

【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12月8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】	ハイブリッド・インカムオープン
【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23年6月9日から平成24年6月7日まで) 1兆円を上限とします。 *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23年6月8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%

<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10月末現在、17,180百万円

(中略)

・大株主の状況(平成23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%

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)

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

シティグループ世界国債インデックス(除く日本)の採用国

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

上記は、平成23年4月末現在の、シティグループ世界国債インデックス（除く日本）の採用国です。なお、採用国は今後変更される場合があります。

(以下 略)

<訂正後>

(1)投資方針

(前略)

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

シティグループ世界国債インデックス(除く日本)の採用国

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

上記は、平成23年10月末現在の、シティグループ世界国債インデックス（除く日本）の採用国です。なお、採用国は今後変更される場合があります。

(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23年6月8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12月8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正前>

(4)分配方針

年6回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

（中略）

* 委託会社の判断により分配を行なわない場合もあります。

（以下 略）

<訂正後>

(4)分配方針

年6回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

（中略）

* 委託会社の判断により分配を行なわない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

（以下 略）

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>

基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特にファンドが実質的に投資を行なうハイ・イールド・ボンド等の格付けの低い債券については、格付けの高い債券に比べ、価格が大きく変動する可能性や組入債券の元利金の支払遅延および支払不履行などが生じるリスクが高いと想定されます。

（中略）

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）

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8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>

基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特にファンドが実質的に投資を行なうハイ・イールド・ボンド等の格付の低い債券については、格付の高い債券に比べ、価格が大きく変動する可能性や組入債券の元利金の支払遅延および支払不履行などが生じるリスクが高いと想定されます。

（中略）

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）

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、預貯金の利息とは異なり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12月8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4 手数料等及び税金

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>

(5)課税上の取扱い

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>

平成23年12月31日までの間は、分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）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（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

<換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

平成23年12月31日までの間は、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10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行なわれます。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

平成23年12月31日までの間は、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、7%（所得税7%）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。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、益金不算入制度は適用されません。

(以下略)

<訂正後>

(5)課税上の取扱い

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 >

平成25年12月31日までの間は、分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）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（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

平成25年12月31日までの間は、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10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行なわれます。上記10%の税率は平成26年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

平成25年12月31日までの間は、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、7%（所得税7%）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。上記7%の税率は平成26年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、益金不算入制度は適用されません。

（以下 略）

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10月31日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)投資状況

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	8,854,381,848	100.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,017,825	0.09
合計(純資産総額)		8,846,364,023	100.00

<ご参考>

「海外アクティブ債券マザーファンド」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	3,362,278,607	35.23
	カナダ	310,067,598	3.24
	イギリス	1,078,707,964	11.30
	スウェーデン	293,061,037	3.07
	ノルウェー	46,149,180	0.48
	デンマーク	55,456,744	0.58
	ドイツ	872,145,057	9.13
	イタリア	1,172,624,120	12.28
	フランス	960,089,763	10.06
	オランダ	230,428,301	2.41
	スペイン	439,423,656	4.60
	ベルギー	374,967,935	3.92
	ポーランド	37,730,647	0.39
	オーストラリア	41,494,019	0.43
小計		9,274,624,628	97.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		267,952,373	2.80
合計(純資産総額)		9,542,577,001	100.00

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

名称	取引所	種類	買建 /売建	通貨	枚数	簿価 (現地通貨)	評価額(時価・ 現地通貨)	評価額 (時価・円)	投資 比率 (%)
T-NOTE先物(5年) (2011年12月限)	シカゴ・ボード・ オブ・トレード	債券先物	買建	米ドル	70	8,573,671.75	8,544,375	664,325,156	6.96
BOBL先物(2011年12月限)	EUREX	債券先物	買建	ユーロ	21	2,573,550	2,551,080	279,878,986	2.93
SCHATZ先物(2011年12月限)	EUREX	債券先物	売建	ユーロ	25	2,748,125	2,737,875	300,372,266	3.14

「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	18,793,695,454	93.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,218,366,425	6.08
合計(純資産総額)		20,012,061,879	100.00

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

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	1,346,213,454	3.1674	4,263,996,495	3.3114	4,457,851,231	50.39
2	日本	投資信託受益証券	海外アクティブ債券マザーファンド	3,706,399,104	1.1685	4,330,927,354	1.1862	4,396,530,617	49.69

