

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成23年6月17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兼執行役会長 岩崎 俊博
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁 連絡場所 東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ハイ・イールド ボンド オープンAコース ハイ・イールド ボンド オープンBコース
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額(平成22年12月18日から平成23年12月16日まで) ハイ・イールド ボンド オープンAコース 1兆円を上限とする。 ハイ・イールド ボンド オープンBコース 1兆円を上限とする。 *なお、継続申込期間（以下「申込期間」といいます。）は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新され 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、平成22年12月17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。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また 第一部 証券情報、第二部 ファンド情報、第三部 委託会社等の情報 に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

第一部【証券情報】

原届出書の 第一部 証券情報 を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

追加型証券投資信託・受益権（「受益権」といいます。）

なお、平成10年11月2日現在の受益権を1対10,000の割合で再分割しており、当初元本は1口当たり1円です。

格付は取得していません。

（以下 略）

<訂正後>

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

追加型証券投資信託・受益権（「受益権」といいます。）

なお、平成10年11月2日現在の受益権を1対10,000の割合で再分割しており、当初元本は1口当たり1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（以下 略）

<訂正前>

(12) その他

（前略）

スイッチング

「ハイ・イールド ボンド オープン」を構成する「Aコース」「Bコース」間で乗換え（以下「スイッチング」といいます。）ができます。

スイッチングとは、「ハイ・イールド ボンド オープン」を構成する「Aコース」または「Bコース」のいずれかのファンドをご換金した場合の手取金をもって、そのご換金のお申込日の午後3時までに、「Aコース」または「Bコース」のもう一方のファンドの取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものをいいます。

なお、「ハイ・イールド ボンド オープンCコース」「ハイ・イールド ボンド オープンDコース」の換金代金をもって、「Aコース」「Bコース」の一般コースへのスイッチングが可能です。

スイッチングによる申込みは、「一般コース」を選択した投資者は1万口以上1万口単位または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者は1万円以上1円単位からできます。また、当該投資者が保有する「Aコース」または「Bコース」の受益権の全てをご換金した場合の手取金の全額をもって取得申込みする場合は1口単位とします。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の費用・税金がかかりますのでご注意ください。（詳しくは、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。）

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

（以下 略）

<訂正後>

(12) その他

（前略）

スイッチング

「ハイ・イールド ボンド オープン」を構成する「Aコース」「Bコース」間で乗換え(以下「スイッチング」といいます。)ができます。

スイッチングとは、「ハイ・イールド ボンド オープン」を構成する「Aコース」または「Bコース」のいずれかのファンドをご換金した場合の手取金をもって、そのご換金のお申込日の午後3時までに、「Aコース」または「Bコース」のもう一方のファンドの取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものをいいます。

なお、「ハイ・イールド ボンド オープンCコース」「ハイ・イールド ボンド オープンDコース」の換金代金をもって、「Aコース」「Bコース」の一般コースへのスイッチングが可能です。

スイッチングによる申込みは、「一般コース」を選択した投資者は1万口以上1万口単位または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者は1万円以上1円単位からできます。また、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者がスイッチングに際し、当該投資者が保有する「Aコース」または「Bコース」の受益権の全てをご換金した場合の手取金の全額をもって取得申込みする場合は1口単位とします。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の費用・税金がかかりますのでご注意ください。（詳しくは、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。）

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

（以下 略）

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

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(3) ファンドの仕組み

(図 省略)

委託会社の概況

委託会社

(中略)

・資本金の額

平成22年10月末現在、17,180百万円

(中略)

・大株主の状況(平成22年10月末現在)

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一丁目9番1号	5,150,693株	100%

<訂正後>

(3) ファンドの仕組み

(図 省略)

委託会社の概況

委託会社

(中略)

・資本金の額

平成23年4月末現在、17,180百万円

(中略)

・大株主の状況(平成23年4月末現在)

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一丁目9番1号	5,150,693株	100%

2 投資方針

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 投資方針

(前略)

[2] 業種分類を考慮した分散投資と企業調査を重視した銘柄選定を基本とします。

ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、企業調査およびクレジット分析により投資機会をとらえ、投資リスクを抑えることを目指します。

ポートフォリオによる分散投資によりリスクの低減を図ることを基本とします。

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

投資対象を40業種に分類し、1業種あたりの投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の15%以内とします。

組入債券がデフォルトした場合、速やかに売却することを基本とします。

（中略）

- [4] BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックスをベンチマークとします。

各ファンドは、以下をベンチマークとします。

Aコース	BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース) ¹
Bコース	BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース) ²

1 「BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース)」は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index (US\$ベース)をもとに、委託会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

2 「BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)」は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index (US\$ベース)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

（野村アセットマネジメントは、バンクオブアメリカ・メリルリンチより、当ファンドのベンチマークの算出にあたって同指数を用いることを許諾されております。）

ベンチマークは米国債券市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。

- [5] 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。

（以下 略）

<訂正後>

(1) 投資方針

（前略）

- [2] 業種分類を考慮した分散投資と企業調査を重視した銘柄選定を基本とします。

ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、企業調査およびクレジット分析により投資機会をとらえ、投資リスクを抑えることを目指します。

ポートフォリオによる分散投資によりリスクの低減を図ることを基本とします。

同一発行体の発行するハイ・イールド・ボンドへの投資割合は、原則として

マザーファンドの信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

組入債券がデフォルトした場合、速やかに売却することを基本とします。

（中略）

- [4] BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックスをベンチマークとします。

各ファンドは、以下をベンチマークとします。

Aコース	BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース) ¹
Bコース	BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース) ²

1 「BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース)」は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index (US\$ベース)をもとに、委託会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

2 「BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・BB-Bレイティド・コンストレインド・インデックス(円換算ベース)」は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, BB-B Rated, Constrained Index (US\$ベース)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

（野村アセットマネジメントは、バンクオブアメリカ・メリルリンチより、当ファンドのベンチマークの算出にあたって同指数を用いることを許諾されております。）

- [5] 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。

（以下 略）

<訂正前>

(3) 運用体制

ファンドの運用体制は以下の通りです。

（中略）

ファンドの運用体制等は平成22年12月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(3) 運用体制

ファンドの運用体制は以下の通りです。

（中略）

ファンドの運用体制等は平成23年6月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3 投資リスク

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(前略)

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(中略)

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

委託会社におけるリスクマネジメント体制

(中略)

投資リスクに関する管理体制等は平成22年12月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(前略)

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(中略)

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

委託会社におけるリスクマネジメント体制

(中略)

投資リスクに関する管理体制等は平成23年6月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

5 運用状況

原届出書の 第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

以下は平成23年4月28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

「Aコース」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,081,881,719	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		50,937,215	1.23
合計(純資産総額)		4,132,818,934	100.00

「Bコース」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	6,848,029,960	99.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		53,566,501	0.77
合計(純資産総額)		6,901,596,461	100.00

<ご参考>

「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アメリカ	22,554,706,522	96.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		821,386,159	3.51
合計(純資産総額)		23,376,092,681	100.00

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

「Aコース」

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資信託 受益証券	ハイ・イールド ボンド オープン マザーファンド	1,173,257,946	3.4104	4,001,278,900	3.4791	4,081,881,719	98.76

「Bコース」

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資信託 受益証券	ハイ・イールド ボンド オープン マザーファンド	1,968,333,753	3.4092	6,710,443,431	3.4791	6,848,029,960	99.22

<ご参考>

「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	5,798,000	6,279.11	364,063,377	6,320.15	366,442,876	7.25	2019/11/15	1.56
2	アメリカ	社債券	GEORGIA-PACIFIC LLC	2,450,000	9,439.20	231,260,400	9,521.28	233,271,360	8	2024/1/15	0.99
3	アメリカ	社債券	PENSKE AUTO GROUP INC	2,619,000	8,526.05	223,297,511	8,536.31	223,566,220	7.75	2016/12/15	0.95
4	アメリカ	社債券	SPRINT NEXTEL CORP	2,375,000	9,234.00	219,307,500	9,264.78	220,038,525	8.375	2017/8/15	0.94
5	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL INC	2,025,000	9,192.96	186,157,440	9,213.48	186,572,970	8	2031/11/1	0.79
6	アメリカ	社債券	TUBE CITY IMS CORP	2,150,000	8,618.40	185,295,600	8,587.62	184,633,830	9.75	2015/2/1	0.78
7	アメリカ	社債券	EL PASO CORP	1,950,000	8,204.08	159,979,653	8,632.47	168,333,296	7.42	2037/2/15	0.72
8	アメリカ	社債券	SESI LLC	1,965,000	8,413.20	165,319,380	8,423.46	165,520,989	6.875	2014/6/1	0.70
9	アメリカ	社債券	AGY HOLDING CORP	1,950,000	7,879.68	153,653,760	8,033.58	156,654,810	11	2014/11/15	0.67
10	アメリカ	社債券	STEINWAY MUSICAL INSTRUM	1,850,000	8,351.64	154,505,340	8,372.16	154,884,960	7	2014/3/1	0.66
11	アメリカ	社債券	SUPERVALU INC	1,825,000	8,249.04	150,544,980	8,454.24	154,289,880	7.5	2014/11/15	0.66
12	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL	1,675,000	9,090.36	152,263,530	9,172.44	153,638,370	8	2020/3/15	0.65
13	アメリカ	社債券	SNOQUALMIE ENT AUTH	1,800,000	8,208.00	147,744,000	8,259.30	148,667,400	9.125	2015/2/1	0.63
14	アメリカ	社債券	HCA INC	1,625,000	8,986.65	146,033,145	8,987.76	146,051,100	7.875	2020/2/15	0.62
15	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	1,450,000	9,424.41	136,654,052	9,728.17	141,058,477	8.125	2020/1/15	0.60
16	アメリカ	社債券	QUICKSILVER RESOURCE	1,700,000	8,166.96	138,838,320	8,249.04	140,233,680	7.125	2016/4/1	0.59
17	アメリカ	社債券	BAKER & TAYLOR INC	1,950,000	7,140.96	139,248,720	7,182.00	140,049,000	11.5	2013/7/1	0.59
18	アメリカ	社債券	FORD MOTOR COMPANY	1,650,000	8,519.83	140,577,197	8,413.20	138,817,800	9.5	2011/9/15	0.59
19	アメリカ	社債券	SGS INTERNATIONAL INC	1,575,000	8,474.76	133,477,470	8,495.28	133,800,660	12	2013/12/15	0.57
20	アメリカ	社債券	CIT GROUP INC	1,600,000	8,249.04	131,984,640	8,300.34	132,805,440	7	2016/5/1	0.56
21	アメリカ	社債券	CATALYST PAPER C	1,535,000	8,372.16	128,512,656	8,290.08	127,252,728	11	2016/12/15	0.54
22	アメリカ	社債券	CIT GROUP INC	1,500,000	8,187.55	122,813,308	8,419.07	126,286,153	5.25	2014/4/1	0.54
23	アメリカ	社債券	LUCENT TECHNOLOGIES	1,604,000	7,099.91	113,882,716	7,530.83	120,794,673	6.45	2029/3/15	0.51
24	アメリカ	社債券	P.H. GLATFELTER	1,425,000	8,454.24	120,472,920	8,454.24	120,472,920	7.125	2016/5/1	0.51
25	アメリカ	社債券	CABLEVISION SYSTEMS CORP	1,300,000	9,223.74	119,908,620	9,254.52	120,308,760	8.625	2017/9/15	0.51
26	アメリカ	社債券	SABINE PASS LNG LP	1,400,000	8,433.72	118,072,080	8,515.80	119,221,200	7.25	2013/11/30	0.51
27	アメリカ	社債券	CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,325,000	8,905.68	118,000,260	8,987.76	119,087,820	6.5	2017/8/15	0.50
28	アメリカ	社債券	SMITHFIELD FOODS INC	1,200,000	9,695.70	116,348,400	9,747.00	116,964,000	10	2014/7/15	0.50
29	アメリカ	社債券	METROPCS WIRELESS INC	1,300,000	8,772.30	114,039,900	8,890.29	115,573,770	7.875	2018/9/1	0.49
30	アメリカ	社債券	FTI CONSULTING INC	1,330,000	8,597.88	114,351,804	8,669.70	115,307,010	7.75	2016/10/1	0.49

