00	289,187.50	
		COMMSCOPE TECH FINANCE L	400,000.00	397,500.00	
		COMSTOCK RESOURCES INC	500,000.00	472,091.60	
		CONCENTRA ESCROW ISSUER	275,000.00	282,964.90	
		CONNECT FINCO SARL/CONNE	200,000.00	186,252.38	
		CONSTELLIUM SE	250,000.00	248,636.67	
		COTY/HFC PRESTIGE/INT US	400,000.00	410,866.48	
		CP ATLAS BUYER INC	1,338,000.00	1,217,288.18	
		CPI CG INC	125,000.00	134,312.25	
		CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN	750,000.00	726,708.90	
		CRESCENT ENERGY FINANCE	375,000.00	376,095.30	
		CRESCENT ENERGY FINANCE	125,000.00	123,744.91	
		CROCS INC	475,000.00	444,557.86	
		CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	174,656.68	
		CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	199,287.00	
		CSC HOLDINGS LLC	400,000.00	400,742.32	
		CSC HOLDINGS LLC	750,000.00	446,426.62	
		CSC HOLDINGS LLC	500,000.00	363,743.90	
		CSC HOLDINGS LLC	600,000.00	446,892.00	
		CUSHMAN & WAKEFIELD US	100,000.00	108,459.80	
		CVS HEALTH CORP	75,000.00	75,542.40	
		CVS HEALTH CORP	125,000.00	126,640.08	
		DARLING INGREDIENTS INC	350,000.00	350,269.25	
		DAVITA INC	175,000.00	179,323.79	
		DELEK LOG PART/FINANCE	900,000.00	940,177.62	
		DELUXE CORP	100,000.00	102,508.75	
		DIAMOND FRGN/DIAMOND FIN	75,000.00	78,341.10	

		DIGICEL GROUP HOLDINGS	263,973.86	13,198.69	
		DIGICEL GROUP HOLDINGS	6,124.82	3,062.41	
		DIGICEL GROUP HOLDINGS	752,435.00	7,524.35	
		DIRECTV FINANCING LLC	175,000.00	174,211.78	
		DIRECTV HOLDINGS/FING	950,000.00	936,409.01	
		DISH DBS CORP	275,000.00	233,969.03	
		DISH DBS CORP	925,000.00	842,417.20	
		DISH DBS CORP	400,000.00	293,232.32	
		DISH DBS CORP	975,000.00	639,514.49	
		DISH NETWORK CORP	350,000.00	374,379.91	
		DORNOCH DEBT MERGER SUB	1,225,000.00	972,292.30	
		DREAM FINDERS HOMES INC	175,000.00	185,348.80	
		ECHOSTAR CORP	550,000.00	595,448.92	
		EDGEWELL PERSONAL CARE	625,000.00	617,881.68	
		ELECTRICITE DE FRANCE SA	200,000.00	227,209.80	
		ELLUCIAN HOLDINGS INC	150,000.00	152,974.06	
		EMERALD DEBT MERGER	675,000.00	686,765.25	
		EMPIRE COMMUNITIES CORP	225,000.00	239,384.02	
		EMRLD BOR / EMRLD CO-ISS	100,000.00	102,803.30	
		ENBRIDGE INC	25,000.00	26,136.05	
		ENCINO ACQUISITION PARTN	25,000.00	26,496.87	
		ENCORE CAPITAL GROUP INC	200,000.00	214,775.50	
		ENCORE CAPITAL GROUP INC	200,000.00	212,922.26	
		ENDO FINANCE HOLDINGS	200,000.00	215,391.80	
		ENERFLEX LTD	270,000.00	282,591.99	
		ENERGEAN ISRAEL FINANCE	200,000.00	186,329.00	
		ENERGEAN ISRAEL FINANCE	200,000.00	178,076.50	
		ENERGY TRANSFER LP	50,000.00	53,262.25	
		ENERGY TRANSFER LP	225,000.00	230,051.92	
		ENERSYS	75,000.00	76,347.82	
		ENLINK MIDSTREAM PARTNER	850,000.00	813,452.21	
		ENLINK MIDSTREAM PARTNER	200,000.00	178,456.40	
		ENOVA INTERNATIONAL INC	50,000.00	52,496.52	
		EQM MIDSTREAM PARTNERS L	175,000.00	179,018.35	
		EQM MIDSTREAM PARTNERS L	200,000.00	216,975.00	
		EQM MIDSTREAM PARTNERS L	350,000.00	369,082.00	
		EQUIPMENTSHARE.COM INC	625,000.00	660,559.37	
		EQUIPMENTSHARE.COM INC	175,000.00	180,676.65	
		ESC GCB ENDO LUX	400,000.00	0.00	
		ESC PAR PHARMAC	361,000.00	0.00	
		EXELA INTERMED/EXELA FIN	291,882.00	48,890.23	
		FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	500,000.00	493,865.55	
		FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	350,000.00	325,466.61	

		FERTITTA ENTERTAINMENT	300,000.00	283,593.42	
		FIESTA PURCHASER INC	25,000.00	26,355.75	
		FIESTA PURCHASER INC	125,000.00	132,985.00	
		FIRST QUANTUM MINERALS L	200,000.00	214,377.20	
		FIRSTCASH INC	325,000.00	331,528.08	
		FLUTTER TREASURY DAC	200,000.00	204,804.88	
		FMG RESOURCES AUG 2006	675,000.00	625,182.30	
		FMG RESOURCES AUG 2006	150,000.00	152,445.00	
		FOCUS FINANCIAL PARTNERS	175,000.00	177,613.69	
		FORESTAR GROUP INC	15,000.00	14,675.16	
		FORESTAR GROUP INC	650,000.00	632,752.05	
		FORTREA HOLDINGS INC	900,000.00	919,825.20	
		FORTRESS INTERMEDIATE	75,000.00	77,882.62	
		FORTRESS TRANS & INFRAST	450,000.00	445,135.05	
		FORTRESS TRANS & INFRAST	50,000.00	53,206.39	
		FORTRESS TRANS & INFRAST	200,000.00	207,351.60	
		FORTRESS TRANS & INFRAST	325,000.00	336,416.92	
		FORTRESS TRANS & INFRAST	325,000.00	320,442.33	
		FOUNDATION BUILDING M	1,075,000.00	967,468.39	
		FOXTROT ESCROW ISSUER	325,000.00	318,586.58	
		FREEDOM MORTGAGE	525,000.00	526,682.10	
		FREEDOM MORTGAGE CORP	375,000.00	410,306.62	
		FREEDOM MORTGAGE CORP	375,000.00	420,245.25	
		FREEDOM MORTGAGE HOLD	525,000.00	548,486.03	
		FREEDOM MORTGAGE HOLD	400,000.00	417,968.32	
		FRONT RANGE BIDCO INC	325,000.00	307,013.36	
		FRONTIER COMMUNICATIONS	775,000.00	767,075.62	
		FRONTIER COMMUNICATIONS	450,000.00	454,816.66	
		FRONTIER COMMUNICATIONS	274,333.00	274,824.60	
		GARDA WORLD SECURITY	175,000.00	181,994.75	
		GARDA WORLD SECURITY	150,000.00	154,808.10	
		GATES CORPORATION	75,000.00	77,347.27	
		GENESEE & WYOMING INC	400,000.00	405,460.00	
		GENESIS ENERGY LP/FIN	350,000.00	354,496.80	
		GENESIS ENERGY LP/FIN	350,000.00	362,445.30	
		GENESIS ENERGY LP/FIN	250,000.00	249,354.37	
		GENESIS ENERGY LP/FIN	200,000.00	199,719.06	
		GENON ESCROW CORP	1,798,000.00	0.00	
		GEO GROUP INC/THE	175,000.00	185,564.97	
		GEO GROUP INC/THE	350,000.00	382,167.20	
		GFL ENVIRONMENTAL INC	425,000.00	442,009.35	
		GGAM FINANCE LTD	150,000.00	155,593.50	