<ご参考>

「海外アクティブ債券マザーファンド」

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	7,652.16	497,390,414	8,101.79	526,616,517	2.625	2020/8/15	5.51
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	8,475.78	423,789,010	8,612.63	430,631,709	3.375	2019/11/15	4.51
3	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000	11,331.09	396,588,484	10,887.62	381,066,714	4.25	2013/8/1	3.99
4	ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,300,000	11,575.42	381,989,155	11,362.66	374,967,935	4.25	2014/9/28	3.92
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	8,176.80	367,956,400	8,203.23	369,145,450	2.375	2014/9/30	3.86
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	9,032.27	325,162,017	10,126.93	364,569,750	5	2037/5/15	3.82
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	8,198.51	336,139,248	8,025.25	329,035,570	4.875	2012/6/30	3.44
8	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,600,000	11,662.80	303,232,954	11,642.42	302,703,055	3.5	2015/4/25	3.17
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	10,431.28	239,919,490	11,309.58	260,120,508	6.25	2030/5/15	2.72
10	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000	14,486.75	246,274,813	15,172.89	257,939,181	6.25	2024/1/4	2.70
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,900,000	8,473.19	245,722,655	8,700.71	252,320,617	3.5	2018/2/15	2.64
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000	11,206.87	280,171,912	9,834.40	245,860,110	4.25	2019/9/1	2.57
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,900,000	7,878.69	228,482,054	8,110.29	235,198,609	1.875	2015/6/30	2.46
14	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,900,000	12,112.27	230,133,181	12,239.24	232,545,704	3.75	2017/1/4	2.43
15	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,450,000	15,885.50	230,339,808	15,951.90	231,302,584	8	2015/12/7	2.42
16	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,800,000	12,133.80	218,408,473	12,207.43	219,733,770	3.5	2019/7/4	2.30
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,700,000	12,242.99	208,130,841	12,026.41	204,448,973	4.5	2041/4/25	2.14
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	2,400,000	7,865.96	188,783,220	7,805.67	187,336,192	1.375	2012/2/15	1.96
19	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,200,000	13,517.71	162,212,544	15,264.11	183,169,382	4.75	2038/12/7	1.91
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	8,176.20	179,876,436	8,191.69	180,217,202	2.375	2014/8/31	1.88
21	オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000	12,133.92	169,874,964	12,266.67	171,733,451	4	2019/7/15	1.79
22	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,300,000	13,383.66	173,987,611	12,883.79	167,489,337	5.25	2012/6/7	1.75
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000	11,370.34	170,555,166	11,021.24	165,318,707	5	2012/2/1	1.73
24	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	13,000,000	1,307.64	169,993,687	1,260.68	163,888,920	5.5	2012/10/8	1.71
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,300,000	12,305.07	159,965,956	11,859.65	154,175,463	4.25	2023/10/25	1.61
26	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,050,000	13,917.35	146,132,229	14,565.05	152,933,054	4.5	2019/3/7	1.60
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,420,000	12,106.49	171,912,278	10,739.51	152,501,068	5.25	2017/8/1	1.59
28	カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000	8,510.96	144,686,349	8,743.97	148,647,645	4	2017/6/1	1.55
29	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	1,200,000	11,873.91	142,486,959	11,356.08	136,272,985	5.5	2017/7/30	1.42
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000	13,721.42	137,214,297	13,259.55	132,595,506	5.5	2029/4/25	1.38

「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	GEORGIA-PACIFIC LLC	2,450,000	8,807.25	215,777,763	10,154.20	248,778,008	8	2024/1/15	1.24
2	アメリカ	社債券	CHOCTAW RESORT DEVEL ENT	4,748,000	4,762.18	226,108,662	4,859.37	230,723,125	7.25	2019/11/15	1.15
3	アメリカ	社債券	SPRINT NEXTEL CORP	2,375,000	7,677.81	182,348,046	7,269.62	172,653,593	8.375	2017/8/15	0.86
4	アメリカ	社債券	EL PASO CORP	1,950,000	8,245.86	160,794,456	8,552.50	166,773,750	7.42	2037/2/15	0.83
5	アメリカ	社債券	SUPERVALU INC	1,825,000	7,736.12	141,184,281	7,930.50	144,731,625	7.5	2014/11/15	0.72
6	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL INC	1,800,000	7,114.12	128,054,250	7,930.50	142,749,000	8	2031/11/1	0.71
7	アメリカ	社債券	HCA INC	1,625,000	8,173.46	132,818,867	8,513.62	138,346,406	7.875	2020/2/15	0.69
8	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	1,450,000	8,943.89	129,686,455	9,482.56	137,497,247	8.125	2020/1/15	0.68
9	アメリカ	社債券	ALLY FINANCIAL INC	1,675,000	7,444.56	124,696,421	8,163.74	136,742,812	8	2020/3/15	0.68
10	アメリカ	社債券	SNOQUALMIE ENT AUTH	1,800,000	7,561.18	136,101,375	7,580.62	136,451,250	9.125	2015/2/1	0.68
11	アメリカ	社債券	FRONTIER COMMUNICATIONS	1,625,000	8,017.96	130,291,992	8,319.24	135,187,812	8.125	2018/10/1	0.67
12	アメリカ	社債券	CALPINE CORP	1,600,000	7,794.43	124,711,000	8,397.00	134,352,000	7.875	2020/7/31	0.67
13	アメリカ	社債券	QUICKSILVER RESOURCE	1,700,000	7,153.00	121,601,000	7,736.12	131,514,125	7.125	2016/4/1	0.65
14	アメリカ	社債券	CIT GROUP INC	1,600,000	7,580.62	121,290,000	7,804.15	124,866,500	7	2016/5/2	0.62
15	アメリカ	社債券	SGS INTERNATIONAL INC	1,575,000	7,813.87	123,068,531	7,891.62	124,293,093	12	2013/12/15	0.62
16	アメリカ	社債券	BAKER & TAYLOR INC	1,950,000	5,870.12	114,467,437	6,181.12	120,531,937	11.5	2013/7/1	0.60
17	アメリカ	社債券	HCA INC	1,475,000	7,405.68	109,233,890	7,969.37	117,548,281	7.5	2022/2/15	0.58
18	アメリカ	社債券	AGY HOLDING CORP	1,950,000	5,675.75	110,677,125	5,772.93	112,572,281	11	2014/11/15	0.56
19	アメリカ	社債券	CABLEVISION SYSTEMS CORP	1,300,000	8,280.37	107,644,875	8,552.50	111,182,500	8.625	2017/9/15	0.55
20	アメリカ	社債券	CIT GROUP INC	1,400,000	7,561.18	105,856,625	7,843.03	109,802,437	5.25	2014/4/1	0.54
21	アメリカ	社債券	SABINE PASS LNG LP	1,400,000	7,658.37	107,217,250	7,794.43	109,122,125	7.25	2013/11/30	0.54
22	アメリカ	社債券	DISH DBS CORP	1,250,000	8,183.18	102,289,843	8,591.37	107,392,187	7.875	2019/9/1	0.53
23	アメリカ	社債券	METROPCS WIRELESS INC	1,300,000	7,804.15	101,454,031	8,008.25	104,107,250	7.875	2018/9/1	0.52
24	アメリカ	社債券	EXPRESS LLC	1,210,000	8,241.50	99,722,150	8,377.56	101,368,506	8.75	2018/3/1	0.50
25	アメリカ	社債券	INTL LEASE FINANCE CORP	1,225,000	7,891.62	96,672,406	8,270.65	101,315,539	8.75	2017/3/15	0.50
26	アメリカ	社債券	CASE NEW HOLLAND INC	1,110,000	8,445.59	93,746,090	8,785.75	97,521,825	7.875	2017/12/1	0.48
27	アメリカ	社債券	ICAHN ENTERPRISES/FIN	1,175,000	7,833.31	92,041,421	8,027.68	94,325,328	8	2018/1/15	0.47
28	アメリカ	社債券	DIGICEL GROUP LTD	1,200,000	7,514.53	90,174,450	7,852.75	94,233,000	8.25	2017/9/1	0.47
29	アメリカ	社債券	LUCENT TECHNOLOGIES	1,379,000	6,579.59	90,732,597	6,803.12	93,815,093	6.45	2029/3/15	0.46
30	アメリカ	社債券	QVC INC	1,075,000	8,513.62	91,521,468	8,494.18	91,312,515	7.5	2019/10/1	0.45