種類別及び業種別投資比率

「Aコース」

種類	業種	投資比率(%)
投資信託受益証券		98.76
合計		98.76

「Bコース」

種類	業種	投資比率(%)
投資信託受益証券		99.22
合計		99.22

<ご参考>

「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
社債券		96.48
合計		96.48

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)運用実績

純資産の推移

平成23年4月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。
「Aコース」

計算期間	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13期 (2001年9月28日)	15,008	15,247	0.8137	0.8267
第14期 (2002年3月28日)	14,954	15,366	0.8701	0.8941
第15期 (2002年9月30日)	14,227	14,613	0.8108	0.8328
第16期 (2003年3月28日)	14,418	14,847	0.8406	0.8656
第17期 (2003年9月29日)	15,841	16,281	0.8757	0.9000
第18期 (2004年3月29日)	14,777	15,153	0.9008	0.9237
第19期 (2004年9月28日)	13,277	13,589	0.8982	0.9193
第20期 (2005年3月28日)	11,863	12,071	0.8909	0.9065
第21期 (2005年9月28日)	11,931	12,079	0.8819	0.8929
第22期 (2006年3月28日)	10,557	10,632	0.8784	0.8846
第23期 (2006年9月28日)	9,150	9,192	0.8675	0.8714
第24期 (2007年3月28日)	7,186	7,225	0.8908	0.8956
第25期 (2007年9月28日)	6,146	6,187	0.8666	0.8724
第26期 (2008年3月28日)	5,137	5,217	0.7990	0.8114
第27期 (2008年9月29日)	4,062	4,167	0.7450	0.7642
第28期 (2009年3月30日)	3,070	3,188	0.5926	0.6154
第29期 (2009年9月28日)	3,538	3,655	0.7292	0.7534
第30期 (2010年3月29日)	3,437	3,545	0.7705	0.7948
第31期 (2010年9月28日)	4,193	4,320	0.7943	0.8183
第32期 (2011年3月28日)	4,051	4,171	0.8257	0.8502
2010年4月末日	4,427		0.7882	
5月末日	4,273		0.7684	
6月末日	4,276		0.7756	
7月末日	4,323		0.7992	
8月末日	4,276		0.8017	
9月末日	4,205		0.7964	
10月末日	4,219		0.8177	
11月末日	4,101		0.8118	
12月末日	4,128		0.8197	
2011年1月末日	4,189		0.8388	
2月末日	4,187		0.8485	
3月末日	4,062		0.8267	
4月末日	4,132		0.8359	

「Bコース」

計算期間	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13期 (2001年9月28日)	22,203	23,115	0.8279	0.8619
第14期 (2002年3月28日)	24,105	25,013	0.9820	1.0190
第15期 (2002年9月30日)	21,678	22,499	0.8451	0.8771
第16期 (2003年3月28日)	25,043	25,975	0.8597	0.8917
第17期 (2003年9月29日)	37,170	38,519	0.8326	0.8628
第18期 (2004年3月29日)	42,768	44,147	0.8124	0.8386
第19期 (2004年9月28日)	45,118	46,495	0.8523	0.8783
第20期 (2005年3月28日)	42,301	43,575	0.8104	0.8348
第21期 (2005年9月28日)	41,259	42,458	0.8501	0.8748
第22期 (2006年3月28日)	33,211	34,189	0.8694	0.8950
第23期 (2006年9月28日)	28,638	29,477	0.8662	0.8916
第24期 (2007年3月28日)	23,773	24,482	0.8923	0.9189
第25期 (2007年9月28日)	19,463	20,085	0.8485	0.8756
第26期 (2008年3月28日)	14,003	14,541	0.6707	0.6965
第27期 (2008年9月29日)	13,074	13,554	0.6702	0.6948
第28期 (2009年3月30日)	8,943	9,372	0.4882	0.5116
第29期 (2009年9月28日)	9,178	9,526	0.5458	0.5665
第30期 (2010年3月29日)	9,187	9,478	0.5995	0.6185
第31期 (2010年9月28日)	7,672	7,938	0.5636	0.5831
第32期 (2011年3月28日)	6,948	7,169	0.5675	0.5855
2010年4月末日	9,416		0.6231	
5月末日	8,797		0.5901	
6月末日	8,426		0.5780	
7月末日	8,305		0.5844	
8月末日	7,920		0.5723	
9月末日	7,673		0.5617	
10月末日	7,433		0.5577	
11月末日	7,529		0.5766	
12月末日	7,150		0.5635	
2011年1月末日	7,263		0.5814	
2月末日	7,254		0.5853	
3月末日	7,116		0.5790	
4月末日	6,901		0.5781	

分配の推移

「Aコース」

期	1口当たりの分配金
第13期	0.0130 円
第14期	0.0240 円
第15期	0.0220 円
第16期	0.0250 円
第17期	0.0243 円
第18期	0.0229 円
第19期	0.0211 円
第20期	0.0156 円
第21期	0.0110 円
第22期	0.0062 円
第23期	0.0039 円
第24期	0.0048 円
第25期	0.0058 円
第26期	0.0124 円
第27期	0.0192 円
第28期	0.0228 円
第29期	0.0242 円
第30期	0.0243 円
第31期	0.0240 円
第32期	0.0245 円

「Bコース」

期	1口当たりの分配金
第13期	0.0340 円
第14期	0.0370 円
第15期	0.0320 円
第16期	0.0320 円
第17期	0.0302 円
第18期	0.0262 円
第19期	0.0260 円
第20期	0.0244 円
第21期	0.0247 円
第22期	0.0256 円
第23期	0.0254 円
第24期	0.0266 円
第25期	0.0271 円
第26期	0.0258 円
第27期	0.0246 円
第28期	0.0234 円
第29期	0.0207 円
第30期	0.0190 円
第31期	0.0195 円
第32期	0.0180 円

収益率の推移

「Aコース」

期	収益率
第13期	2.8 %
第14期	9.9 %
第15期	4.3 %
第16期	6.8 %
第17期	7.1 %
第18期	5.5 %
第19期	2.1 %
第20期	0.9 %
第21期	0.2 %
第22期	0.3 %
第23期	0.8 %
第24期	3.2 %
第25期	2.1 %
第26期	6.4 %
第27期	4.4 %
第28期	17.4 %
第29期	27.1 %
第30期	9.0 %
第31期	6.2 %
第32期	7.0 %

「Bコース」

期	収益率
第13期	3.0 %
第14期	23.1 %
第15期	10.7 %
第16期	5.5 %
第17期	0.4 %
第18期	0.7 %
第19期	8.1 %
第20期	2.1 %
第21期	7.9 %
第22期	5.3 %
第23期	2.6 %
第24期	6.1 %
第25期	1.9 %
第26期	17.9 %
第27期	3.6 %
第28期	23.7 %
第29期	16.0 %
第30期	13.3 %
第31期	2.7 %
第32期	3.9 %

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配の額、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

「Aコース」

期	設定口数	解約口数	発行済み口数
第13期	475,070,448	2,667,966,705	18,443,824,216
第14期	1,132,927,061	2,390,642,914	17,186,108,363
第15期	1,781,312,121	1,419,925,520	17,547,494,964
第16期	990,377,051	1,384,349,188	17,153,522,827
第17期	2,557,544,442	1,620,212,975	18,090,854,294
第18期	1,220,603,225	2,907,193,176	16,404,264,343
第19期	593,295,835	2,214,586,753	14,782,973,425
第20期	405,133,269	1,870,925,015	13,317,181,679
第21期	1,416,216,228	1,204,448,955	13,528,948,952
第22期	114,144,934	1,624,304,044	12,018,789,842
第23期	79,307,657	1,549,928,541	10,548,168,958
第24期	52,766,499	2,534,078,383	8,066,857,074
第25期	59,554,417	1,034,354,629	7,092,056,862
第26期	29,814,503	692,405,147	6,429,466,218
第27期	27,137,147	1,002,975,251	5,453,628,114
第28期	85,201,603	357,860,222	5,180,969,495
第29期	63,094,538	392,230,343	4,851,833,690
第30期	42,270,101	433,123,435	4,460,980,356
第31期	1,304,979,322	485,684,164	5,280,275,514
第32期	40,352,651	413,908,646	4,906,719,519