		GGAM FINANCE LTD	100,000.00	102,564.40	
		GGAM FINANCE LTD	225,000.00	224,576.43	
		GLATFELTER	625,000.00	564,522.93	
		GLOBAL AUTO HO/AAG FH UK	200,000.00	202,981.00	
		GO DADDY OPCO/FINCO	250,000.00	248,580.20	
		GOAT HOLDCO LLC	125,000.00	125,000.00	
		GOEASY LTD	125,000.00	133,641.25	
		GOEASY LTD	425,000.00	440,836.22	
		GOEASY LTD	225,000.00	230,808.71	
		GOODYEAR TIRE & RUBBER	325,000.00	300,388.69	
		GOTO GROUP INC	339,570.00	289,907.88	
		GOTO GROUP INC	468,930.00	192,261.30	
		GPS HOSPITALITY HOLDING	575,000.00	356,427.43	
		GRAFTECH GLOBAL ENTERPRI	825,000.00	768,281.25	
		GRAPHIC PACKAGING INTERN	100,000.00	101,986.00	
		GRAY ESCROW II INC	800,000.00	463,934.48	
		GREAT CANADIAN GAMING CO	150,000.00	156,782.67	
		GREYSTAR REAL ESTATE PAR	675,000.00	717,786.22	
		GRIFOLS SA	275,000.00	254,604.68	
		GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	275,000.00	279,468.20	
		GTCR W-2 MERGER SUB LLC	800,000.00	850,388.80	
		GULFPORT ENERGY CORP	150,000.00	152,998.35	
		HAH GROUP HOLDING CO LLC	75,000.00	76,655.38	
		HANESBRANDS INC	400,000.00	428,663.36	
		HARVEST MIDSTREAM I LP	350,000.00	358,602.65	
		HARVEST MIDSTREAM I LP	200,000.00	206,365.60	
		HAT HOLDINGS I LLC/HAT	1,039,000.00	925,833.78	
		HAWKER BEECHCRAFT ESCROW	200,000.00	0.00	
		HELIX ENERGY SOLUTIONS	400,000.00	430,971.08	
		HELLAS II	1,700,000.00	0.00	
		HERC HOLDINGS INC	175,000.00	179,639.95	
		HERTZ CORP/THE	100,000.00	107,511.60	
		HERTZ CORP/THE	225,000.00	155,695.18	
		HESS MIDSTREAM OPERATION	125,000.00	128,052.00	
		HESS MIDSTREAM OPERATION	150,000.00	148,083.19	
		HIGHTOWER HOLDING LLC	125,000.00	133,010.25	
		HILCORP ENERGY I/HILCORP	498,000.00	492,099.64	
		HILCORP ENERGY I/HILCORP	250,000.00	236,760.22	
		HILCORP ENERGY I/HILCORP	550,000.00	577,782.15	
		HILCORP ENERGY I/HILCORP	275,000.00	268,261.70	
		HILTON DOMESTIC OPERATIN	725,000.00	669,443.54	
		HILTON DOMESTIC OPERATIN	300,000.00	267,446.46	
		HILTON DOMESTIC OPERATIN	450,000.00	454,044.87	

		HILTON GRAND VAC BOR ESC	465,000.00	442,873.85	
		HLF FIN SARL LLC/HERBALI	675,000.00	500,380.67	
		HOWARD MIDSTREAM ENERGY	375,000.00	398,760.37	
		HOWARD MIDSTREAM ENERGY	350,000.00	363,661.55	
		HOWDEN UK REFINANCE / US	200,000.00	204,723.60	
		HUB INTERNATIONAL LTD	550,000.00	572,626.45	
		HUB INTERNATIONAL LTD	225,000.00	231,983.55	
		HUDSON AUTOMOTIVE GROUP	25,000.00	26,409.75	
		HUSKY INJECTION / TITAN	150,000.00	156,972.90	
		IAMGOLD CORP	575,000.00	564,466.23	
		ICAHN ENTERPRISES/FIN	565,000.00	562,582.70	
		ICAHN ENTERPRISES/FIN	350,000.00	338,867.13	
		ICAHN ENTERPRISES/FIN	175,000.00	180,003.77	
		ICAHN ENTERPRISES/FIN	350,000.00	301,632.03	
		ICAHN ENTERPRISES/FIN	125,000.00	128,115.33	
		IHEARTCOMMUNICATIONS INC	550,000.00	430,375.00	
		IHO VERWALTUNGS GMBH	550,000.00	533,979.21	
		IHO VERWALTUNGS GMBH	400,000.00	401,125.00	
		IHO VERWALTUNGS GMBH	400,000.00	401,360.76	
		ILFC E-CAPITAL TRUST I	850,000.00	704,090.44	
		ILIAD HOLDING SAS	400,000.00	408,936.00	
		ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	214,039.42	
		ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	203,058.02	
		IMOLA MERGER CORP	600,000.00	575,317.38	
		INEOS FINANCE PLC	200,000.00	207,791.40	
		INNOPHOS HOLDINGS INC	1,275,000.00	1,283,405.56	
		INSIGHT ENTERPRS	100,000.00	102,106.37	
		ION TRADING TECHNOLOGIES	200,000.00	210,004.40	
		IRIS HOLDINGS INC	325,000.00	324,957.36	
		IRON MOUNTAIN INC	100,000.00	99,053.11	
		IRON MOUNTAIN INC	300,000.00	310,006.20	
		IRON MOUNTAIN INC	390,000.00	377,318.44	
		IRON MOUNTAIN INC	550,000.00	538,493.28	
		IRON MOUNTAIN INC	175,000.00	176,659.35	
		IRON MOUNTAIN INFO MGMT	575,000.00	542,703.45	
		JACOBS ENTERTAINMENT INC	250,000.00	243,928.47	
		JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	600,000.00	590,659.08	
		JANE STREET GRP/JSG FIN	275,000.00	277,132.90	
		JB POINDEXTER & CO INC	200,000.00	213,087.80	
		JEFFERIES FIN LLC / JFIN	325,000.00	306,161.18	
		JEFFERIES FIN LLC / JFIN	200,000.00	201,768.00	
		JEFFERSON CAPITAL HOLDIN	325,000.00	346,265.07	