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率 (%)
投資信託受益証券		100.09
合計		100.09

<ご参考>

「海外アクティブ債券マザーファンド」

種類	業種	投資比率 (%)
国債証券		97.19
合計		97.19

「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		93.91
合計		93.91

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。

<ご参考>

「海外アクティブ債券マザーファンド」

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

名称	取引所	種類	買建 / 売建	通貨	枚数	簿価 (現地通貨)	評価額(時価・ 現地通貨)	評価額 (時価・円)	投資 比率 (%)
T-NOTE先物(5年) (2011年12月限)	シカゴ・ボード・ オブ・トレード	債券先物	買建	米ドル	70	8,573,671.75	8,544,375	664,325,156	6.96
BOBL先物(2011年12月限)	EUREX	債券先物	買建	ユーロ	21	2,573,550	2,551,080	279,878,986	2.93
SCHATZ先物(2011年12月限)	EUREX	債券先物	売建	ユーロ	25	2,748,125	2,737,875	300,372,266	3.14

(3)運用実績

純資産の推移

平成23年10月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	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1特定期間	2004年6月23日～2004年9月15日	6,675	6,749	1.0334	1.0449
第2特定期間	2004年9月16日～2005年3月15日	14,303	14,414	1.0328	1.0408
第3特定期間	2005年3月16日～2005年9月15日	23,756	23,936	1.0607	1.0687
第4特定期間	2005年9月16日～2006年3月15日	26,790	26,986	1.0910	1.0990
第5特定期間	2006年3月16日～2006年9月15日	26,829	27,036	1.1041	1.1126
第6特定期間	2006年9月16日～2007年3月15日	24,477	24,762	1.1185	1.1315
第7特定期間	2007年3月16日～2007年9月18日	22,344	22,602	1.0792	1.0917
第8特定期間	2007年9月19日～2008年3月17日	18,236	18,392	0.9378	0.9458
第9特定期間	2008年3月18日～2008年9月16日	17,135	17,288	0.9477	0.9562
第10特定期間	2008年9月17日～2009年3月16日	12,927	13,064	0.7586	0.7666
第11特定期間	2009年3月17日～2009年9月15日	13,526	13,657	0.8226	0.8306
第12特定期間	2009年9月16日～2010年3月15日	12,967	13,156	0.8222	0.8342
第13特定期間	2010年3月16日～2010年9月15日	11,676	11,859	0.7650	0.7770
第14特定期間	2010年9月16日～2011年3月15日	10,416	10,586	0.7345	0.7465
第15特定期間	2011年3月16日～2011年9月15日	8,853	9,013	0.6663	0.6783
	2010年10月末日	11,236		0.7555	
	11月末日	11,025		0.7534	
	12月末日	10,589		0.7302	
	2011年1月末日	10,602		0.7370	
	2月末日	10,541		0.7403	
	3月末日	10,550		0.7473	
	4月末日	10,657		0.7544	
	5月末日	10,351		0.7338	
	6月末日	10,097		0.7275	
	7月末日	9,574		0.6982	
	8月末日	9,162		0.6853	
	9月末日	8,652		0.6575	
	10月末日	8,846		0.6854	