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

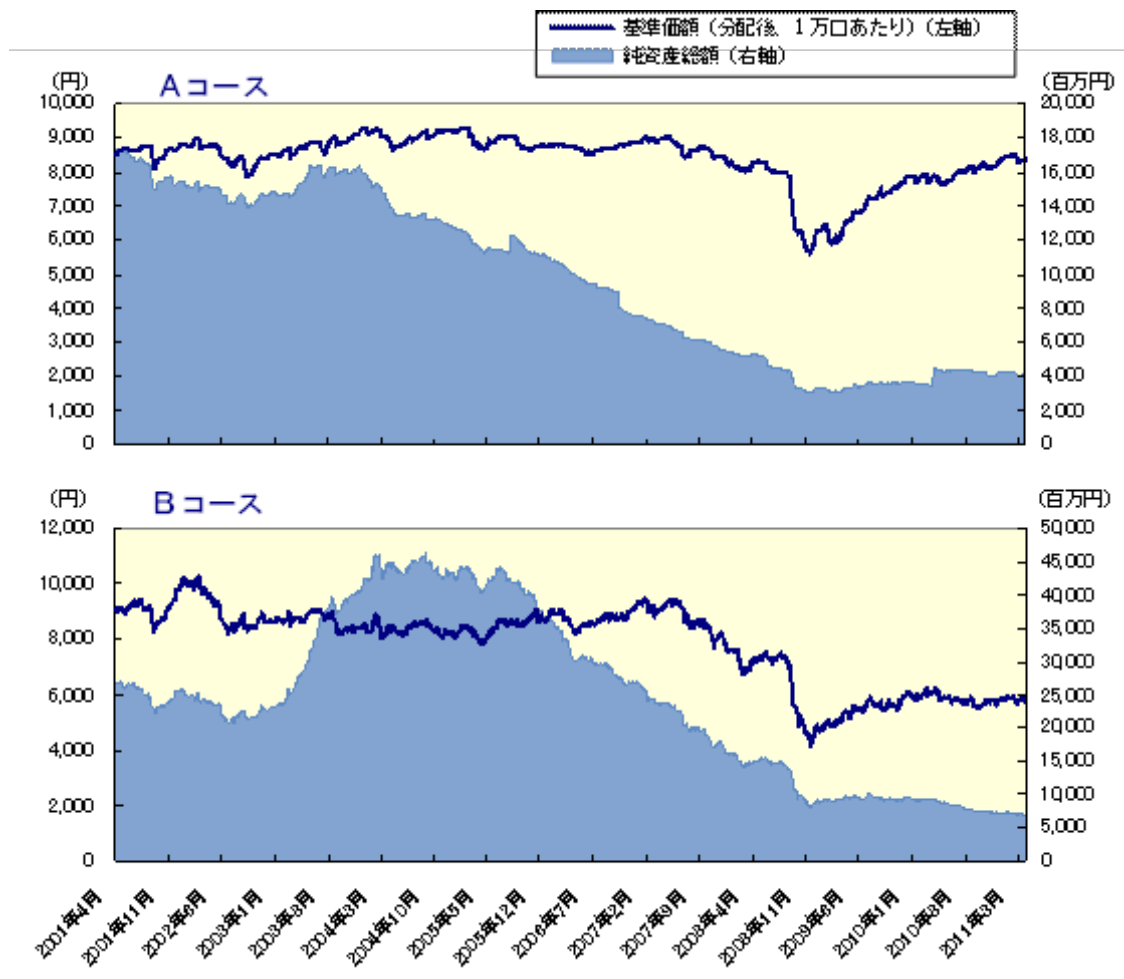
「Bコース」

期	設定口数	解約口数	発行済み口数
第13期	984,832,747	4,595,180,373	26,819,157,291
第14期	2,149,172,657	4,421,496,500	24,546,833,448
第15期	2,481,638,367	1,375,578,649	25,652,893,166
第16期	5,200,715,427	1,723,072,614	29,130,535,979
第17期	18,026,644,916	2,514,196,747	44,642,984,148
第18期	9,940,912,278	1,941,544,827	52,642,351,599
第19期	4,059,426,790	3,764,447,754	52,937,330,635
第20期	3,736,590,760	4,476,153,278	52,197,768,117
第21期	2,826,250,183	6,489,147,868	48,534,870,432
第22期	1,078,477,773	11,415,173,345	38,198,174,860
第23期	672,083,032	5,809,736,303	33,060,521,589
第24期	490,556,251	6,907,062,729	26,644,015,111
第25期	450,529,187	4,156,197,068	22,938,347,230
第26期	332,603,931	2,392,387,602	20,878,563,559
第27期	473,652,936	1,842,125,046	19,510,091,449
第28期	206,583,236	1,397,126,909	18,319,547,776
第29期	227,765,337	1,731,582,459	16,815,730,654
第30期	165,131,874	1,654,852,726	15,326,009,802
第31期	248,133,940	1,959,745,285	13,614,398,457
第32期	179,647,385	1,548,492,369	12,245,553,473

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 > 運用実績（2011年4月28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）

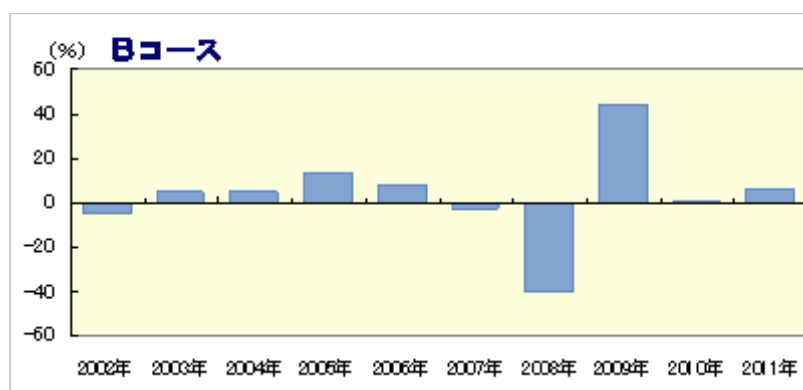
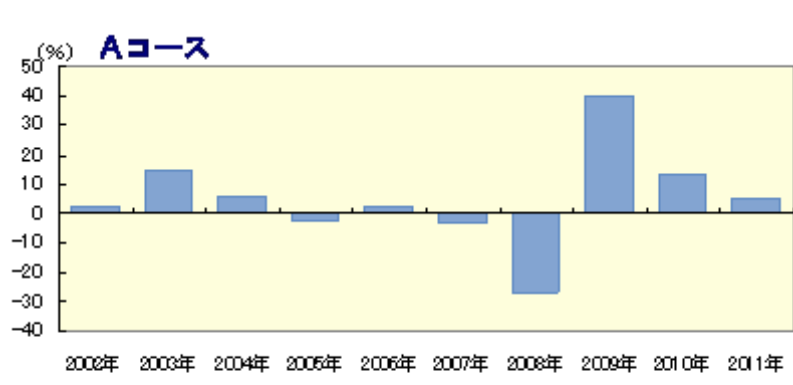
Aコース	
2011年3月	245 円
2010年9月	240 円
2010年3月	243 円
2009年9月	242 円
2009年3月	228 円
設定来累計	5,434 円

Bコース	
2011年3月	180 円
2010年9月	195 円
2010年3月	190 円
2009年9月	207 円
2009年3月	234 円
設定来累計	12,805 円

[主要な資産の状況]

実質的な銘柄別投資比率(上位)				
順位	銘柄	種類	投資比率(%)	
			Aコース	Bコース
1	CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	社債券	1.5	1.5
2	GEORGIA-PACIFIC LLC	社債券	1.0	1.0
3	PENSKE AUTO GROUP INC	社債券	0.9	0.9
4	SPRINT NEXTEL CORP	社債券	0.9	0.9
5	ALLY FINANCIAL INC	社債券	0.8	0.8
6	TUBE CITY IMS CORP	社債券	0.8	0.8
7	EL PASO CORP	社債券	0.7	0.7
8	SESI LLC	社債券	0.7	0.7
9	AGY HOLDING CORP	社債券	0.7	0.7
10	STEINWAY MUSICAL INSTRUM	社債券	0.7	0.7

[年間収益率の推移] (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2011年は年初から4月末までの収益率。

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

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(前略)

スイッチングによる申込みは、「一般コース」を選択した投資者は1万口以上1万口単位または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者は1万円以上1円単位からできます。また、当該投資者が保有する「Aコース」または「Bコース」の受益権の全てをご換金した場合の手取金の全額をもって取得申込みを行う場合は、1口単位とします。(販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。)

(以下 略)

<訂正後>

(前略)

スイッチングによる申込みは、「一般コース」を選択した投資者は1万口以上1万口単位または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者は1万円以上1円単位からできます。また、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が、スイッチングに際し、当該投資者が保有する「Aコース」または「Bコース」の受益権の全てをご換金した場合の手取金の全額をもって取得申込みを行う場合は、1口単位とします。(販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。)

(以下 略)

第3 【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

原届出書の 第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

ハイ・イールド ボンド オープン A コース

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

なお、財務諸表等規則は、平成22年9月30日付内閣府令第45号により改正されておりますが、第31期計算期間(平成22年3月30日から平成22年9月28日まで)および第32期計算期間(平成22年9月29日から平成23年3月28日まで)については内閣府令第45号附則第3条第1項第1号により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

また、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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期計算期間(平成22年3月30日から平成22年9月28日まで)および第32期計算期間(平成22年9月29日から平成23年3月28日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

【ハイ・イールド ボンド オープンAコース】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第31期 平成22年 9月28日現在	第32期 平成23年 3月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,211,367	40,003,786
親投資信託受益証券	4,098,891,455	3,986,685,976
派生商品評価勘定	47,194,268	30,460,658
未収入金	178,337,504	154,396,720
未収利息	115	106
流動資産合計	4,365,634,709	4,211,547,246
資産合計	4,365,634,709	4,211,547,246
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	704,220	-
未払収益分配金	126,726,612	120,214,628
未払解約金	9,633,489	5,525,000
未払受託者報酬	1,102,853	1,086,832
未払委託者報酬	33,526,469	33,039,720
その他未払費用	44,050	43,419
流動負債合計	171,737,693	159,909,599
負債合計	171,737,693	159,909,599
純資産の部		
元本等		
元本	5,280,275,514	4,906,719,519
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,086,378,498	855,081,872
（分配準備積立金）	1,006,921,776	950,202,524
元本等合計	4,193,897,016	4,051,637,647
純資産合計	4,193,897,016	4,051,637,647
負債純資産合計	4,365,634,709	4,211,547,246

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第31期 自平成22年 3月30日 至平成22年 9月28日	第32期 自平成22年 9月29日 至平成23年 3月28日
営業収益		
受取利息	22,310	20,175
有価証券売買等損益	104,845,751	193,552,521
為替差損益	380,945,349	126,173,041
営業収益合計	276,121,908	319,745,737
営業費用		
受託者報酬	1,102,853	1,086,832
委託者報酬	33,526,469	33,039,720
その他費用	44,050	43,419
営業費用合計	34,673,372	34,169,971
営業利益	241,448,536	285,575,766
経常利益	241,448,536	285,575,766
当期純利益	241,448,536	285,575,766
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	6,817,462	11,803,208
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,023,664,683	1,086,378,498
剰余金増加額又は欠損金減少額	110,208,541	85,135,470
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	110,208,541	85,135,470
剰余金減少額又は欠損金増加額	280,826,818	7,396,774
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	280,826,818	7,396,774
分配金	126,726,612	120,214,628
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,086,378,498	855,081,872

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 (2) 外国為替予約取引 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。	(1) 親投資信託受益証券 同左 (2) 外国為替予約取引 同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益及び為替差損益 の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 有価証券売買等損益及び為替差損益 の計上基準 同左
3 その他	当ファンドの計算期間は前期末が休 日のため、平成22年3月30日から平成 22年9月28日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成22年9 月29日から平成23年3月28日までと なっております。