		JELD-WEN INC	175,000.00	171,479.00	
		JETBLUE AIRWAYS/LOYALTY	275,000.00	293,040.63	
		JPMORGAN CHASE & CO	375,000.00	374,194.23	
		KAISER ALUMINUM CORP	269,000.00	259,459.00	
		KAISER ALUMINUM CORP	750,000.00	681,400.12	
		KB HOME	350,000.00	339,981.53	
		KB HOME	150,000.00	155,098.35	
		KB HOME	350,000.00	318,261.12	
		KEHE DIST/FIN / NEXTWAVE	675,000.00	705,134.02	
		KINETIK HOLDINGS LP	325,000.00	325,178.10	
		KNIFE RIVER HOLD CO	375,000.00	394,166.62	
		KRAKEN OIL & GAS PARTNER	250,000.00	246,704.05	
		KROGER CO	75,000.00	74,064.86	
		L BRANDS INC	150,000.00	153,268.95	
		L BRANDS INC	950,000.00	996,040.80	
		LABL INC	300,000.00	269,619.90	
		LABL INC	50,000.00	50,304.00	
		LADDER CAP FIN LLLP/CORP	175,000.00	168,476.45	
		LADDER CAP FIN LLLP/CORP	150,000.00	156,124.47	
		LAREDO PETROLEUM INC	325,000.00	326,256.45	
		LATAM AIRLINES GROUP SA	250,000.00	255,537.50	
		LBM ACQUISITION LLC	425,000.00	398,996.71	
		LCM INVESTMENTS HOLDINGS	200,000.00	210,621.00	
		LD HOLDINGS GROUP LLC	850,000.00	744,109.04	
		LEEWARD RENEWABL	625,000.00	578,346.87	
		LEVEL 3 FINANCING INC	900,000.00	835,812.00	
		LEVEL 3 FINANCING INC	1,400,000.00	1,155,000.00	
		LGI HOMES INC	275,000.00	293,877.37	
		LGI HOMES INC	595,000.00	545,655.99	
		LGI HOMES INC	100,000.00	102,335.00	
		LIFE TIME INC	650,000.00	653,788.85	
		LIFEPOINT HEALTH INC	175,000.00	191,010.05	
		LIFEPOINT HEALTH INC	275,000.00	305,923.20	
		LIFEPOINT HEALTH INC	400,000.00	418,955.20	
		LIGHT & WONDER INTER	125,000.00	130,716.52	
		LIGHTNING POWER LLC	300,000.00	314,448.30	
		LINDBLAD EXPEDITIONS LLC	150,000.00	150,625.65	
		LITHIA MOTORS INC	712,000.00	661,019.80	
		MACQUARIE AIRFINANCE HLD	150,000.00	157,876.95	
		MACQUARIE AIRFINANCE HLD	125,000.00	131,251.62	
		MACY'S RETAIL HLDGS LLC	75,000.00	71,972.28	
		MACY'S RETAIL HLDGS LLC	700,000.00	546,469.49	
		MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN	400,000.00	401,254.40	

		MAJORDRIVE HOLDINGS IV L	525,000.00	465,739.36	
		MANITOWOC COMPANY INC	175,000.00	183,809.50	
		MASTERBRAND INC	100,000.00	103,131.24	
		MATADOR RESOURCES CO	375,000.00	383,632.50	
		MATADOR RESOURCES CO	75,000.00	75,314.77	
		MATADOR RESOURCES CO	250,000.00	248,755.12	
		MATCH GROUP HLD II LLC	420,000.00	365,733.81	
		MATIV HOLDINGS INC	125,000.00	125,591.75	
		MATTAMY GROUP CORP	525,000.00	496,540.80	
		MATTHEWS INTERNATIONAL C	275,000.00	288,902.07	
		MAV ACQUISITION CORP	525,000.00	532,862.92	
		MCGRAW-HILL EDUCATION	100,000.00	104,225.90	
		MEDLINE BORROWER/MEDL CO	175,000.00	178,617.07	
		MELCO RESORTS FINANCE	200,000.00	203,948.20	
		MERISANT ESCROW	600,000.00	0.00	
		MERLIN ENTERTAINMENTS GR	200,000.00	195,021.44	
		METHANEX US OPERATIONS	175,000.00	176,162.87	
		METIS MERGER SUB LLC	1,392,000.00	1,345,137.20	
		MGM CHINA HOLDINGS LTD	200,000.00	194,259.56	
		MGM RESORTS INTL	275,000.00	278,435.30	
		MIDCONTINENT COMMUNICATI	150,000.00	156,086.25	
		MIDWEST VANADIUM PTY LTD	139,736.16	0.00	
		MINERAL RESOURCES LTD	225,000.00	237,541.27	
		MITER BRAND / MIWD BORR	225,000.00	230,343.07	
		MOLINA HEALTHCARE INC	1,125,000.00	997,988.28	
		MOLINA HEALTHCARE INC	125,000.00	125,992.32	
		MOTION BONDCO DAC	600,000.00	571,119.30	
		MOZART DEBT MERGER SUB	850,000.00	801,263.04	
		MOZART DEBT MERGER SUB	675,000.00	661,989.03	
		MPH ACQUISITION HOLDINGS	75,000.00	53,119.69	
		MPT OPER PARTNERSP/FINL	700,000.00	503,130.60	
		MPT OPER PARTNERSP/FINL	575,000.00	364,070.22	
		MRT MID PART/MRT MID FIN	375,000.00	409,243.12	
		MURPHY OIL CORP	250,000.00	245,146.17	
		MURPHY OIL USA INC	250,000.00	224,589.65	
		NABORS INDUSTRIES INC	83,000.00	86,345.97	
		NABORS INDUSTRIES INC	350,000.00	333,996.49	
		NATIONSTAR MTG HLD INC	225,000.00	225,217.19	
		NATIONSTAR MTG HLD INC	425,000.00	417,414.72	
		NATIONSTAR MTG HLD INC	475,000.00	479,809.37	
		NATIONSTAR MTG HLD INC	200,000.00	190,780.00	
		NATIONSTAR MTG HLD INC	150,000.00	146,682.16	

		NATIONSTAR MTG HLD INC	250,000.00	259,545.50	
		NAVIENT CORP	525,000.00	505,779.90	
		NAVIENT CORP	375,000.00	414,608.62	
		NAVIENT CORP	250,000.00	285,231.00	
		NCL CORPORATION LTD	1,100,000.00	1,103,493.60	
		NCL CORPORATION LTD	275,000.00	287,817.20	
		NCL CORPORATION LTD	175,000.00	185,754.10	
		NCL FINANCE LTD	350,000.00	356,088.25	
		NCR ATLEOS ESCROW CORP	575,000.00	630,897.70	
		NCR CORP	375,000.00	364,468.08	
		NEPTUNE BIDCO US INC	825,000.00	777,930.12	
		NEW ENTERPRISE STONE & L	675,000.00	691,091.66	
		NEW ENTERPRISE STONE & L	425,000.00	412,828.12	
		NEW FORTRESS ENERGY INC	75,000.00	65,130.93	
		NEW HOME CO INC/THE	150,000.00	158,487.36	
		NEWELL BRANDS INC	100,000.00	103,392.23	
		NEWS CORP	300,000.00	281,583.12	
		NEWS CORP	350,000.00	339,787.21	
		NEXTERA ENERGY OPERATING	775,000.00	805,913.20	
		NFE FINANCING LLC	350,000.00	371,266.31	
		NGL ENERGY PARTNERS LP	225,000.00	228,889.57	
		NGL ENERGY PARTNERS LP	275,000.00	280,023.70	
		NOBLE FINANCE II LLC	400,000.00	409,731.68	
		NORTHERN OIL AND GAS INC	200,000.00	210,469.20	
		NORTHRIVER MIDSTREAM FIN	325,000.00	332,823.72	
		NORTHWEST ACQ/DOMINION	475,000.00	574.75	
		NORTONLIFELOCK INC	525,000.00	535,860.15	
		NORTONLIFELOCK INC	425,000.00	440,817.65	
		NOVA CHEMICALS CORP	275,000.00	292,672.60	
		NOVA CHEMICALS CORP	400,000.00	432,988.20	
		NOVA CHEMICALS CORP	225,000.00	229,520.72	
		NOVELIS CORP	800,000.00	760,980.00	
		NRG ENERGY INC	250,000.00	279,471.00	
		NRG ENERGY INC	450,000.00	441,185.85	
		NRG ENERGY INC	375,000.00	371,699.51	
		NRG ENERGY INC	225,000.00	224,077.41	
		NRG ENERGY INC	250,000.00	274,115.45	
		NRG ENERGY INC	175,000.00	175,346.32	
		NUSTAR LOGISTICS LP	625,000.00	641,600.00	
		OCEANEERING INTL INC	150,000.00	148,593.58	
		OLYMPUS WTR US HLDG CORP	325,000.00	307,805.29	
		OLYMPUS WTR US HLDG CORP	900,000.00	958,818.60	
		OLYMPUS WTR US HLDG CORP	250,000.00	243,716.90	