特定期間末日における分配付の純資産及び単価を表示しております。

分配の推移

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2004年6月23日～2004年9月15日	0.0115 円
第2特定期間	2004年9月16日～2005年3月15日	0.0240 円
第3特定期間	2005年3月16日～2005年9月15日	0.0240 円
第4特定期間	2005年9月16日～2006年3月15日	0.0240 円
第5特定期間	2006年3月16日～2006年9月15日	0.0255 円
第6特定期間	2006年9月16日～2007年3月15日	0.0355 円
第7特定期間	2007年3月16日～2007年9月18日	0.0385 円
第8特定期間	2007年9月19日～2008年3月17日	0.0310 円
第9特定期間	2008年3月18日～2008年9月16日	0.0250 円
第10特定期間	2008年9月17日～2009年3月16日	0.0240 円
第11特定期間	2009年3月17日～2009年9月15日	0.0240 円
第12特定期間	2009年9月16日～2010年3月15日	0.0320 円
第13特定期間	2010年3月16日～2010年9月15日	0.0360 円
第14特定期間	2010年9月16日～2011年3月15日	0.0360 円
第15特定期間	2011年3月16日～2011年9月15日	0.0360 円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

収益率の推移

特定期間	計算期間	収益率
第1特定期間	2004年6月23日～2004年9月15日	4.5 %
第2特定期間	2004年9月16日～2005年3月15日	2.3 %
第3特定期間	2005年3月16日～2005年9月15日	5.0 %
第4特定期間	2005年9月16日～2006年3月15日	5.1 %
第5特定期間	2006年3月16日～2006年9月15日	3.5 %
第6特定期間	2006年9月16日～2007年3月15日	4.5 %
第7特定期間	2007年3月16日～2007年9月18日	0.1 %
第8特定期間	2007年9月19日～2008年3月17日	10.2 %
第9特定期間	2008年3月18日～2008年9月16日	3.7 %
第10特定期間	2008年9月17日～2009年3月16日	17.4 %
第11特定期間	2009年3月17日～2009年9月15日	11.6 %
第12特定期間	2009年9月16日～2010年3月15日	3.8 %
第13特定期間	2010年3月16日～2010年9月15日	2.6 %
第14特定期間	2010年9月16日～2011年3月15日	0.7 %
第15特定期間	2011年3月16日～2011年9月15日	4.4 %