(貸借対照表に関する注記)

第31期 平成22年9月28日現在	第32期 平成23年3月28日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 5,280,275,514 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 4,906,719,519 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 1,086,378,498 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 855,081,872 円
3 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 0.7943 円 (10,000口当たり純資産額 7,943 円)	3 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 0.8257 円 (10,000口当たり純資産額 8,257 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日																																																												
1 運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。 支払金額 67,795,531 円	1 運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。 支払金額 59,377,732 円																																																												
2 分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額1,985,272,819円(10,000口当たり3,759円)のうち、126,726,612円(10,000口当たり240円)を分配金額としております。	2 分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額1,869,396,540円(10,000口当たり3,809円)のうち、120,214,628円(10,000口当たり245円)を分配金額としております。																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>150,206,659円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>851,624,431円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>983,441,729円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E = A+B+C+D</td> <td>1,985,272,819円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>5,280,275,514口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G = E / F × 10,000</td> <td>3,759円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>240円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I = F × H / 10,000</td> <td>126,726,612円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	150,206,659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	円	収益調整金額	C	851,624,431円	分配準備積立金額	D	983,441,729円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,985,272,819円	当ファンドの期末残存口数	F	5,280,275,514口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	3,759円	10,000口当たり分配金額	H	240円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	126,726,612円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>142,115,781円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>798,979,388円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>928,301,371円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E = A+B+C+D</td> <td>1,869,396,540円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,906,719,519口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G = E / F × 10,000</td> <td>3,809円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>245円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I = F × H / 10,000</td> <td>120,214,628円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	142,115,781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	円	収益調整金額	C	798,979,388円	分配準備積立金額	D	928,301,371円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,869,396,540円	当ファンドの期末残存口数	F	4,906,719,519口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	3,809円	10,000口当たり分配金額	H	245円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	120,214,628円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	150,206,659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	円																																																											
収益調整金額	C	851,624,431円																																																											
分配準備積立金額	D	983,441,729円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,985,272,819円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	5,280,275,514口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	3,759円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	240円																																																											
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	126,726,612円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	142,115,781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	円																																																											
収益調整金額	C	798,979,388円																																																											
分配準備積立金額	D	928,301,371円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,869,396,540円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,906,719,519口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	3,809円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	245円																																																											
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	120,214,628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

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
<p>1 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2 金融商品の内容及び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。 また、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なうことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>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。</p> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

(2)金融商品の時価等に関する事項

第31期 平成22年9月28日現在	第32期 平成23年3月28日現在
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 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。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
期首元本額 4,460,980,356 円	期首元本額 5,280,275,514 円
期中追加設定元本額 1,304,979,322 円	期中追加設定元本額 40,352,651 円
期中一部解約元本額 485,684,164 円	期中一部解約元本額 413,908,646 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
種類	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	95,241,024	182,541,851
合計	95,241,024	182,541,851

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	第31期(平成22年9月28日現在)			第32期(平成23年3月28日現在)		
	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引						
売建	4,066,897,848	4,020,407,800	46,490,048	3,965,776,348	3,935,315,690	30,460,658
米ドル	4,066,897,848	4,020,407,800	46,490,048	3,965,776,348	3,935,315,690	30,460,658
合計	4,066,897,848	4,020,407,800	46,490,048	3,965,776,348	3,935,315,690	30,460,658

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

計算期間末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。

- ・ 計算期間末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。
- ・ 計算期間末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) 計算期間末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、計算期間末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(平成23年3月28日現在)
該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券 (平成23年3月28日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	ハイ・イールド ボンド オープン マザーファンド		3,986,685,976	
親投資信託受益証券計	銘柄数：1		3,986,685,976	
	組入時価比率：98.4%		100%	
合計			3,986,685,976	

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

第2デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

ハイ・イールド ボンド オープンBコース

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

なお、財務諸表等規則は、平成22年9月30日付内閣府令第45号により改正されておりますが、第31期計算期間(平成22年3月30日から平成22年9月28日まで)および第32期計算期間(平成22年9月29日から平成23年3月28日まで)については内閣府令第45号附則第3条第1項第1号により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

また、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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期計算期間(平成22年3月30日から平成22年9月28日まで)および第32期計算期間(平成22年9月29日から平成23年3月28日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【ハイ・イールド ボンド オープンBコース】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第31期 平成22年 9月28日現在	第32期 平成23年 3月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	78,609,943	70,498,153
親投資信託受益証券	7,605,870,559	6,909,258,664
未収入金	350,000,000	310,000,000
未収利息	219	186
流動資産合計	8,034,480,721	7,289,757,003
資産合計	8,034,480,721	7,289,757,003
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	265,480,769	220,419,962
未払解約金	25,240,579	59,979,070
未払受託者報酬	2,263,050	1,921,420
未払委託者報酬	68,796,692	58,411,103
その他未払費用	90,457	76,800
流動負債合計	361,871,547	340,808,355
負債合計	361,871,547	340,808,355
純資産の部		
元本等		
元本	13,614,398,457	12,245,553,473
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,941,789,283	5,296,604,825
（分配準備積立金）	440,644,850	397,470,095
元本等合計	7,672,609,174	6,948,948,648
純資産合計	7,672,609,174	6,948,948,648
負債純資産合計	8,034,480,721	7,289,757,003

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第31期 自平成22年 3月30日 至平成22年 9月28日	第32期 自平成22年 9月29日 至平成23年 3月28日
営業収益		
受取利息	46,335	35,620
有価証券売買等損益	171,161,156	341,538,105
営業収益合計	171,114,821	341,573,725
営業費用		
受託者報酬	2,263,050	1,921,420
委託者報酬	68,796,692	58,411,103
その他費用	90,457	76,800
営業費用合計	71,150,199	60,409,323
営業利益	242,265,020	281,164,402
経常利益	242,265,020	281,164,402
当期純利益	242,265,020	281,164,402
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	18,792,350	14,197,958
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,138,314,230	5,941,789,283
剰余金増加額又は欠損金減少額	784,833,536	675,803,099
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	784,833,536	675,803,099
剰余金減少額又は欠損金増加額	99,355,150	77,165,123
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	99,355,150	77,165,123
分配金	265,480,769	220,419,962
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,941,789,283	5,296,604,825

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 親投資信託受益証券基準価額で評価しております。	(1) 親投資信託受益証券同左
2 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益の計上基準約定日基準で計上しております。	(1) 有価証券売買等損益の計上基準同左
3 その他	当ファンドの計算期間は前期末が休日のため、平成22年3月30日から平成22年9月28日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成22年9月29日から平成23年3月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第31期 平成22年9月28日現在	第32期 平成23年3月28日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数	13,614,398,457 口	12,245,553,473 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	5,941,789,283 円	5,296,604,825 円
3 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	0.5636 円 5,636 円)	0.5675 円 5,675 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日			第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日																																																														
1	運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。 支払金額	67,795,531 円	1	運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。 支払金額	59,377,732 円																																																												
2	分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額1,441,147,889円(10,000口当たり1,058円)のうち、265,480,769円(10,000口当たり195円)を分配金額としております。		2	分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額1,284,979,973円(10,000口当たり1,049円)のうち、220,419,962円(10,000口当たり180円)を分配金額としております。																																																													
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>267,882,327円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>735,022,270円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>438,243,292円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E = A+B+C+D</td> <td>1,441,147,889円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>13,614,398,457口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G = E / F × 10,000</td> <td>1,058円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>195円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I = F × H / 10,000</td> <td>265,480,769円</td> </tr> </tbody> </table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	267,882,327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	円	収益調整金額	C	735,022,270円	分配準備積立金額	D	438,243,292円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,441,147,889円	当ファンドの期末残存口数	F	13,614,398,457口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,058円	10,000口当たり分配金額	H	195円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	265,480,769円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>226,956,950円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>667,089,916円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>390,933,107円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E = A+B+C+D</td> <td>1,284,979,973円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,245,553,473口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G = E / F × 10,000</td> <td>1,049円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>180円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I = F × H / 10,000</td> <td>220,419,962円</td> </tr> </tbody> </table>			項目			費用控除後の配当等収益額	A	226,956,950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	円	収益調整金額	C	667,089,916円	分配準備積立金額	D	390,933,107円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,284,979,973円	当ファンドの期末残存口数	F	12,245,553,473口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,049円	10,000口当たり分配金額	H	180円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	220,419,962円
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	267,882,327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	円																																																															
収益調整金額	C	735,022,270円																																																															
分配準備積立金額	D	438,243,292円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,441,147,889円																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	13,614,398,457口																																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,058円																																																															
10,000口当たり分配金額	H	195円																																																															
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	265,480,769円																																																															
項目																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	226,956,950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	円																																																															
収益調整金額	C	667,089,916円																																																															
分配準備積立金額	D	390,933,107円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,284,979,973円																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	12,245,553,473口																																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,049円																																																															
10,000口当たり分配金額	H	180円																																																															
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	220,419,962円																																																															

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日</p>	<p style="text-align: center;">第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日</p>
<p>1 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> <p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第31期 平成22年9月28日現在	第32期 平成23年3月28日現在
1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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 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。	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)

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
期首元本額 15,326,009,802 円	期首元本額 13,614,398,457 円
期中追加設定元本額 248,133,940 円	期中追加設定元本額 179,647,385 円
期中一部解約元本額 1,959,745,285 円	期中一部解約元本額 1,548,492,369 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	第31期 自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日	第32期 自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
種類	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	150,546,492	314,925,728
合計	150,546,492	314,925,728

3 デリバティブ取引関係

第31期(自 平成22年3月30日 至 平成22年9月28日)

該当事項はございません
第32期(自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日)
該当事項はございません

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成23年3月28日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券 (平成23年3月28日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	ハイ・イールド ボンド オープン マザーファンド		6,909,258,664	
親投資信託受益証券計	銘柄数：1		6,909,258,664	
	組入時価比率：99.4%		100%	
合計			6,909,258,664	

(注) 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

該当事項はございません。

参考

ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド

「ハイ・イールド ボンド オープンAコース」および「ハイ・イールド ボンド オープンBコース」は「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。尚、同親投資信託の状況は次の通りです。

1 「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1)貸借対照表

科目	対象年月日	平成23年3月28日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		738,683,807
コール・ローン		252,092,117
社債券		22,204,589,654
未収入金		420,656,582
未収利息		468,279,459
前払費用		5,152,866
流動資産合計		24,089,454,485
資産合計		24,089,454,485
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,432,000
未払金		364,968,841
未払解約金		539,700,000
流動負債合計		908,100,841
負債合計		908,100,841
純資産の部		
元本等		
元本		6,799,639,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		16,381,714,608
元本等合計		23,181,353,644
純資産合計		23,181,353,644
負債純資産合計		24,089,454,485

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	自 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日
--	------------------------------