		OLYMPUS WTR US HLDG CORP	200,000.00	207,259.00	
		ONEMAIN FINANCE CORP	400,000.00	426,236.40	
		ONEMAIN FINANCE CORP	125,000.00	128,380.93	
		ONEMAIN FINANCE CORP	575,000.00	609,567.27	
		ONEMAIN FINANCE CORP	254,000.00	230,676.17	
		ONEMAIN FINANCE CORP	300,000.00	314,365.80	
		ONEMAIN FINANCE CORP	275,000.00	284,358.80	
		OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	700,000.00	644,856.03	
		OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	450,000.00	408,451.45	
		OPTICS BIDCO S P A	867,000.00	850,352.90	
		ORGANON & CO/ORGANON FOR	200,000.00	203,267.46	
		ORGANON FINANCE 1 LLC	400,000.00	366,782.84	
		OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	122,000.00	120,478.91	
		OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	450,000.00	426,294.40	
		OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	250,000.00	264,135.25	
		OWENS & MINOR INC	500,000.00	484,356.05	
		OWENS-BROCKWAY	550,000.00	549,775.71	
		OWENS-BROCKWAY	200,000.00	201,008.00	
		OWENS-BROCKWAY	50,000.00	49,438.63	
		PANTHER ESCROW ISSUER	350,000.00	358,407.35	
		PARK INTERMED HOLDINGS	150,000.00	154,446.15	
		PARK RIVER HOLDINGS INC	725,000.00	634,267.26	
		PARK-OHIO INDUSTRIES INC	371,000.00	368,301.42	
		PARKLAND CORP/CANADA	925,000.00	872,939.98	
		PARKLAND CORP/CANADA	475,000.00	445,293.12	
		PATTERN ENERGY OP LP/PAT	525,000.00	499,685.49	
		PBF HOLDING CO LLC	275,000.00	275,857.25	
		PEBBLEBROOK HOTEL/FINANC	100,000.00	101,011.82	
		PENNYMAC FIN SVCS INC	625,000.00	587,278.37	
		PENNYMAC FIN SVCS INC	150,000.00	158,910.46	
		PENNYMAC FIN SVCS INC	250,000.00	256,661.75	
		PENNYMAC FIN SVCS INC	150,000.00	145,553.82	
		PERFORMANCE FOOD GROUP I	225,000.00	228,497.17	
		PERMIAN RESOURC OPTG LLC	700,000.00	721,710.50	
		PERRIGO FINANCE UNLIMITE	100,000.00	100,333.00	
		PG&E CORP	150,000.00	147,934.72	
		PG&E CORP	462,000.00	455,344.15	
		PG&E CORP	100,000.00	103,776.50	
		PHH ESCROW ISSUER LLC	125,000.00	125,726.25	
		PHINIA INC	50,000.00	51,609.30	
		PHINIA INC	175,000.00	177,356.90	
		PICARD MIDCO INC	600,000.00	595,385.70	

		PIKE CORP	125,000.00	133,949.98	
		PLANET FINANCIAL GROUP	100,000.00	102,695.14	
		PLAYTIKA HOLDING CORP	750,000.00	699,292.87	
		PM GENERAL PURCHASER LLC	250,000.00	247,217.97	
		POST HOLDINGS INC	525,000.00	481,426.78	
		POST HOLDINGS INC	150,000.00	152,949.30	
		POST HOLDINGS INC	325,000.00	326,130.90	
		POST HOLDINGS INC	100,000.00	100,193.35	
		PRA GROUP INC	175,000.00	181,012.12	
		PRA GROUP INC	175,000.00	183,672.47	
		PRAIRIE ACQUIROR LP	200,000.00	208,734.80	
		PRECISION DRILLING CORP	215,000.00	215,746.05	
		PREMIER ENTERTAINMENT SU	475,000.00	343,999.75	
		PREMIER ENTERTAINMENT SU	475,000.00	310,165.50	
		PRIME SECSRVC BRW/FINANC	300,000.00	300,216.69	
		PRIMO WATER HOLDINGS INC	400,000.00	378,713.64	
		QUICKEN LOANS LLC/QUICKN	800,000.00	738,447.52	
		RAIN CARBON INC	725,000.00	774,247.07	
		RAISING CANE'S RESTAURAN	175,000.00	188,235.42	
		RAKUTEN GROUP INC	200,000.00	202,078.74	
		RAKUTEN GROUP INC	200,000.00	219,314.26	
		RAKUTEN GROUP INC	200,000.00	220,059.04	
		RAND PARENT LLC	325,000.00	330,073.90	
		RAVEN ACQUISITION HOLDIN	675,000.00	676,228.09	
		REALOGY GROUP/CO-ISSUER	975,000.00	848,363.00	
		REALOGY GROUP/CO-ISSUER	14,000.00	11,313.40	
		RESIDEO FUNDING INC	325,000.00	332,069.07	
		RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	100,000.00	103,831.90	
		RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	300,000.00	306,176.40	
		RITCHIE BROS AUCTIONEERS	700,000.00	743,064.70	
		RITHM CAPITAL CORP	225,000.00	226,891.30	
		ROCKET SOFTWARE INC	425,000.00	442,312.71	
		ROCKETMTGE CO-ISSUER INC	775,000.00	667,830.21	
		ROYAL CARIBBEAN CRUISES	50,000.00	47,837.17	
		ROYAL CARIBBEAN CRUISES	775,000.00	776,422.28	
		ROYAL CARIBBEAN CRUISES	325,000.00	324,705.74	
		ROYAL CARIBBEAN CRUISES	175,000.00	179,575.72	
		ROYAL CARIBBEAN CRUISES	475,000.00	482,215.72	
		RR DONNELLEY & SONS CO	150,000.00	154,394.40	
		RR DONNELLEY & SONS CO	200,000.00	201,887.20	
		RRD INTERMEDIATE HLDS	250,000.00	235,241.25	
		RYAN SPECIALTY	250,000.00	251,847.50	
		SABLE INTL FINANCE LTD	200,000.00	199,066.00	

		SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	175,000.00	178,654.52	
		SANCHEZ ENERGY CORP	2,182,000.00	40,912.50	
		SANCHEZ ENERGY CORP	1,425,000.00	26,718.75	
		SATURN OIL & GAS INC	122,000.00	122,323.91	
		SCIENTIFIC GAMES INTERNA	225,000.00	226,073.47	
		SCIH SALT HOLDINGS INC	1,210,000.00	1,175,071.41	
		SCIL IV LLC / SCIL USA H	700,000.00	694,569.47	
		SEADRILL FINANCE LTD	400,000.00	409,341.12	
		SEALED AIR CORP	75,000.00	75,890.77	
		SEALED AIR CORP	75,000.00	73,113.81	
		SEALED AIR CORP	125,000.00	128,564.27	
		SEALED AIR/SEALED AIR US	125,000.00	130,859.62	
		SEASPAN CORP	700,000.00	666,561.63	
		SELECT MEDICAL CORP	125,000.00	123,898.17	
		SERVICE CORP INTL	275,000.00	274,016.84	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	181,000.00	176,766.35	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	250,000.00	240,412.12	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	200,000.00	191,788.26	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	125,000.00	101,715.77	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	425,000.00	333,353.38	
		SFA ISSUER LLC	575,000.00	575,000.00	
		SHEA HOMES LP/FNDG CP	200,000.00	194,512.28	
		SHELF DRILL HOLD LTD	439,000.00	378,696.54	
		SIGMA HOLDCO BV	173,000.00	171,920.61	
		SINCLAIR TELEVISION GROU	275,000.00	193,531.25	
		SIRIUS XM RADIO INC	1,200,000.00	1,120,251.00	
		SIRIUS XM RADIO INC	475,000.00	463,548.41	
		SIRIUS XM RADIO INC	75,000.00	64,825.31	
		SM ENERGY CO	175,000.00	175,449.75	
		SM ENERGY CO	175,000.00	175,426.82	
		SMYRNA READY MIX CONCRET	500,000.00	534,491.50	
		SOTERA HEALTH HLDGS LLC	275,000.00	281,041.47	
		SOUTH BOW CAN INFRA HOLD	125,000.00	129,910.75	
		SPECIALTY BUILDING PRODU	225,000.00	232,031.92	
		SPECTRUM BRANDS INC	60,000.00	51,981.21	
		SPIRIT AEROSYSTEMS INC	225,000.00	214,836.07	
		SPIRIT AEROSYSTEMS INC	275,000.00	297,278.30	
		SPIRIT AEROSYSTEMS INC	225,000.00	250,872.75	
		SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP	600,000.00	481,500.00	
		SPRINGLEAF FINANCE CORP	415,000.00	424,601.44	
		SRM ESCROW ISSUER LLC	425,000.00	421,933.58	
		SS&C TECHNOLOGIES INC	875,000.00	872,579.31	

		SS&C TECHNOLOGIES INC	400,000.00	411,897.64	
		STANDARD INDUSTR INC/NJ	700,000.00	710,982.29	
		STANDARD INDUSTRIES INC	100,000.00	98,571.69	
		STANDARD INDUSTRIES INC	775,000.00	722,360.60	
		STAPLES INC	375,000.00	370,727.73	
		STAPLES INC	615,045.00	506,383.76	
		STAR HOLDING LLC	150,000.00	146,167.06	
		STAR PARENT INC	625,000.00	652,381.18	
		STARWOOD PROPERTY TRUST	275,000.00	285,808.32	
		STARWOOD PROPERTY TRUST	325,000.00	322,890.84	
		STENA INTERNATIONAL SA	200,000.00	206,358.20	
		STENA INTERNATIONAL SA	200,000.00	208,980.40	
		STL HOLDING CO LLC	200,000.00	212,113.20	
		STUDIO CITY CO LTD	200,000.00	200,971.00	
		STUDIO CITY FINANCE LTD	300,000.00	274,696.11	
		SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	175,000.00	187,078.81	
		SUMMIT MIDSTREAM HOLDING	200,000.00	208,560.12	
		SUNNOVA ENERGY CORP	325,000.00	281,950.56	
		SUNOCO LP	125,000.00	129,759.37	
		SUNOCO LP	125,000.00	131,467.76	
		SUNOCO LP/FINANCE CORP	425,000.00	426,136.45	
		SUNOCO LP/FINANCE CORP	200,000.00	206,246.20	
		SURGERY CENTER HOLDINGS	225,000.00	231,742.46	
		SYNCHRONY FINANCIAL	425,000.00	449,173.91	
		TALEN ENERGY SUPPLY LLC	250,000.00	269,022.25	
		TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	225,000.00	230,083.65	
		TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	450,000.00	431,996.22	
		TALOS PRODUCTION INC	200,000.00	207,936.40	
		TALOS PRODUCTION INC	200,000.00	208,854.50	
		TEINE ENERGY LTD	625,000.00	613,004.37	
		TELECOM ITALIA CAPITAL	19,000.00	18,910.55	
		TELESAT CANADA/TELESAT L	425,000.00	257,125.00	
		TELESAT CANADA/TELESAT L	675,000.00	285,246.69	
		TENET HEALTHCARE CORP	290,000.00	282,159.85	
		TENET HEALTHCARE CORP	1,050,000.00	1,053,203.76	
		TENET HEALTHCARE CORP	625,000.00	590,420.25	
		TENET HEALTHCARE CORP	475,000.00	478,230.95	
		TENET HEALTHCARE CORP	275,000.00	282,892.03	
		TENNECO INC	325,000.00	308,494.61	
		TEREX CORP	175,000.00	175,354.72	
		TERRAFORM POWER OPERATIN	1,100,000.00	1,032,964.90	
		THOR INDUSTRIES	225,000.00	207,405.99	
		TOPS HOLDING II ESCROW	1,191,000.00	0.00	

		TRANSALTA CORP	550,000.00	578,990.50	
		TRANSDIGM INC	800,000.00	795,216.56	
		TRANSDIGM INC	475,000.00	483,599.40	
		TRANSDIGM INC	900,000.00	857,150.82	
		TRANSDIGM INC	350,000.00	356,562.18	
		TRANSDIGM INC	550,000.00	526,430.41	
		TRANSDIGM INC	200,000.00	208,955.40	
		TRANSDIGM INC	200,000.00	206,204.80	
		TRANSDIGM INC	275,000.00	276,874.23	
		TRANSOCEAN AQUILA LTD	136,153.84	139,744.89	
		TRANSOCEAN INC	343,000.00	342,891.13	
		TRANSOCEAN INC	148,750.00	154,663.25	
		TRANSOCEAN INC	575,000.00	476,111.21	
		TRANSOCEAN INC	425,000.00	386,484.37	
		TRANSOCEAN SEDCO FOREX	375,000.00	351,081.67	
		TRANSOCEAN TITAN FIN LTD	100,000.00	102,700.30	
		TRIDENT TPI HOLDINGS INC	500,000.00	554,673.50	
		TRINITY INDUSTRIES INC	450,000.00	469,851.30	
		TRINSEO OP / TRINSEO FIN	175,000.00	109,549.12	
		TRIUMPH GROUP INC	259,000.00	271,727.51	
		TRONOX INC	675,000.00	622,118.13	
		UNICREDIT SPA	400,000.00	393,157.36	
		UNITED AIRLINES INC	350,000.00	337,989.22	
		UNITED RENTALS NORTH AM	175,000.00	163,243.55	
		UNITED RENTALS NORTH AM	100,000.00	91,911.60	
		UNITED RENTALS NORTH AM	300,000.00	269,683.38	
		UNITED WHOLESALE MTGE LL	300,000.00	298,279.89	
		UNITED WHOLESALE MTGE LL	450,000.00	436,780.17	
		UNITI GROUP/CSL CAPITAL	525,000.00	559,593.45	
		UNITI GRP/UNITI HLD/CSL	325,000.00	286,056.84	
		UNIVISION COMMUNICATIONS	225,000.00	232,279.22	
		UNIVISION COMMUNICATIONS	350,000.00	319,063.95	
		UNIVISION COMMUNICATIONS	350,000.00	341,618.51	
		UNIVISION COMMUNICATIONS	575,000.00	577,066.43	
		UPC BROADBAND FINCO BV	800,000.00	744,264.00	
		UPC HOLDING BV	400,000.00	395,815.88	
		US ACUTE CARE SOLUTIONS	450,000.00	462,944.70	
		US FOODS INC	275,000.00	267,106.04	
		US FOODS INC	150,000.00	157,614.45	
		US FOODS INC	100,000.00	99,288.17	
		USA COM PART/USA COM FIN	275,000.00	282,401.48	
		USI INC/NY	100,000.00	103,497.50	