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。

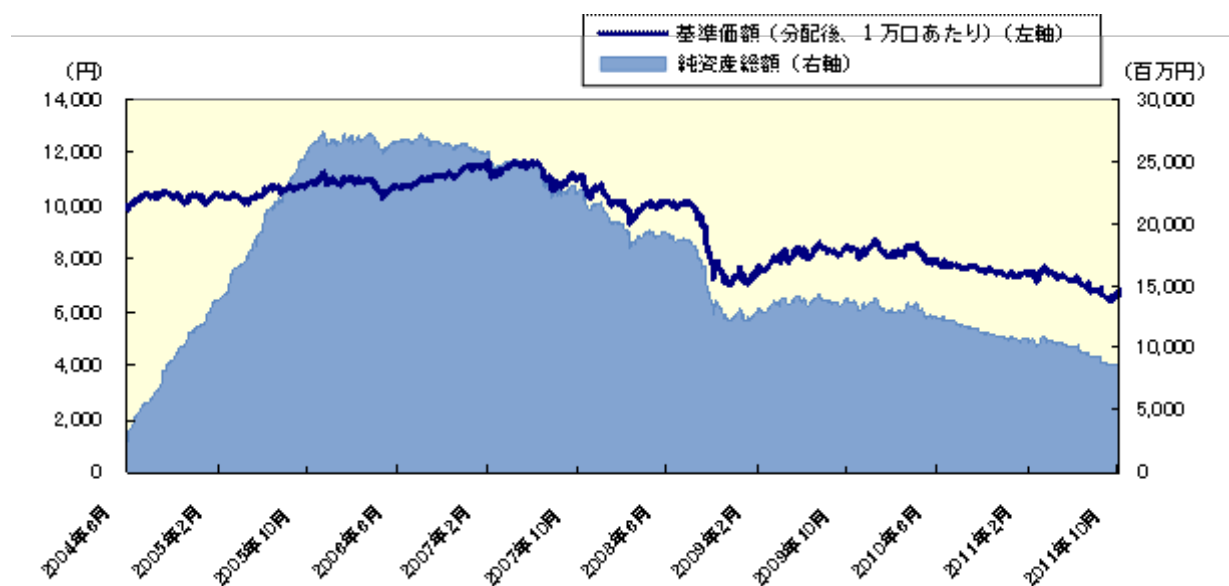
(4)設定及び解約の実績

特定期間	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2004年6月23日～2004年9月15日	6,531,624,041	71,739,587	6,459,884,454
第2特定期間	2004年9月16日～2005年3月15日	7,985,001,842	595,199,923	13,849,686,373
第3特定期間	2005年3月16日～2005年9月15日	10,608,534,558	2,060,411,177	22,397,809,754
第4特定期間	2005年9月16日～2006年3月15日	4,997,657,206	2,839,492,625	24,555,974,335
第5特定期間	2006年3月16日～2006年9月15日	2,076,333,043	2,331,854,599	24,300,452,779
第6特定期間	2006年9月16日～2007年3月15日	538,507,634	2,954,909,408	21,884,051,005
第7特定期間	2007年3月16日～2007年9月18日	379,281,205	1,559,866,077	20,703,466,133
第8特定期間	2007年9月19日～2008年3月17日	217,302,161	1,474,129,004	19,446,639,290
第9特定期間	2008年3月18日～2008年9月16日	139,116,644	1,505,612,833	18,080,143,101
第10特定期間	2008年9月17日～2009年3月16日	78,565,084	1,117,167,130	17,041,541,055
第11特定期間	2009年3月17日～2009年9月15日	93,323,090	690,901,367	16,443,962,778
第12特定期間	2009年9月16日～2010年3月15日	256,277,012	927,993,567	15,772,246,223
第13特定期間	2010年3月16日～2010年9月15日	782,976,436	1,291,554,865	15,263,667,794
第14特定期間	2010年9月16日～2011年3月15日	456,026,751	1,537,654,910	14,182,039,635
第15特定期間	2011年3月16日～2011年9月15日	513,671,562	1,408,295,043	13,287,416,154

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10月31日現在）

[基準価額・純資産の推移]（日次：設定来）



[分配の推移]（1万口あたり、課税前）

2011年9月	120 円
2011年7月	120 円
2011年5月	120 円
2011年3月	120 円
2011年1月	120 円
直近1年間累計	720 円
設定来累計	4,270 円

[主要な資産の状況]

銘柄別投資比率

銘柄	投資比率 (%)
海外アクティブ債券マザーファンド	49.7
ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド	50.4

実質的な銘柄別投資比率(上位)

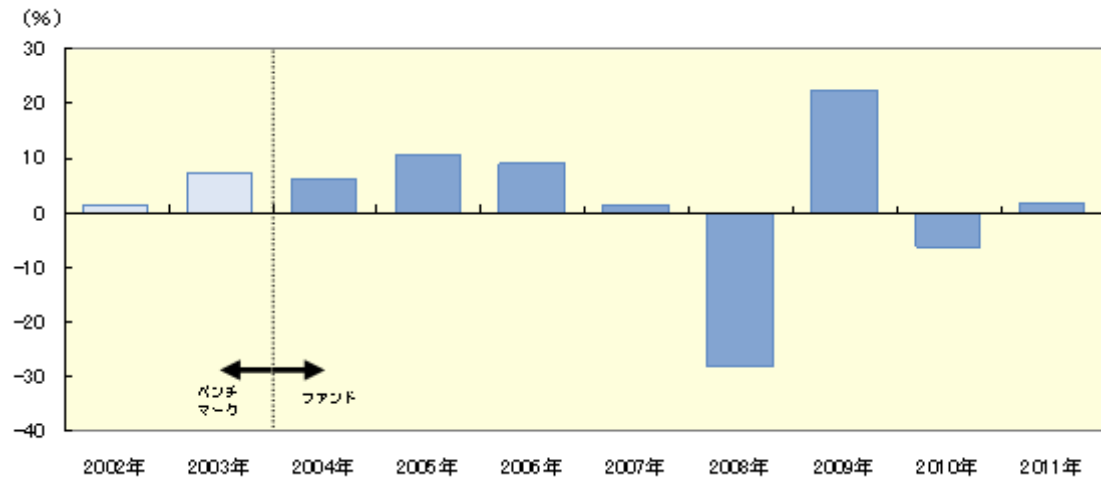
・「海外アクティブ債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	2.7
2	US TREASURY N/B	国債証券	2.2
3	BUONI POLIENALI DEL TES	国債証券	2.0
4	BELGIUM KINGDOM GOVT	国債証券	1.9
5	US TREASURY N/B	国債証券	1.9
6	US TREASURY N/B	国債証券	1.9
7	US TREASURY N/B	国債証券	1.7
8	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	1.6
9	US TREASURY N/B	国債証券	1.4
10	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.3

・「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	GEORGIA-PACIFIC LLC	社債券	0.6
2	CHDCTAWRESORT DEVEL ENT	社債券	0.6
3	SPRINT NEXTEL CORP	社債券	0.4
4	EL PASO CORP	社債券	0.4
5	SUPERVALU INC	社債券	0.4
6	ALLY FINANCIAL INC	社債券	0.4
7	HCA INC	社債券	0.3
8	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	社債券	0.3
9	ALLY FINANCIAL INC	社債券	0.3
10	SNOQUALME ENT AUTH	社債券	0.3

[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。
- ・ 2002年から2003年はベンチマークの年間収益率。
- ・ 2004年は設定日（2004年6月23日）から年末までのファンドの収益率。
- ・ 2011年は年初から10月末までのファンドの収益率。

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。
ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第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>