1 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 外国為替予約取引 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。</p>
2 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3 費用・収益の計上基準	<p>(1) 有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成23年3月28日現在	
1 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	3.4092 円 34,092 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 平成22年9月29日 至 平成23年3月28日	
1 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行なうことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月28日現在

1 貸借対照表計上額、時価及び差額
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2 時価の算定方法
社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(3)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)

平成23年3月28日現在

1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成22年9月29日
期首元本額	7,576,671,505 円
期首より平成23年3月28日までの期中追加設定元本額	267,410,828 円
期首より平成23年3月28日までの期中一部解約元本額	1,044,443,297 円
期末元本額	6,799,639,036 円
期末元本額の内訳*	
ハイ・イールド ボンド オープンAコース	1,169,390,466 円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース	2,026,651,022 円
ハイ・イールド ボンド オープンCコース	64,443,819 円
ハイ・イールド ボンド オープンDコース	1,067,562,973 円
ハイブリッド・インカムオープン	1,502,970,289 円
ハイ・イールド ボンド オープンAコース(野村SMA向け)	300,306,247 円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース(野村SMA向け)	668,314,220 円

*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

(3)附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(平成23年3月28日現在)

該当事項はございません。

(2)株式以外の有価証券

(平成23年3月28日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ACCURIDE CORP	100,000.00	112,500.00	
	AFFINION GROUP INC	400,000.00	377,000.00	
	AGUILA 3 SA	200,000.00	205,500.00	

	AGY HOLDING CORP	2,400,000.00	2,304,000.00	
	AIR CANADA	875,000.00	918,750.00	
	ALERE INC	650,000.00	696,312.50	
	ALERIS INTL INC	375,000.00	378,750.00	
	ALLEN SYSTEMS GROUP INC	375,000.00	383,437.50	
	ALLIANCE HEALTHCARE SVCS	1,025,000.00	1,014,750.00	
	ALLIANT TECHSYSTEMS INC	400,000.00	418,000.00	
	ALLY FINANCIAL	250,000.00	275,625.00	
	ALLY FINANCIAL	1,675,000.00	1,855,062.50	
	ALLY FINANCIAL INC	950,000.00	1,034,312.50	
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	450,000.00	456,750.00	
	AMC ENTERTAINMENT INC	275,000.00	297,000.00	
	AMERICAN AIRLINES INC	475,000.00	473,812.50	
	AMERICAN AXLE & MFG INC	725,000.00	809,281.25	
	AMERICAN GENERAL FINANCE	300,000.00	301,875.00	
	AMERICAN GENERAL FINANCE	25,000.00	24,656.25	
	AMERICAN INTL GROUP	500,000.00	460,000.00	
	AMERICAN INTL GROUP	500,000.00	541,250.00	
	AMERICAN RENAL HOLDINGS	175,000.00	184,625.00	
	AMERICAN REPROGRAPHICS C	375,000.00	408,281.25	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	AMERISTAR CASINOS INC	1,025,000.00	1,121,093.75	
	AMGH MERGER SUB INC	250,000.00	269,375.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	150,000.00	163,889.85	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	50,000.00	55,148.70	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	400,000.00	490,866.40	
	AQUILEX HDG/AQUILEX FIN	225,000.00	238,218.75	
	ARCH COAL INC	125,000.00	140,000.00	
	AS AMERICAS	100,000.00	107,000.00	
	ASBURY AUTO GROUP 7.625%	400,000.00	410,000.00	
	ATKORE INTERNATIONAL INC	700,000.00	756,875.00	
	AVIS BUDGET CAR RENTAL	325,000.00	341,250.00	
	AVIV HEALTHCARE PROPERTI	275,000.00	288,062.50	
	B&G FOODS INC	650,000.00	706,875.00	
	BAKER & TAYLOR INC	1,950,000.00	1,696,500.00	
	BANKRATE INC	500,000.00	570,625.00	
	BASIC ENERGY SERVICES	150,000.00	155,250.00	
	BELO CORP	425,000.00	468,031.25	
	BERRY PETROLEUM CO	475,000.00	552,187.50	
	BERRY PLASTICS ESCROW	450,000.00	478,125.00	
	BI-LO LLC/BI-LO FIN CORP	400,000.00	416,500.00	
	BIOMET INC	1,150,000.00	1,267,875.00	
	BIOSCRIP INC	225,000.00	235,125.00	
	BLUE MERGER SUB INC	625,000.00	632,031.25	
	BOART LONGYEAR MANAGEMEN	250,000.00	257,500.00	

	BOISE PAPER HDG/CO-ISSR	750,000.00	815,625.00	
	BOISE PAPER HOLDINGS LLC	350,000.00	388,500.00	
	BRESNAN BROADBAND HOLDIN	225,000.00	238,218.75	
	BUILDING MATERIALS CORP	550,000.00	574,750.00	
	BUILDING MATERIALS CORP	375,000.00	390,000.00	
	BUMBLE BEE ACQUISITON CO	350,000.00	366,625.00	
	BWAY HOLDING CO	325,000.00	359,125.00	
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	1,300,000.00	1,460,875.00	
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	800,000.00	870,000.00	
	CALFRAC HOLDINGS LP	325,000.00	336,781.25	
	CALPINE CORP	750,000.00	795,000.00	
	CALPINE CORP	225,000.00	232,875.00	
	CAPELLA HEALTHCARE	500,000.00	538,750.00	
	CASCADES INC	750,000.00	797,812.50	
	CASE NEW HOLLAND INC	610,000.00	681,675.00	
	CATALYST PAPER C	1,535,000.00	1,565,700.00	
	CB RICHARD ELLIS SERVICE	450,000.00	467,437.50	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	800,000.00	839,000.00	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	575,000.00	590,812.50	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	51,250.00	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	1,000,000.00	1,088,750.00	
	CDW LLC/CDW FINANCE	375,000.00	402,656.25	

	CEDAR FAIR LP/CANADA'S W	725,000.00	791,156.25	
	CELANESE US HOLDINGS LLC	325,000.00	335,968.75	
	CEMEX FINANCE LLC	675,000.00	733,218.75	
	CENTRAL GARDEN & PET CO	275,000.00	290,125.00	
	CENVEO CORP	150,000.00	151,500.00	
	CEQUEL COM HLDG I/CAP CP	750,000.00	791,250.00	
	CF INDUSTRIES INC	150,000.00	170,062.50	
	CHART INDUSTRIES INC	1,550,000.00	1,604,250.00	
	CHC HELICOPTER SA	975,000.00	1,018,875.00	
	CHECKOUT HOLDINGS CORP	400,000.00	262,250.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,325,000.00	1,437,625.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	275,000.00	298,718.75	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,025,000.00	1,091,625.00	
	CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	5,798,000.00	4,435,470.00	
	CINCINNATI BELL INC	425,000.00	432,437.50	
	CINCINNATI BELL INC	500,000.00	477,500.00	
	CINCINNATI BELL INC	800,000.00	792,000.00	
	CINEMARK USA INC	525,000.00	574,218.75	
	CIT GROUP INC	1,500,000.00	1,496,263.50	
	CIT GROUP INC	250,000.00	252,500.00	
	CIT GROUP INC	1,600,000.00	1,608,000.00	
	CIT GROUP INC	1,125,000.00	1,129,218.75	
	CITADEL BROADCASTING COR	175,000.00	189,000.00	
	CITIGROUP CAPITAL XXI	350,000.00	365,750.00	
	CITYCENTER HLDGS/FINANCE	675,000.00	700,312.50	

	CLEAN HARBORS INC	50,000.00	53,250.00	
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	900,000.00	981,000.00	
	CLEARWIRE CORP	700,000.00	757,750.00	
	CLEAVER-BROOKS INC	825,000.00	872,437.50	
	COFFEYVILLE RESOURCES	337,000.00	369,015.00	
	COGENT COMMUNICATIONS GR	475,000.00	492,218.75	
	COLT DEFENSE/FINANCE	425,000.00	344,250.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	COMMSCOPE INC	775,000.00	806,000.00	
	COMSTOCK RESOURCES INC	125,000.00	126,718.75	
	CONCHO RESOURCES INC	350,000.00	370,562.50	
	CONNACHER OIL AND GAS	100,000.00	108,500.00	
	CONNACHER OIL AND GAS	900,000.00	955,125.00	
	CONSOL ENERGY INC	320,000.00	354,400.00	
	CONSOL ENERGY INC	550,000.00	613,937.50	
	CONSOL ENERGY INC	225,000.00	226,125.00	
	CONSTELLATION BRANDS INC	470,000.00	511,712.50	
	CONTINENTAL RESOURCES	250,000.00	266,250.00	
	COPANO ENERGY LLC/FIN CO	225,000.00	228,656.25	
	COTT BEVERAGES USA INC	325,000.00	348,968.75	
	CPM HOLDINGS INC	175,000.00	191,625.00	
	CRICKET COMMUNICATIONS I	975,000.00	975,000.00	
	CROWN AMER/CAP CORP III	375,000.00	382,500.00	
	CSC HOLDINGS INC	480,000.00	551,400.00	
	DANA HOLDING CORP	200,000.00	201,000.00	
	DANA HOLDING CORP	150,000.00	151,312.50	
	DARLING INTERNATIONAL IN	175,000.00	190,312.50	
	DAVITA INC	425,000.00	429,781.25	
	DAVITA INC	425,000.00	432,437.50	
	DEAN FOODS CO	350,000.00	363,125.00	
	DELUXE CORP	375,000.00	376,406.25	

	DENBURY RESOURCES INC	249,000.00	279,502.50	
	DENBURY RESOURCES INC	250,000.00	257,812.50	
	DIGICEL GROUP LTD	1,200,000.00	1,278,000.00	
	DISH DBS CORP	1,150,000.00	1,249,187.50	
	DOLE FOODS CO	375,000.00	400,312.50	
	DOMTAR INC	750,000.00	895,312.50	
	DYCOM INVESTMENTS INC	175,000.00	178,500.00	
	DYNEGY HOLDINGS INC	675,000.00	572,062.50	
	DYNEGY HOLDINGS INC	1,425,000.00	1,097,250.00	
	EACCESS LTD	175,000.00	175,000.00	
	EDISON MISSION ENERGY	1,300,000.00	1,046,500.00	
	EDISON MISSION ENERGY	625,000.00	492,968.75	
	EDISON MISSION ENERGY	1,625,000.00	1,218,750.00	
	EL PASO CORP	1,950,000.00	1,949,069.85	
	EL PASO CORPORATION	825,000.00	923,687.32	
	ELIZABETH ARDEN INC	150,000.00	157,500.00	
	EMPIRE TODAY LLC	125,000.00	132,500.00	
	ENDO PHARMACEUT HLDGS IN	175,000.00	182,000.00	
	ENERGY FUTURE	641,000.00	677,420.97	
	ENERGY FUTURE HOLDINGS	437,000.00	360,525.00	
	ENERGYSOLUTIONS INC/LLC	525,000.00	580,125.00	
	ENTRAVISION COMMUNICATIO	350,000.00	374,062.50	
	EQUINIX INC	1,135,000.00	1,237,150.00	
	ESSAR STEEL ALGOMA INC	775,000.00	780,812.50	
	ESTERLINE TECHNOLOGIES C	275,000.00	289,437.50	
	EXCO RESOURCES INC	425,000.00	432,437.50	