		UWM HOLDINGS LLC	100,000.00	100,354.82	
		VALARIS LTD	600,000.00	610,302.00	
		VALLOUREC SACA	200,000.00	210,852.60	
		VELOCITY VEHICLE GROUP	100,000.00	104,964.70	
		VENTURE GLOBAL CALCASIEU	425,000.00	389,692.53	
		VENTURE GLOBAL LNG INC	300,000.00	311,488.11	
		VENTURE GLOBAL LNG INC	675,000.00	706,180.14	
		VENTURE GLOBAL LNG INC	325,000.00	362,662.10	
		VENTURE GLOBAL LNG INC	50,000.00	51,286.07	
		VENTURE GLOBAL LNG INC	675,000.00	713,819.25	
		VENTURE GLOBAL LNG INC	525,000.00	580,610.78	
		VERMILION ENERGY INC	350,000.00	351,335.60	
		VFH PARENT / VALOR CO	100,000.00	104,580.77	
		VICTORS MERGER CORP	300,000.00	186,281.61	
		VICTRA HLDG/VICTRA FIN	50,000.00	53,212.10	
		VIKING BAKED GOODS ACQUI	225,000.00	224,959.95	
		VIKING CRUISES LTD	525,000.00	569,639.70	
		VIKING OCEAN CRUISES SHI	225,000.00	222,818.58	
		VIPER ENERGY PARTNERS LP	700,000.00	695,727.55	
		VIRGIN AUSTRALIA HOLDING	209,840.39	603.29	
		VISTAJET MALTA/VM HOLDS	250,000.00	252,088.75	
		VISTAJET MALTA/XO MGMT	325,000.00	320,159.35	
		VISTAJET MALTA/XO MGMT	575,000.00	508,615.90	
		VISTRA CORP	850,000.00	861,424.17	
		VISTRA OPERATIONS CO LLC	1,000,000.00	1,063,333.30	
		VISTRA OPERATIONS CO LLC	475,000.00	492,433.92	
		VITAL ENERGY INC	225,000.00	218,847.93	
		VMED O2 UK FINAN	200,000.00	176,716.66	
		VMED O2 UK FINANCING I	600,000.00	524,782.08	
		VORTEX OPCO LLC	141,075.00	53,608.50	
		VORTEX OPCO LLC	32,400.00	33,372.00	
		WASH MULTIFAM ACQ INC	475,000.00	473,976.94	
		WATCO COS LLC/FINANCE CO	300,000.00	313,378.26	
		WAYFAIR LLC	50,000.00	51,489.14	
		WEATHERFORD INTERNATIONA	1,475,000.00	1,533,578.15	
		WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	600,000.00	577,472.58	
		WERNER FINCO LP/INC	225,000.00	248,285.02	
		WERNER FINCO LP/INC	1,103,497.00	1,115,913.65	
		WHITE CAP BUYER LLC	550,000.00	553,217.50	
		WILDFIRE INTERMEDIATE HO	100,000.00	97,329.74	
		WILLIAMS SCOTSMAN INC	100,000.00	102,165.10	
		WILSONART LLC	200,000.00	200,313.80	
		WINDSOR HOLDINGS III LLC	200,000.00	213,668.40	

		WINDSTREAM ESCROW LLC	100,000.00	105,315.02	
		WORLD ACCEPTANCE CORP	625,000.00	625,782.31	
		WR GRACE HOLDING LLC	1,075,000.00	1,010,373.47	
		WR GRACE HOLDING LLC	150,000.00	156,480.79	
		WYNN MACAU LTD	350,000.00	337,891.40	
		WYNN MACAU LTD	875,000.00	818,868.05	
		WYNN RESORTS FINANCE LLC	150,000.00	146,520.85	
		WYNN RESORTS FINANCE LLC	225,000.00	238,706.55	
		WYNN RESORTS FINANCE LLC	325,000.00	325,670.47	
		XHR LP	100,000.00	101,976.69	
		XPO INC	125,000.00	130,620.00	
		XPO INC	175,000.00	183,311.45	
		YUM! BRANDS INC	425,000.00	420,204.98	
		ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	150,000.00	154,494.60	
		ZEGONA FINANCE PLC	200,000.00	213,119.80	
		ZF NA CAPITAL	150,000.00	150,954.15	
		ZF NA CAPITAL	300,000.00	297,581.67	
		ZF NA CAPITAL	300,000.00	295,258.20	
		ZIGGO BOND CO BV	200,000.00	181,532.06	
		ZIGGO BV	200,000.00	186,034.92	
	小計	銘柄数：793 組入時価比率：96.6%	299,476,265.18	273,577,886.15 (41,693,269,849) 100.0%	
	合計			41,693,269,849 (41,693,269,849)	
合計				41,694,018,437 (41,694,018,437)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2024年12月12日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	213,296,160	－	213,332,000	△35,840
米ドル	213,296,160	－	213,332,000	△35,840
合計	213,296,160	－	213,332,000	△35,840

（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。

①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。

②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。

２ファンドの現況

純資産額計算書

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）

2024年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	13,729,934,964円
Ⅱ　負債総額	29,996,979円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,699,937,985円
Ⅳ　発行済口数	14,290,773,628口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9587円

野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジあり

2024年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,326,090,124円
Ⅱ　負債総額	1,127,074,283円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,199,015,841円
Ⅳ　発行済口数	1,760,628,634口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6810円

（参考）高利回り社債オープン　マザーファンド

2024年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	44,028,338,110円
Ⅱ　負債総額	166,260,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	43,862,078,110円
Ⅳ　発行済口数	7,653,708,820口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.7308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

2025年1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12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	917	56,554,843
単位型株式投資信託	157	657,242
追加型公社債投資信託	14	6,997,164
単位型公社債投資信託	421	763,427
合計	1,509	64,972,676

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、財務諸表等規則ならびに同規則第282条及び第306条の規定により、「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)に基づいて作成しております。

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(2023年4月1日から2024年3

月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2024年4月1日から2024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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024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			1,865		7,405
金銭の信託			42,108		44,745
有価証券			21,900		-
前払金			11		7
前払費用			775		852
未収入金			1,775		1,023
未収委託者報酬			26,116		31,788
未収運用受託報酬			3,780		5,989
短期貸付金			1,001		757
未収還付法人税等			2,083		-
その他			84		169
貸倒引当金			△15		△18
流動資産計			101,486		92,719
固定資産					
有形固定資産			1,335		945
建物	※２	906		595	
器具備品	※２	428		350	
無形固定資産			5,563		5,658
ソフトウェア		5,562		5,658	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,336		17,314
投資有価証券		1,793		1,813	
関係会社株式		10,025		9,535	
長期差入保証金		520		519	
長期前払費用		10		10	
前払年金費用		1,553		1,875	
繰延税金資産		2,340		2,651	
その他		92		908	
固定資産計			23,235		23,918
資産合計			124,722		116,638

		前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024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					
関係会社短期借入金			-		13,700
預り金			124		123
未払金			17,378		11,404

未払収益分配金		0		1	
未払償還金		57		39	
未払手数料		8,409		10,312	
関係会社未払金		8,911		1,052	
未払費用	※１		9,682		12,507
未払法人税等			1,024		8,095
未払消費税等			500		1,590
前受収益			22		15
賞与引当金			3,635		4,543
その他			46		24
流動負債計			32,414		52,005
固定負債					
退職給付引当金			2,940		2,759
時効後支払損引当金			595		602
資産除去債務			1,123		1,123
固定負債計			4,659		4,484
負債合計			37,074		56,490
(純資産の部)					
株主資本			87,419		59,820
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			56,509		28,910
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,823		28,225	
別途積立金		24,606		-	
繰越利益剰余金		31,217		28,225	
評価・換算差額等			229		327
その他有価証券評価差額金			229		327
純資産合計			87,648		60,147
負債・純資産合計			124,722		116,638