ハイブリッド・インカムオープン

- (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、前期(平成22年9月16日から平成23年3月15日まで)および当期(平成23年3月16日から平成23年9月15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。
投資信託財産計算規則は、平成23年7月8日付内閣府令第33号により改正されておりますが、前期(平成22年9月16日から平成23年3月15日まで)については改正前の投資信託財産計算規則に基づき作成しており、当期(平成23年3月16日から平成23年9月15日まで)については内閣府令第33号附則第2条により、改正前の投資信託財産計算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、前期(平成22年9月16日から平成23年3月15日まで)および当期(平成23年3月16日から平成23年9月15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

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成23年 3月15日現在	当期 平成23年 9月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	229,086,247	222,632,923
親投資信託受益証券	10,413,131,280	8,835,360,330
未収利息	661	544
流動資産合計	10,642,218,188	9,057,993,797
資産合計	10,642,218,188	9,057,993,797
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	170,184,475	159,448,993
未払解約金	33,498,437	23,652,943
未払受託者報酬	873,331	838,144
未払委託者報酬	20,959,949	20,115,423
その他未払費用	34,911	33,505
流動負債合計	225,551,103	204,089,008
負債合計	225,551,103	204,089,008
純資産の部		
元本等		
元本	14,182,039,635	13,287,416,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,765,372,550	4,433,511,365
（分配準備積立金）	1,077,986,756	874,638,045
元本等合計	10,416,667,085	8,853,904,789
純資産合計	10,416,667,085	8,853,904,789
負債純資産合計	10,642,218,188	9,057,993,797

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成22年 9月16日 至平成23年 3月15日	当期 自平成23年 3月16日 至平成23年 9月15日
営業収益		
受取利息	28,190	23,751
有価証券売買等損益	150,841,256	367,770,950
営業収益合計	150,869,446	367,747,199
営業費用		
受託者報酬	2,865,636	2,660,231
委託者報酬	68,775,380	63,845,393
その他費用	114,562	106,345
営業費用合計	71,755,578	66,611,969
営業利益	79,113,868	434,359,168
経常利益	79,113,868	434,359,168
当期純利益	79,113,868	434,359,168
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	700,926	343,831
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,587,198,997	3,765,372,550
剰余金増加額又は欠損金減少額	375,751,093	394,746,093
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	375,751,093	394,746,093
剰余金減少額又は欠損金増加額	112,719,522	133,784,437
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	112,719,522	133,784,437
分配金	521,019,918	495,085,134
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,765,372,550	4,433,511,365

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	前期 自 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日	当期 自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15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約定日基準で計上しております。	(1) 有価証券売買等損益同左
3 その他	当該財務諸表の特定期間は、平成22年9月16日から平成23年3月15日までとなっております。	当該財務諸表の特定期間は、平成23年3月16日から平成23年9月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 平成23年3月15日現在	当期 平成23年9月15日現在
1 特定期間の末日における受益権の総数	14,182,039,635 口	13,287,416,154 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	3,765,372,550 円	4,433,511,365 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 (10,000口当たり純資産額)	0.7345 円 7,345 円)	0.6663 円 6,663 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日		当期 自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15日																																																																																	
1	<p>運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象である海外アクティブ債券マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 1,484,481 円</p> <p>当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 59,621,300 円</p>	1	<p>運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象である海外アクティブ債券マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 1,451,677 円</p> <p>当ファンドの主要投資対象であるハイ・イールド ボンド オープンマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 55,463,662 円</p>																																																																																
2	<p>分配金の計算過程 平成22年9月16日から平成22年11月15日まで 当該期末における分配対象金額1,849,646,449円(10,000口当たり1,251円)のうち、177,351,281円(10,000口当たり120円)を分配金額としております。</p>	2	<p>分配金の計算過程 平成23年3月16日から平成23年5月16日まで 当該期末における分配対象金額1,507,031,797円(10,000口当たり1,064円)のうち、169,921,421円(10,000口当たり120円)を分配金額としております。</p>																																																																																
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th>金額</th> <th>単位</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>81,110,088</td> <td>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></td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>520,990,093</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,247,546,268</td> <td>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>1,849,646,449</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>14,779,273,479</td> <td>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>1,251</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>120</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I = F × H / 10,000</td> <td>177,351,281</td> <td>円</td> </tr> </tbody> </table> <p>平成22年11月16日から平成23年1月17日まで 当該期末における分配対象金額1,722,572,061円(10,000口当たり1,191円)のうち、173,484,162円(10,000口当たり120円)を分配金額としております。</p>		項目		金額	単位	費用控除後の配当等収益額	A	81,110,088	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	520,990,093	円	分配準備積立金額	D	1,247,546,268	円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,849,646,449	円	当ファンドの期末残存口数	F	14,779,273,479	口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,251	円	10,000口当たり分配金額	H	120	円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	177,351,281	円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th>金額</th> <th>単位</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>77,273,803</td> <td>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></td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>378,733,802</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,051,024,192</td> <td>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>1,507,031,797</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>14,160,118,482</td> <td>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>1,064</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>120</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I = F × H / 10,000</td> <td>169,921,421</td> <td>円</td> </tr> </tbody> </table> <p>平成23年5月17日から平成23年7月15日まで 当該期末における分配対象金額1,384,348,438円(10,000口当たり1,002円)のうち、165,714,720円(10,000口当たり120円)を分配金額としております。</p>		項目		金額	単位	費用控除後の配当等収益額	A	77,273,803	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	378,733,802	円	分配準備積立金額	D	1,051,024,192	円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,507,031,797	円	当ファンドの期末残存口数	F	14,160,118,482	口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,064	円	10,000口当たり分配金額	H	120	円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	169,921,421	円
項目		金額	単位																																																																																
費用控除後の配当等収益額	A	81,110,088	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	520,990,093	円																																																																																
分配準備積立金額	D	1,247,546,268	円																																																																																
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,849,646,449	円																																																																																
当ファンドの期末残存口数	F	14,779,273,479	口																																																																																
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,251	円																																																																																
10,000口当たり分配金額	H	120	円																																																																																
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	177,351,281	円																																																																																
項目		金額	単位																																																																																
費用控除後の配当等収益額	A	77,273,803	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	378,733,802	円																																																																																
分配準備積立金額	D	1,051,024,192	円																																																																																
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,507,031,797	円																																																																																
当ファンドの期末残存口数	F	14,160,118,482	口																																																																																
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,064	円																																																																																
10,000口当たり分配金額	H	120	円																																																																																
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	169,921,421	円																																																																																