EXIDE TECHNOLOGIES	400,000.00	429,000.00	
EXPRESS LLC	1,235,000.00	1,346,150.00	
EXPRO FINANCE LUXEMBOURG	1,300,000.00	1,296,750.00	
FERRELLGAS PARTNERS LP	525,000.00	572,250.00	
FGI OPERATIONS CO INC	500,000.00	537,500.00	
FIDELITY NATIONAL INFORM	275,000.00	301,125.00	
FIDELITY NATIONAL INFORM	200,000.00	220,000.00	
FLORIDA EAST RR	400,000.00	418,000.00	
FORD MOTOR COMPANY	1,650,000.00	1,712,685.15	
FORD MOTOR COMPANY	250,000.00	269,907.75	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000.00	428,436.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	1,450,000.00	1,664,888.55	
FRAC TECH SVCS/FRAC TECH	225,000.00	231,187.50	
FREESCALE SEMICONDUCTOR	575,000.00	632,500.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS	1,125,000.00	1,217,812.50	
FTI CONSULTING INC	2,330,000.00	2,440,675.00	
GANNETT CO INC	250,000.00	288,125.00	
GANNETT CO INC	300,000.00	342,750.00	
GANNETT CO INC	700,000.00	711,375.00	
GARDA WORLD SECURITY COR	675,000.00	724,781.25	
GCI INC	525,000.00	580,125.00	
GENESIS ENERGY LP/GENESI	250,000.00	250,000.00	
GENON ESCROW CORP	725,000.00	754,000.00	
GENON ESCROW CORP	825,000.00	862,125.00	
GEO GROUP INC/THE	200,000.00	214,000.00	

	GEO GROUP INC/THE	200,000.00	199,000.00	
	GEOEYE INC	475,000.00	505,875.00	
	GEOKINETICS HOLDINGS INC	800,000.00	768,000.00	
	GEORGIA-PACIFIC CORP	2,450,000.00	2,817,500.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	GIBSON ENERGY/GEP MIDSTR	600,000.00	630,000.00	
	GLOBAL AVIATION HOLDINGS	400,000.00	472,000.00	
	GLOBAL CROSSING LTD	975,000.00	1,118,812.50	
	GMAC LLC	2,025,000.00	2,268,000.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER C	425,000.00	453,687.50	
	GREAT LAKES DREDGE&DOCK	250,000.00	254,062.50	
	GREIF INC	250,000.00	275,000.00	
	GRIFOLS INC	500,000.00	514,375.00	
	GWR OPERATING PARTNERSHP	725,000.00	790,250.00	
	GXS WORLDWIDE INC	475,000.00	487,468.75	
	HANESBRANDS INC	1,350,000.00	1,471,500.00	
	HANESBRANDS INC	675,000.00	661,500.00	
	HANGER ORTHOPEDIC GROUP	325,000.00	332,312.50	
	HAPAG-LLOYD AG	325,000.00	350,187.50	
	HCA INC	425,000.00	460,062.50	
	HCA INC	1,500,000.00	1,642,500.00	
	HEADWATERS INC	175,000.00	175,437.50	
	HEALTHSOUTH CORP	300,000.00	312,750.00	
	HEALTHSOUTH CORP	300,000.00	313,500.00	
	HERCULES OFFSHORE LLC	250,000.00	253,750.00	
	HERTZ CORP	500,000.00	497,500.00	
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	525,000.00	564,375.00	
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	650,000.00	685,750.00	
	HOA RESTAURANT GP/FINANC	375,000.00	382,500.00	

	HOLLY CORP	975,000.00	1,106,625.00	
	HOLLY ENERGY PARTNERS LP	700,000.00	749,000.00	
	HORNBECK OFFSHORE SRVCS	425,000.00	440,937.50	
	HOST HOTELS & RESORTS LP	325,000.00	367,250.00	
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	325,000.00	338,812.50	
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	450,000.00	469,687.50	
	HUNTSMAN INTERNATIONAL L	725,000.00	791,156.25	
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	425,000.00	440,937.50	
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	1,275,000.00	1,319,625.00	
	ICON HEALTH & FITNESS	575,000.00	613,812.50	
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	300,000.00	249,447.00	
	INEOS FINANCE PLC	200,000.00	219,500.00	
	INERGY LP/INERGY FIN	536,000.00	581,560.00	
	INERGY LP/INERGY FIN	250,000.00	260,625.00	
	INERGY LP/INERGY FIN	675,000.00	702,843.75	
	INGLES MARKETS INC	400,000.00	432,000.00	
	INSIGHT COMMUNICATIONS	750,000.00	832,500.00	
	INTELSAT JACKSON HLDG	750,000.00	753,750.00	
	INTELSAT JACKSON HLDG	250,000.00	269,687.50	
	INTELSAT JACKSON HLDG	550,000.00	552,062.50	
	INTELSAT JACKSON HLDG	250,000.00	251,562.50	
	INTERFACE INC	175,000.00	182,875.00	
	INTERLINE BRANDS INC	125,000.00	128,750.00	
	INTL LEASE FINANCE CORP	200,000.00	220,500.00	
	INTL LEASE FINANCE CORP	725,000.00	815,625.00	
	INTL LEASE FINANCE CORP	575,000.00	633,218.75	

IPALCO ENTERPRISES INC	400,000.00	434,000.00	
IRON MOUNTAIN INC	1,100,000.00	1,155,000.00	
IRON MOUNTAIN INC	250,000.00	265,000.00	
ISLE OF CAPRI CASINOS	300,000.00	299,250.00	
ITC DELTACOM INC	450,000.00	492,750.00	
J.B.POINDEXTER & CO	700,000.00	712,250.00	
JAMES RIVER ESCROW INC	125,000.00	125,000.00	
JARDEN CORP	775,000.00	825,375.00	
JARDEN CORP	300,000.00	316,500.00	
JARDEN CORP	150,000.00	147,750.00	
JMC STEEL GROUP	375,000.00	382,031.25	
JOHNSON DIVERSEY HOLD INC	350,000.00	379,750.00	
KABEL BW ERSTE BETEILIGU	50,000.00	51,250.00	
KB HOME	600,000.00	640,500.00	
KEY ENERGY SERVICES INC	175,000.00	178,062.50	
KOPPERS INC	275,000.00	299,750.00	
KRATON POLYMERS LLC/CAP	150,000.00	153,000.00	
LANDRY'S RESTAURANT INC	350,000.00	377,562.50	
LBI ESCROW CORP	811,000.00	898,182.50	
LEAR CORP	250,000.00	274,375.00	
LEAR CORP	175,000.00	193,375.00	
LENNAR CORP	275,000.00	273,625.00	
LIBBEY GLASS INC	338,000.00	370,110.00	
LIBERTY TIRE RECYCLING	425,000.00	468,562.50	
LIMITED BRANDS INC	600,000.00	690,000.00	
LIMITED BRANDS INC	225,000.00	239,343.75	
LIMITED BRANDS INC	525,000.00	535,500.00	
LIN TELEVISION CORP	150,000.00	164,062.50	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	225,000.00	250,875.00	
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	600,000.00	643,500.00	
	LIONS GATE ENTERTAINMENT	675,000.00	718,875.00	
	LUCENT TECHNOLOGIES	1,604,000.00	1,387,460.00	
	MAGNACHIP SEMICONDUCTOR	375,000.00	422,343.75	
	MANITOWOC COMPANY INC	500,000.00	540,000.00	
	MARINA DISTRICT FINANCE	325,000.00	339,625.00	
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	400,000.00	412,000.00	
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	200,000.00	200,000.00	
	MARQUETTE TRANS CO/FINAN	450,000.00	471,375.00	
	MCCLATCHY CO	775,000.00	879,625.00	
	MCJUNKIN RED MAN CORP	575,000.00	580,750.00	
	MEDASSETS INC	175,000.00	180,250.00	
	MEDIA GENERAL INC	175,000.00	192,062.50	
	MEDIACOM BROADBD LLC/CRP	1,150,000.00	1,201,750.00	
	MEDIACOM LLC/CAPTL CORP	750,000.00	802,500.00	
	MEG ENERGY CORP	325,000.00	329,875.00	
	MEMC ELECTRONICS MATERIA	375,000.00	381,093.75	
	MERCER INTL INC	175,000.00	192,500.00	
	METHANEX CORP	875,000.00	878,326.75	
	METROPCS WIRELESS INC	1,300,000.00	1,389,375.00	

METROPCS WIRELESS INC	875,000.00	870,625.00	
MGM RESORT INTERNATIONAL	875,000.00	966,875.00	
MOBILE MINI INC	2,000,000.00	2,065,000.00	
MYLAN INC	400,000.00	434,500.00	
MYLAN INC	875,000.00	961,406.25	
NAI ENTER HOLDINGS LLC	200,000.00	215,000.00	
NALCO CO	650,000.00	711,750.00	
NATIONSTAR MORT/CAP CORP	550,000.00	567,187.50	
NBTY INC	675,000.00	729,000.00	
NEXEO SOLUTIONS LLC/CORP	75,000.00	76,687.50	
NEXTEL COMMUNICATIONS	850,000.00	860,625.00	
NIELSEN FINANCE LLC/CO	500,000.00	591,250.00	
NORTH AMERICAN ENERGY AL	175,000.00	198,625.00	
NORTHERN TIER ENERGY LLC	200,000.00	227,000.00	
NOVASEP HOLDING SAS	1,100,000.00	698,500.00	
NOVELIS INC	975,000.00	1,056,656.25	
NOVELIS INC	325,000.00	358,312.50	
NRG ENERGY INC	1,000,000.00	1,037,500.00	
NRG ENERGY INC	975,000.00	1,033,500.00	
NRG ENERGY INC	1,125,000.00	1,178,437.50	
NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD	726,000.00	715,110.00	
OMEGA HLTHCARE INVESTORS	275,000.00	283,937.50	
ONCURE MEDICAL CORP	800,000.00	802,000.00	
OXEA FINANCE/CY SCA	675,000.00	737,437.50	
P.H. GLATFELTER	1,425,000.00	1,467,750.00	
P.H. GLATFELTER	300,000.00	309,000.00	