（２）損益計算書

		前事業年度 (自　2022年4月1日 至　2023年3月31日)		当事業年度 (自　2023年4月1日 至　2024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			113,491		124,722
運用受託報酬			18,198		21,188
その他営業収益			331		291
営業収益計			132,021		146,202
営業費用					
支払手数料			38,684		43,258
広告宣伝費			1,187		1,054
公告費			0		0
調査費			29,050		33,107
調査費		6,045		6,797	

委託調査費		23,004		26,310	
委託計算費			1,363		1,377
営業雑経費			3,302		3,670
通信費		89		92	
印刷費		903		820	
協会費		83		85	
諸経費		2,225		2,671	
営業費用計			73,587		82,468
一般管理費					
給料			11,316		13,068
役員報酬		226		259	
給料・手当		7,752		7,985	
賞与		3,337		4,822	
交際費			78		87
寄付金			115		117
旅費交通費			283		323
租税公課			963		990
不動産賃借料			1,232		1,235
退職給付費用			829		893
固定資産減価償却費			2,409		2,292
諸経費			12,439		12,483
一般管理費計			29,669		31,491
営業利益			28,763		32,242

		前事業年度 (自　2022年4月1日 至　2023年3月31日)		当事業年度 (自　2023年4月1日 至　2024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	7,645		7,054	
受取利息		45		48	
為替差益		49		146	
その他		637		625	
営業外収益計			8,377		7,875
営業外費用					
支払利息		-		123	
金銭の信託運用損		1,736		782	
時効後支払損引当金繰入額		10		14	
その他		8		47	
営業外費用計			1,755		967
経常利益			35,385		39,149
特別利益					
投資有価証券売却益		10		-	
株式報酬受入益		46		28	
特別利益計			57		28
特別損失					
投資有価証券売却損		16		5	

関係会社株式評価損		-		490	
固定資産除却損	※２	52		31	
特別損失計			69		527
税引前当期純利益			35,374		38,651
法人税、住民税及び事業税			8,890		10,821
法人税等調整額			419		△354
当期純利益			26,064		28,183

（３）株主資本等変動計算書

前事業年度(自　2022年4月１日　至　2023年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
		資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
						その他利益剰余金			
	資本金	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	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
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

当事業年度(自　2023年4月1日　至　2024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	31,217	56,509	87,419
当期変動額									
剰余金の配当							△55,782	△55,782	△55,782
当期純利益							28,183	28,183	28,183
別途積立金の取崩						△24,606	24,606	-	-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	―	―	―	―	―	△24,606	△2,991	△27,598	△27,598
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	-	28,225	28,910	59,820

(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
当期変動額			
剰余金の配当			△55,782
当期純利益			28,183
別途積立金の取崩			―
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	97	97	97
当期変動額合計	97	97	△27,500
当期末残高	327	327	60,147

[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 市場価格のない株式等以外のもの … 時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 … 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (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。
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業年金について、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。 ① 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。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業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業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。 ① 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。 ② 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。 ③ 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]

該当事項はありません。

［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 (2023年3月31日)	当事業年度末 (2024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　1,350百万円 ※２．有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物　901百万円 器具備品　657 合計　1,559	※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　1,939百万円 ※２．有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物　1,214百万円 器具備品　733 合計　1,948

◇　損益計算書関係

前事業年度 (自　2022年4月１日 至　2023年3月31日)	当事業年度 (自　2023年4月１日 至　2024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　7,634百万円	※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　7,050百万円
※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	※２．固定資産除却損 建物　-百万円 器具備品　0 ソフトウェア　30 合計　31

◇　株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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	前事業年度期首株式数	前事業年度増加株式数	前事業年度減少株式数	前事業年度末株式数
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

当事業年度(自　2023年4月１日　至　2024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

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

（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

2024年5月16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	28,174百万円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	5,470円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月28日

◇　金融商品関係

前事業年度（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、未払消費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（※）	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。

当事業年度（自 2023年4月１日　至 2024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

2024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	44,745	44,745	-
資産計	44,745	44,745	-
(2)その他（デリバティブ取引）	24	24	-
負債計	24	24	-

（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、未払消費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（※）	9,710
組合出資金等	1,638
合計	11,348

（※）1　市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。
2　非上場株式等について、当事業年度において490百万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	7,405	-	-	-
金銭の信託	44,745	-	-	-
未収委託者報酬	31,788	-	-	-
未収運用受託報酬	5,989	-	-	-
短期貸付金	757	-	-	-

合計	90,685	-	-	-

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）	-	44,745	-	44,745
資産計	-	44,745	-	44,745
デリバティブ取引（通貨関連）	-	24	-	24
負債計	-	24	-	24

（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 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

当事業年度 （自 2023年4月１日　至 2024年3月31日）

１．売買目的有価証券(2024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(2024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(2024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	9,428
関連会社株式	106

４．その他有価証券(2024年3月31日)

該当事項はありません。

非上場株式等（貸借対照表計上額174百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,638百万円）については、市場価格のない株式等に該当するため、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 2023年4月1日　至 2024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	36	-	5
合計	36	-	5

◇　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 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

当事業年度　（自 2023年4月１日　至 2024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	730	-	△24	△24

◇　退職給付関係

前事業年度(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

①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%

②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	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。

当事業年度(自　2023年4月1日　至　2024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	20,314 百万円
勤務費用	802
利息費用	275
数理計算上の差異の発生額	△1,024
退職給付の支払額	△1,150
その他	△11
退職給付債務の期末残高	19,205

(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	19,378 百万円
期待運用収益	455
数理計算上の差異の発生額	1,415
事業主からの拠出額	848
退職給付の支払額	△850
年金資産の期末残高	21,247

(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	16,431 百万円
年金資産	△21,247
	△4,815
非積立型制度の退職給付債務	2,774
未積立退職給付債務	△2,041
未認識数理計算上の差異	2,923
未認識過去勤務費用	1
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	883
退職給付引当金	2,759
前払年金費用	△1,875
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	883

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	802 百万円
利息費用	275
期待運用収益	△455
数理計算上の差異の費用処理額	86
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	655

(5) 年金資産に関する事項

①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	31%
株式	32%
生保一般勘定	9%
生保特別勘定	7%
その他	21%
合計	100%

②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	1.8%
退職一時金制度の割引率	1.3%
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、206百万円でした。

◇　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 (2023年3月31日)		当事業年度末 (2024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	1,138	賞与引当金	1,422
退職給付引当金	911	退職給付引当金	855
関係会社株式評価減	1,010	関係会社株式評価減	1,162
未払事業税	227	未払事業税	360
投資有価証券評価減	11	投資有価証券評価減	11
減価償却超過額	331	減価償却超過額	323
時効後支払損引当金	184	時効後支払損引当金	186
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	78	ゴルフ会員権評価減	79
資産除去債務	348	資産除去債務	348
未払社会保険料	85	未払社会保険料	116
その他	44	その他	50
繰延税金資産小計	4,878	繰延税金資産小計	5,422
評価性引当額	△1,696	評価性引当額	△1,848
繰延税金資産合計	3,181	繰延税金資産合計	3,573
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	△171	資産除去債務に対応する除去費用	△109
関係会社株式評価益	△84	関係会社株式評価益	△85
その他有価証券評価差額金	△102	その他有価証券評価差額金	△146
前払年金費用	△481	前払年金費用	△581
繰延税金負債合計	△840	繰延税金負債合計	△922
繰延税金資産の純額	2,340	繰延税金資産の純額	2,651
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	0.3%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△6.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△5.4%
タックスヘイブン税制	2.1%	タックスヘイブン税制	1.2%
外国税額控除	△0.6%	外国税額控除	△0.3%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.5%
その他	△0.8%	その他	△0.2%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.3%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.0%