項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	86,223,021 円	費用控除後の配当等収益額	A	79,620,470 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		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	
収益調整金額	C	462,878,834 円	収益調整金額	C	323,165,365 円
分配準備積立金額	D	1,173,470,206 円	分配準備積立金額	D	981,562,603 円
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,722,572,061 円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,384,348,438 円
当ファンドの期末残存口数	F	14,457,013,524 口	当ファンドの期末残存口数	F	13,809,560,011 口
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,191 円	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,002 円
10,000口当たり分配金額	H	120 円	10,000口当たり分配金額	H	120 円
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	173,484,162 円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	165,714,720 円
<p>平成23年1月18日から平成23年3月15日まで 当該期末における分配対象金額1,601,128,457円(10,000口当たり1,128円)のうち、170,184,475円(10,000口当たり120円)を分配金額としております。</p>			<p>平成23年7月16日から平成23年9月15日まで 当該期末における分配対象金額1,242,892,553円(10,000口当たり935円)のうち、159,448,993円(10,000口当たり120円)を分配金額としております。</p>		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	81,038,797 円	費用控除後の配当等収益額	A	70,132,559 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		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	
収益調整金額	C	409,685,384 円	収益調整金額	C	261,955,179 円
分配準備積立金額	D	1,110,404,276 円	分配準備積立金額	D	910,804,815 円
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,601,128,457 円	当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	1,242,892,553 円
当ファンドの期末残存口数	F	14,182,039,635 口	当ファンドの期末残存口数	F	13,287,416,154 口
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	1,128 円	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	935 円
10,000口当たり分配金額	H	120 円	10,000口当たり分配金額	H	120 円
収益分配金金額	I = F × H / 10,000	170,184,475 円	収益分配金金額	I = F × H / 10,000	159,448,993 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 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日	当期 自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15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金融商品に係るリスク	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、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、(その他の注記)の2 有価証券関係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>	同左
<p>3 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>3 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
<p>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>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>4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 平成23年3月15日現在	当期 平成23年9月15日現在
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日	当期 自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

前期 自 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日	当期 自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15日
期首元本額 15,263,667,794 円	期首元本額 14,182,039,635 円
期中追加設定元本額 456,026,751 円	期中追加設定元本額 513,671,562 円
期中一部解約元本額 1,537,654,910 円	期中一部解約元本額 1,408,295,043 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

	前期 自 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日	当期 自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15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	117,340,019	327,826,824
合計	117,340,019	327,826,824

3 デリバティブ取引関係

前期(自 平成22年9月16日 至 平成23年3月15日)

該当事項はございません。

当期(自 平成23年3月16日 至 平成23年9月15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9月15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9月15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		4,413,872,151	
	海外アクティブ債券マザーファンド		4,421,488,179	
親投資信託受益証券計	銘柄数：2		8,835,360,330	
	組入時価比率：99.8%		100%	
合計			8,835,360,330	

(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

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

- 1 「海外アクティブ債券マザーファンド」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9月15日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		201,984,574
コール・ローン		29,391,870
国債証券		8,990,992,014
派生商品評価勘定		12,633,863
未収利息		91,287,121
前払費用		18,280,410
差入委託証拠金		54,956,609
流動資産合計		9,399,526,461
資産合計		9,399,526,461
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		7,088,349
流動負債合計		7,088,349
負債合計		7,088,349
純資産の部		
元本等		
元本		8,038,096,293
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		1,354,341,819
元本等合計		9,392,438,112
純資産合計		9,392,438,112
負債純資産合計		9,399,526,461

(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23年3月16日 至 平成23年9月15日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 (2) 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 (3) 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。
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	(1) 有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成23年9月15日現在	
1 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1,1685 円
(10,000口当たり純資産額)	11,685 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23年3月16日 至 平成23年9月15日	
1	<p>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>
2	<p>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、(3)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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行なっております。当該デリバティブ取引は、対象とする債券・金利等に係る価格変動リスクを有しております。 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>
3	<p>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>
4	<p>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。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月15日現在	
1	<p>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>
2	<p>時価の算定方法</p>