	PACKAGING DYNAMICS CORP	50,000.00	51,625.00	
	PAETEC HOLDING CORP	875,000.00	947,187.50	
	PALACE ENT HLDG LLC/CORP	150,000.00	153,750.00	
	PANTRY INC	1,100,000.00	1,113,750.00	
	PARKER DRILLING CO	250,000.00	270,625.00	
	PATHEON INC	475,000.00	486,875.00	
	PATRIOT COAL CORP	400,000.00	429,000.00	
	PEABODY ENERGY CORP	700,000.00	790,125.00	
	PENINSULA GAMING LLC	75,000.00	80,625.00	
	PENN NATIONAL GAMING INC	300,000.00	334,500.00	
	PENN VIRGINIA RESOURCE	575,000.00	613,812.50	
	PERRY ELLIS INTL INC	250,000.00	259,375.00	
	PETROHAWK ENERGY CORP	675,000.00	776,250.00	
	PETROHAWK ENERGY CORP	400,000.00	415,000.00	
	PETROLEUM DEVELOPMENT CO	1,025,000.00	1,153,125.00	
	PETROPLUS FINANCE LTD	675,000.00	634,500.00	
	PHARMANET DEVELOPMENT GR	150,000.00	165,750.00	
	PHH CORP	375,000.00	409,687.50	
	PHIBRO ANIMAL HEALTH COR	275,000.00	294,937.50	
	PINAFORE LLC/INC	675,000.00	735,750.00	
	PINNACLE ENTERTAINMENT	375,000.00	410,625.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRO	65,000.00	68,168.75	
	PLAINS EXPLORATION & PRO	500,000.00	561,250.00	

	PLAINS EXPLORATION & PRO	275,000.00	297,000.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRO	450,000.00	454,990.50	
	PLAINS EXPLORATION 7% 3/	550,000.00	573,375.00	
	PLASTIPAK HOLDINGS INC	300,000.00	343,500.00	
	POKAGON GAMING AUTHORITY	650,000.00	676,000.00	
	POLYONE CORP	300,000.00	316,125.00	
	POLYPORE INTERNATIONAL I	200,000.00	208,500.00	
	PRESTIGE BRANDS INC	955,000.00	1,007,525.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	PRESTIGE BRANDS INC	175,000.00	184,625.00	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	600,000.00	746,250.00	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	250,000.00	285,937.50	
	PROQUEST LLC/PROQUEST	450,000.00	466,875.00	
	PROVIDENT FDG/PFG FIN	150,000.00	156,750.00	
	PUBLIC SERVICE CO OF NEW	550,000.00	619,218.60	
	PUGET ENERGY INC	275,000.00	276,438.25	
	QUEBECOR MEDIA	425,000.00	442,531.25	
	QUICKSILVER RESOURCE	1,700,000.00	1,691,500.00	
	QVC INC	150,000.00	158,250.00	
	QVC INC	1,075,000.00	1,134,125.00	
	QVC INC	275,000.00	288,750.00	
	QWEST COMMUNICATIONS INT	850,000.00	864,875.00	
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	250,000.00	269,375.00	
	REGENCY ENERGY PARTNERS	775,000.00	879,625.00	
	REGENCY ENERGY PARTNERS	400,000.00	424,000.00	
	RELIANCE INTERMEDIATE HO	700,000.00	764,750.00	
	RENT-A-CENTER INC	275,000.00	272,250.00	
	RES-CARE INC	525,000.00	573,562.50	
	REYNOLDS GROUP HOLDINGS	200,000.00	202,000.00	
	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	400,000.00	410,000.00	
	RITE AID CORP	825,000.00	876,562.50	

ROADHOUSE FINANCING INC	425,000.00	460,062.50	
ROOFING SUPPLY/FINANCE	600,000.00	631,500.00	
ROTECH HEALTHCARE INC	250,000.00	274,375.00	
ROTECH HEALTHCARE INC	150,000.00	149,625.00	
RYLAND GROUP	425,000.00	420,750.00	
SABINE PASS LNG LP	1,400,000.00	1,438,500.00	
SABRA HEALTH/CAPTL CORP	200,000.00	212,500.00	
SALEM COMMUNICATIONS	316,000.00	344,045.00	
SANDRIDGE ENERGY INC	500,000.00	553,750.00	
SANDRIDGE ENERGY INC	500,000.00	545,000.00	
SANDRIDGE ENERGY INC	375,000.00	385,781.25	
SCIENTIFIC GAMES CORP	250,000.00	265,000.00	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	250,000.00	275,312.50	
SCOTTS MIRACLE-GRO CO/TH	175,000.00	186,156.25	
SEALED AIR CORP	450,000.00	504,244.35	
SEITEL ACQUISITION CORP	900,000.00	906,750.00	
SEMINOLE TRIBE OF FLORID	300,000.00	316,500.00	
SENECA GAMING CORP	650,000.00	667,875.00	
SERVICE CORP INTL	875,000.00	961,406.25	
SESI LLC	1,965,000.00	2,014,125.00	
SGS INTERNATIONAL INC	1,575,000.00	1,626,187.50	
SM ENERGY CO	75,000.00	76,875.00	
SMITHFIELD FOODS INC	1,200,000.00	1,417,500.00	
SNOQUALMIE ENT AUTH	1,800,000.00	1,800,000.00	
SOLO CUP COMPANY	850,000.00	888,250.00	
SPECTRUM BRANDS INC	550,000.00	609,812.50	

	SPEEDWAY MOTORSPORTS INC	325,000.00	357,500.00	
	SPEEDWAY MOTORSPORTS INC	100,000.00	101,250.00	
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	375,000.00	387,656.25	
	SPRINGLEAF FINANCE CORP	1,000,000.00	915,000.00	
	SPRINT CAPITAL CORP	1,175,000.00	1,257,250.00	
	SPRINT NEXTEL CORP	2,375,000.00	2,671,875.00	
	STANDARD PACIFIC CORP	600,000.00	628,500.00	
	STANDARD PACIFIC CORP	350,000.00	366,625.00	
	STANDARD PACIFIC CORP	150,000.00	156,750.00	
	STAR GAS PARTNER/FINANCE	225,000.00	232,312.50	
	STARWOOD HOTELS & RESORT	650,000.00	710,125.00	
	STEEL DYNAMICS INC	1,000,000.00	1,032,500.00	
	STEINWAY MUSICAL INSTRUM	1,850,000.00	1,882,375.00	
	STONERIDGE INC	325,000.00	360,750.00	
	STRATUS TECHNOLOGIES INC	875,000.00	809,375.00	
	SUPERVALU INC	1,825,000.00	1,834,125.00	
	SYNCREON GLOBAL IRE/FIN	400,000.00	413,000.00	
	TALECRIS BIOTHERAPEUTICS	600,000.00	663,000.00	
	TARGA RESOURCES PARTNERS	425,000.00	448,375.00	
	TARGA RESOURCES PARTNERS	350,000.00	347,375.00	
	TENASKA ALABAMA PART	318,815.51	336,350.36	
	TENET HEALTHCARE CORP	400,000.00	457,000.00	
	TENNECO INC	225,000.00	241,875.00	
	TESORO CORP	475,000.00	541,500.00	

	THERMADYNE HOLDINGS CORP	250,000.00	265,312.50	
	THERMON INDUSTRIES INC	200,000.00	217,000.00	
	TITAN INTERNATIONAL INC	475,000.00	505,875.00	
	TOLL BROS FINANCE CORP	725,000.00	843,571.57	
	TOLL BROS FINANCE CORP	225,000.00	229,900.27	
	TOPS MARKETS	325,000.00	351,812.50	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	TOYS R US DELAWARE INC	425,000.00	447,312.50	
	TPC GROUP LLC	275,000.00	289,781.25	
	TRANS UNION LLC/TRANSUNI	375,000.00	431,250.00	
	TRINIDAD DRILLING LTD	250,000.00	264,375.00	
	TRIUMPH GROUP INC	275,000.00	293,562.50	
	TUBE CITY IMS CORP	2,150,000.00	2,257,500.00	
	UNITED AUTO GROUP INC	2,619,000.00	2,720,486.25	
	UNITED MARITIME LLC/CORP	575,000.00	595,125.00	
	UNITED REFINING	150,000.00	149,062.50	
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	375,000.00	364,687.50	
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	550,000.00	574,750.00	
	UNIVISION COMMUNICATIONS	250,000.00	271,562.50	
	UNIVISION COMMUNICATIONS	500,000.00	533,750.00	
	UPC GERMANY GMBH	400,000.00	424,000.00	
	UPC HOLDING BV	900,000.00	1,003,500.00	
	US STEEL CORP	150,000.00	156,375.00	
	US STEEL CORP	275,000.00	290,812.50	
	USG CORP	400,000.00	436,000.00	
	VALASSIS COMMUNICATION	350,000.00	343,000.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	150,000.00	153,187.50	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	500,000.00	510,625.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	250,000.00	251,250.00	

	VALEANT PHARMACEUTICALS	550,000.00	540,375.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	250,000.00	251,250.00	
	VANGUARD HLT HDG LLC/INC	650,000.00	663,000.00	
	VERSO PAPER HLDGS LLC/IN	150,000.00	156,750.00	
	VISKASE COS INC	350,000.00	376,250.00	
	WEST CORP	350,000.00	368,812.50	
	WEST CORP	350,000.00	355,250.00	
	WESTERN REFINING INC	625,000.00	712,500.00	
	WIND ACQUISITION FIN SA	400,000.00	418,000.00	
	WIND ACQUISITION HOLDING	312,698.00	379,146.32	
	WINDSTREAM CORP	2,020,000.00	2,146,250.00	
	WINDSTREAM CORP	375,000.00	405,000.00	
	WINDSTREAM CORP	275,000.00	293,562.50	
	WINDSTREAM CORP	375,000.00	381,562.50	
	WMG ACQUISITION CORP	150,000.00	159,562.50	
	WYLE SERVICES CORP	250,000.00	263,750.00	
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	575,000.00	610,218.75	
	XM SATELLITE RADIO INC	550,000.00	587,125.00	
米ドル計	銘柄数：453	261,563,513.51	272,348,701.76	
			(22,204,589,654)	
	組入時価比率：95.8%		100%	
社債券計			22,204,589,654	
			(22,204,589,654)	
合計			22,204,589,654	
			(22,204,589,654)	

(注) 1 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

- 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。
- 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	平成23年3月28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	534,600,000		538,032,000	3,432,000
米ドル	534,600,000		538,032,000	3,432,000
合計	534,600,000		538,032,000	3,432,000

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

計算期間末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。

- ・ 計算期間末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。
- ・ 計算期間末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) 計算期間末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、計算期間末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

原届出書の 第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

純資産額計算書

平成23年4月28日現在

「Aコース」

資産総額	8,138,039,590	円
負債総額	4,005,220,656	円
純資産総額(-)	4,132,818,934	円
発行済口数	4,943,936,985	口
1口当たり純資産額(/)	0.8359	円