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、グループ通算制度を適用しており、「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 自　2022年4月 1日 至　2023年3月31日	当事業年度 自　2023年4月 1日 至　2024年3月31日
期首残高	1,123	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加	-	-
資産除去債務の履行による減少	-	-
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 2022年4月１日　至 2023年3月31日）

区分	前事業年度 （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。

当事業年度　（自 2023年4月１日　至 2024年3月31日）

区分	当事業年度 （自　2023年4月 1日 至　2024年3月31日）
委託者報酬	124,707百万円
運用受託報酬	19,131百万円
成功報酬（注）	2,071百万円
その他営業収益	291百万円
合計	146,202百万円

（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　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

① 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。

② 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。

当事業年度(自　2023年4月１日　至　2024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

① 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。

② 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。

◇　関連当事者情報

前事業年度(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・エーエム・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出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	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。

当事業年度(自　2023年4月１日　至　2024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

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	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,493(百万円)	証券持株会社業	被所有100%	経営管理	資金の借入	141,800	短期借入金	13,700
							資金の返済	128,100		
							借入金利息	123	未払利息	19

（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・エーエム・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	2,856	短期貸付金	757
							資金の返済	3,081		
							貸付金利息	48	未収利息	9

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	―	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	30,272	未払手数料	7,148

（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　2022年4月1日 至　2023年3月31日)	当事業年度 (自　2023年4月1日 至　2024年3月31日)
１株当たり純資産額　17,016円74銭 １株当たり当期純利益　5,060円34銭	１株当たり純資産額　11,677円62銭 １株当たり当期純利益　5,471円85銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 １株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益　26,064百万円 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 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	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 １株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益　28,183百万円 普通株式に係る当期純利益　28,183百万円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株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

		2024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		5,222
金銭の信託		47,595
未収委託者報酬		35,191
未収運用受託報酬		6,723
短期貸付金		1,427
その他		1,233
貸倒引当金		△21
流動資産計		97,372
固定資産		
有形固定資産	※１	761
無形固定資産		6,247
ソフトウェア		6,246
その他		0
投資その他の資産		15,876
投資有価証券		1,503
関係会社株式		9,535
長期差入保証金		521
前払年金費用		2,189
繰延税金資産		2,020
その他		105
固定資産計		22,884
資産合計		120,257

		2024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		28,300
未払金		11,764
未払収益分配金		1
未払償還金		38
未払手数料		11,479
関係会社未払金		244
未払費用		11,699

未払法人税等		6,872
未払消費税等	※2	1,584
賞与引当金		2,843
その他		130
流動負債計		63,195
固定負債		
退職給付引当金		2,678
時効後支払損引当金		609
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,410
負債合計		67,606
(純資産の部)		
株主資本		52,360
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		21,450
利益準備金		685
その他利益剰余金		20,765
繰越利益剰余金		20,765
評価・換算差額等		290
その他有価証券評価差額金		290
純資産合計		52,651
負債・純資産合計		120,257

◇　中間損益計算書

		自　2024年4月 1日 至　2024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		75,441
運用受託報酬		11,445
その他営業収益		153
営業収益計		87,039
営業費用		
支払手数料		27,091
調査費		18,872
その他営業費用		3,159
営業費用計		49,123
一般管理費	※1	16,272
営業利益		21,643
営業外収益	※2	6,924
営業外費用	※3	285
経常利益		28,282
特別利益	※4	23

特別損失	※５	13
税引前中間純利益		28,292
法人税、住民税及び事業税		6,931
法人税等調整額		646
中間純利益		20,713

◇　中間株主資本等変動計算書
当中間会計期間(自　2024年4月1日　至　2024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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	28,225	28,910	59,820
当中間期変動額								
剰余金の配当						△28,174	△28,174	△28,174
中間純利益						20,713	20,713	20,713
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	－	－	－	－	－	△7,460	△7,460	△7,460
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	20,765	21,450	52,360

（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	327	327	60,147
当中間期変動額			
剰余金の配当			△28,174
中間純利益			20,713
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△36	△36	△36
当中間期変動額合計	△36	△36	△7,496
当中間期末残高	290	290	52,651

[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 市場価格のない株式等以外のもの … 時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 … 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (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。
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業年金について、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。 ① 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。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業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業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。 ①　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。 ②　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。 ③　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

2024年9月30日現在
※１　有形固定資産の減価償却累計額 2,133百万円 ※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「未払消費税等」として表示しております。

◇　中間損益計算書関係

自　2024年4月 1日 至　2024年9月30日	
※１　減価償却実施額	
有形固定資産	185百万円
無形固定資産	949百万円
※２　営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	6,350百万円
※３　営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	105百万円
雑損	169百万円
※４　特別利益の内訳	
株式報酬受入益	23百万円
※５　特別損失の内訳	
固定資産除却損	13百万円

◇　中間株主資本等変動計算書関係

自　2024年4月 1日
至　2024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	当中間会計期間末
普通株式	5,150,693株	―	―	5,150,693株

2　配当に関する事項

配当金支払額

2024年5月16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	28,174百万円
(2) 1株当たり配当額	5,470円
(3) 基準日	2024年3月31日
(4) 効力発生日	2024年6月28日

◇　金融商品関係

1．金融商品の時価等に関する事項

2024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	47,595	47,595	-
(2)その他（デリバティブ取引）	126	126	-
資産計	47,722	47,722	-

(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、未払消費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（※）	9,710
組合出資金等	1,328
合計	11,038

（※）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）	-	47,595	-	47,595
デリバティブ取引（通貨関連）	-	126	-	126
資産計	-	47,722	-	47,722

（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　(2024年9月30日)

1．売買目的有価証券(2024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(2024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(2024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	9,428
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2024年9月30日)

該当事項はありません。

非上場株式等（貸借対照表計上額174百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,328百万円）については、市場価格のない株式等に該当するため、記載しておりません。

◇　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　(2024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	1,550	-	126	126

◇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　2024年4月 1日 至　2024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2024年4月 1日 至2024年9月30日）
委託者報酬	75,439百万円
運用受託報酬	10,634百万円
成功報酬（注）	811百万円
その他営業収益	153百万円
合計	87,039百万円

（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　2024年4月1日　至　2024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

① 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。

② 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　2024年4月 1日 至　2024年9月30日
１株当たり純資産額　10,222円13銭 １株当たり中間純利益　4,021円58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、記載しておりません。 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　20,713百万円 普通株主に帰属しない金額　－ 普通株式に係る中間純利益　20,713百万円 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12月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

＊　2024年12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）	66,289,685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。

＊　2024年9月末現在

３資本関係

＜訂正前＞

(2024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＞

(2024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

２０２５年2月４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　　長谷川　敬

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」に掲げられている野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）の２０２４年６月１３日から２０２４年１２月１２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、野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）の２０２４年１２月１２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

２０２５年2月４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　　長谷川　敬

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」に掲げられている野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジありの２０２４年6月１３日から２０２４年１２月１２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、野村米国ハイ・イールド・ファンド（毎月決算型）為替ヘッジありの２０２４年１２月１２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

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　水　永　　真太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の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２０２４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

２０２４年１１月２７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　　長谷川　　敬

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２０２４年４月１日から２０２５年３月３１日までの第６６期事業年度の中間会計期間（２０２４年４月１日から２０２４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２０２４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（２０２４年４月１日から２０２４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に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。