「Bコース」

資産総額	6,944,494,748	円
負債総額	42,898,287	円
純資産総額(-)	6,901,596,461	円
発行済口数	11,937,504,033	口
1口当たり純資産額(/)	0.5781	円

<ご参考>

「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」

資産総額	23,412,192,681	円
負債総額	36,100,000	円
純資産総額(-)	23,376,092,681	円
発行済口数	6,719,054,893	口
1口当たり純資産額(/)	3.4791	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

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1) 資本金の額

平成22年10月末現在、17,180百万円

(以下 略)

<訂正後>

(1) 資本金の額

平成23年4月末現在、17,180百万円

(以下 略)

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

「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平成23年3月31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	719	10,878,900
単位型株式投資信託	23	246,494
追加型公社債投資信託	19	4,797,502
単位型公社債投資信託	0	0

合計	761	15,922,896
----	-----	------------

3 委託会社等の経理状況

[次へ](#)

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

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 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 につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(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。

* 平成23年3月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引 業を営んでいます。
アーク証券株式会社	2,619百万円	
いちよし証券株式会社	14,577百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
光世証券株式会社	12,000百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証 券株式会社 ¹	3,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
株式会社SBI証券	47,937百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社 千葉銀行 ¹	145,069百万円	

* 平成23年3月末現在

1 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社および株式会社 千葉銀行は新規の募集・販売は行ないません。

(3) 投資顧問会社

(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)	42,000,000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。

* 平成23年3月末現在

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況 の該当部分を以下のように訂正するとともに、末尾に添付のように、最近中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)の中間財務諸表(以下「中間財務諸表」といいます。)が追加されます。

下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

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。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号により改正されておりますが、第50期事業年度(前事業年度)は、内閣府令第50号改正前の財務諸表等規則に基づき作成しており、第51期事業年度(当事業年度)は、内閣府令第50号改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度及び当事業年度の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

<訂正後>

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。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号により改正されておりますが、第50期事業年度(前事業年度)は改正前、第51期事業年度(当事業年度)は改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度及び当事業年度の財務諸表ならびに当中間会計期間の中間財務諸表について、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。

< 中間財務諸表 >

中間貸借対照表

		平成22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		1,452
金銭の信託		38,874
有価証券		2,300
短期貸付金		186
未収委託者報酬		10,177
未収収益		3,318
繰延税金資産		1,118
その他		260
貸倒引当金		6
流動資産計		57,681
固定資産		
有形固定資産	1	1,609
無形固定資産		11,109
ソフトウェア		11,106
その他		2
投資その他の資産		26,021
投資有価証券		8,177
関係会社株式		16,099
繰延税金資産		937
その他		807
貸倒引当金		0
固定資産計		38,740
資産合計		96,421

		平成22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		
関係会社短期借入金		10,000
未払収益分配金		4
未払償還金		60
未払手数料		4,495
その他未払金	2	1,878
未払費用		7,118
未払法人税等		669
賞与引当金		1,518
その他		93
流動負債計		25,839
固定負債		
退職給付引当金		4,520
時効後支払損引当金		482
その他		22
固定負債計		5,025
負債合計		30,865
(純資産の部)		
株主資本		63,157
資本金		17,180
資本剰余金		11,729
資本準備金		11,729
利益剰余金		34,247
利益準備金		685
その他利益剰余金		33,561
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		8,955
評価・換算差額等		2,399
その他有価証券評価差額金		2,415
繰延ヘッジ損益		16
純資産合計		65,556
負債・純資産合計		96,421

中間損益計算書

		自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22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		39,377
運用受託報酬		5,636
その他営業収益		61
営業収益計		45,075
営業費用		
支払手数料		18,603
調査費		10,459
その他営業費用		2,321
営業費用計		31,385
一般管理費	1	12,045
営業利益		1,645
営業外収益	2	3,121
営業外費用	3	48
経常利益		4,718
特別利益	4	513
特別損失	5	155
税引前中間純利益		5,077
法人税、住民税及び事業税		1,862
法人税等調整額		527
中間純利益		2,687

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間

（単位：百万円）

	自 平成22年 4月 1日
	至 平成22年 9月30日
株主資本	
資本金	
前期末残高	17,180
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	17,180
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	11,729
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,729
資本剰余金合計	
前期末残高	11,729
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,729
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	685
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	685
その他利益剰余金	
別途積立金	
前期末残高	24,606
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	24,606
繰越利益剰余金	
前期末残高	9,872
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
当中間期変動額合計	917
当中間期末残高	8,955
利益剰余金合計	
前期末残高	35,164

当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
当中間期変動額合計	917
当中間期末残高	34,247
株主資本合計	
前期末残高	64,074
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
当中間期変動額合計	917
当中間期末残高	63,157
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	3,056
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	640
当中間期変動額合計	640
当中間期末残高	2,415
繰延ヘッジ損益	
前期末残高	175
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	192
当中間期変動額合計	192
当中間期末残高	16
評価・換算差額等合計	
前期末残高	3,231
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	832
当中間期変動額合計	832
当中間期末残高	2,399
純資産合計	
前期末残高	67,306
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,605
中間純利益	2,687
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	832
当中間期変動額合計	1,749
当中間期末残高	65,556

[中間財務諸表作成の基本となる重要な事項]

	自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの...移動平均法による原価法</p>
2 デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	時価法
3 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
4 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。</p> <p>(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。ただし、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に基づく定額法によっております。</p>
5 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(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。 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債務は、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。</p> <p>(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。</p>
6 リース取引の処理方法	<p>リース取引開始日が平成20年4月1日より前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>

	自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
7 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益を、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで資産または負債として繰り延べる方法によっております。 また、為替予約が付されている外貨建金銭債権については、振当処理を行っております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約 ヘッジ対象 - 投資有価証券、短期貸付金 (3) ヘッジ方針 投資有価証券及び短期貸付金に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスクのヘッジにつきましては、そのリスク減殺効果を、対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を確かめております。
8 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
9 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

[中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更]

	自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日
資産除去債務に関する会計基準	当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年 3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年 3月31日）を適用しております。 これによる損益への影響はありません。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

平成22年 9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	2,221百万円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

中間損益計算書関係

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	205百万円
無形固定資産	2,093百万円
長期前払費用	4百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	1,346百万円
金銭の信託運用益	1,554百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	38百万円
4 特別利益の内訳	
投資有価証券売却益	419百万円
株式報酬受入益	94百万円
5 特別損失の内訳	
投資有価証券売却損	149百万円
投資有価証券等評価損	6百万円

中間株主資本等変動計算書関係

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日					
1 発行済株式に関する事項					
	株式の種類	平成22年 3月末	増加	減少	平成22年 9月末
	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				
	平成22年 5月27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		3,605百万円		
	(2) 1株当たり配当額		700円		
	(3) 基準日		平成22年 3月31日		
	(4) 効力発生日		平成22年 6月 1日		

リース取引関係

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日	
1 ファイナンス・リース取引	
(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) 該当事項はありません。	
(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額	
有形固定資産（器具備品）	
取得価額相当額	460百万円
減価償却累計額相当額	325
中間期末残高相当額	135
未経過リース料中間期末残高相当額	
1年内	88百万円
1年超	53
合計	141
支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額	
支払リース料	56百万円
減価償却費相当額	52
支払利息相当額	2
減価償却費相当額の算定方法	
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	
利息相当額の算定方法	
リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については利息法によっております。	
2 オペレーティング・リース取引	
未経過リース料	
1年内	7百万円
1年超	7
合計	14

金融商品関係

当中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成22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。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,452	1,452	-
(2)金銭の信託	38,874	38,874	-
(3)短期貸付金	186	186	-
(4)未収委託者報酬	10,177	10,177	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	9,681	9,681	-
(6)関係会社株式	3,064	68,074	65,010
資産計	63,436	128,446	65,010
(7)関係会社短期借入金	10,000	10,000	-
(8)未払金	6,439	6,439	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	60	60	-
未払手数料	4,495	4,495	-
その他未払金	1,878	1,878	-
(9)未払費用	7,118	7,118	-
(10)未払法人税等	669	669	-
負債計	24,227	24,227	-
(11)デリバティブ取引（*）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	22	22	-
デリバティブ取引計	22	22	-

（*）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(3)短期貸付金、(4)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。ただし、短期貸付金は為替予約等の振当処理の対象とされており、円貨建債権とみて当該帳簿価額を以って時価としております。「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価格、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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

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

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（中間貸借対照表計上額：投資有価証券796百万円、関係会社株式13,035百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

有価証券関係

当中間会計期間末（平成22年9月30日）

1. 満期保有目的の債券(平成22年9月30日)

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式(平成22年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	68,074	65,010
合計	3,064	68,074	65,010

3. その他有価証券(平成22年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの			
株式	4,541	282	4,258
投資信託	1	1	0
小計	4,542	283	4,258
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託(1)	2,839	3,003	163
譲渡性預金	2,300	2,300	-
小計	5,139	5,303	163
合計	9,681	5,586	4,094

- (1) 当中間会計期間において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ利益は 16百万円（税効果会計適用後）であり、中間貸借対照表に計上しております。

デリバティブ取引関係

当中間会計期間（自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	2,809	-	22	先物為替相場によっている
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	186	-	(*1) -	-
合 計			2,996	-	(*1) 22	-

(*1) 為替予約等の振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている短期貸付金と一体として処理されるため、その時価は当該短期貸付金の時価に含めて記載しております。

セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成22年 4月 1日 至 平成22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

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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(追加情報)

当中間会計期間より「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

1 株当たり情報

自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日	
1 株当たり純資産額	12,727円70銭
1 株当たり中間純利益	521円87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、新株予約権付社債等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	2,687百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,687百万円
期中平均株式数	5,150千株

独立監査人の中間監査報告書

平成22年11月24日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	英 公 一
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀 井 純 子
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 志 保

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平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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平成22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（平成22年4月1日から平成22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。

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) 上記は、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成22年11月11日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公 一指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイ・イールド ボンド オープンAコースの平成22年3月30日から平成22年9月28日までの計算期間の財務諸表、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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイ・イールド ボンド オープンAコースの平成22年9月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

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. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年11月11日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公 一指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイ・イールド ボンド オープン B コースの平成22年3月30日から平成22年9月28日までの計算期間の財務諸表、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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイ・イールド ボンド オープン B コースの平成22年9月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

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. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成23年5月13日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公 一指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイ・イールド ボンド オープンAコースの平成22年9月29日から平成23年3月28日までの計算期間の財務諸表、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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイ・イールド ボンド オープンAコースの平成23年3月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

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. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年5月13日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 英 公 一指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイ・イールド ボンド オープン B コースの平成22年9月29日から平成23年3月28日までの計算期間の財務諸表、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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイ・イールド ボンド オープン B コースの平成23年3月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

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. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)