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

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9月15日現在	
1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年3月16日
期首元本額	8,730,625,852 円
期首より平成23年9月15日までの期中追加設定元本額	1,275,353,062 円
期首より平成23年9月15日までの期中一部解約元本額	1,967,882,621 円
期末元本額	8,038,096,293 円
期末元本額の内訳*	
ハイブリッド・インカムオープン	3,783,900,881 円
野村外国債券アクティブファンドAコース（野村SMA向け）	729,555,605 円
野村外国債券アクティブファンドBコース（野村SMA向け）	301,081,770 円
外国債券アクティブファンド 為替ヘッジ付・分配型(非課税適格機関投資家専用)	3,096,376,558 円
野村外国債券アクティブファンド(確定拠出年金向け)	127,181,479 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9月15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9月15日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US TREASURY BOND	500,000.00	798,398.40	
	US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,254,070.21	
	US TREASURY N/B	800,000.00	861,874.96	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,330,452.96	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,773,163.95	
	US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,043,866.97	
	US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,304,445.23	
	US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,294,445.24	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,657,031.00	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,325,000.00	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	3,436,882.64	
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,888,913.97	

	US TREASURY NOTE	3,400,000.00	3,418,859.12	
米ドル計	銘柄数：13	38,400,000.00	43,387,404.65	
			(3,329,549,432)	
	組入時価比率：35.4%		37.0%	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	883,712.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,920,133.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	853,614.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	367,950.00	
カナダドル計	銘柄数：4	3,400,000.00	4,025,409.00	
			(311,808,181)	
	組入時価比率：3.3%		3.5%	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,344,460.00	
	UK TREASURY	400,000.00	449,760.00	
	UK TREASURY	1,450,000.00	1,867,165.00	
	UK TREASURY	1,050,000.00	1,240,260.00	
	UK TREASURY	490,000.00	739,459.00	
	UK TREASURY	335,000.00	464,745.50	
	UK TREASURY	800,000.00	897,520.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,452,840.00	
英ポンド計	銘柄数：8	7,025,000.00	8,456,209.50	
			(1,022,609,414)	
	組入時価比率：10.9%		11.4%	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,000,000.00	13,575,250.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	5,000,000.00	5,723,250.00	
スウェーデンク ローナ計	銘柄数：2	18,000,000.00	19,298,500.00	
			(220,774,840)	
	組入時価比率：2.4%		2.5%	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,367,500.00	
ノルウェーク ローネ計	銘柄数：1	3,000,000.00	3,367,500.00	

			(45,629,625)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	3,300,000.00	3,842,520.00	
デンマーククローネ計	銘柄数：1	3,300,000.00	3,842,520.00	
			(54,448,508)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	1,500,000.00	1,552,200.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	477,630.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	489,150.00	
	BUNDES OBLIGATION	1,000,000.00	1,059,750.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,900,000.00	2,151,750.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000.00	2,751,360.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	2,465,000.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	1,184,674.75	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,512,075.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,492,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,420,000.00	1,422,840.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,330,250.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	543,493.80	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	469,350.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,089,600.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	419,480.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,900,000.00	4,181,970.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,500,000.00	1,702,200.00	

	FRANCE GOVERNMENT O.A. T	1,300,000.00	1,479,660.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A. T	1,000,000.00	1,288,300.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A. T	1,700,000.00	2,011,610.00	
	N E T H E R L A N D S GOVERNMENT	500,000.00	539,450.00	
	N E T H E R L A N D S GOVERNMENT	1,400,000.00	1,594,040.00	
	SPANISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,249,620.00	
	SPANISH GOVERNMENT	800,000.00	785,440.00	
ユーロ計	銘柄数：25	34,270,000.00	37,243,393.55	
			(3,928,805,585)	
	組入時価比率：41.8%		43.6%	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	524,250.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	999,000.00	
ズロチ計	銘柄数：2	1,500,000.00	1,523,250.00	
			(36,588,465)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	516,896.50	
豪ドル計	銘柄数：1	500,000.00	516,896.50	
			(40,777,964)	
	組入時価比率：0.4%		0.5%	
国債証券計			8,990,992,014	
			(8,990,992,014)	
合計			8,990,992,014	
			(8,990,992,014)	

(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9月15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				
先物取引				
債券先物取引				
買建	678,346,115		677,932,322	413,793
売建	869,699,118		867,800,298	1,898,820
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	637,798,680		631,919,000	5,879,680
カナダドル	139,485,600		139,230,000	255,600
スイスフラン	43,675,000		43,780,000	105,000
ノルウェークローネ	54,230,280		52,689,000	1,541,280
ユーロ	147,282,800		147,532,000	249,200
シンガポールドル	157,125,000		154,500,000	2,625,000
豪ドル	96,000,000		94,188,000	1,812,000
売建	639,957,167		630,017,000	9,940,167
米ドル	185,904,000		184,056,000	1,848,000
英ポンド	362,129,167		356,360,000	5,769,167
スウェーデンクローナ	52,884,000		51,345,000	1,539,000
ズロチ	39,040,000		38,256,000	784,000
合計				5,545,514

(注)時価の算定方法

1先物取引

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

2 為替予約取引

1) 計算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。

[次へ](#)

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23年4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10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9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	733	9,361,504
単位型株式投資信託	34	287,667
追加型公社債投資信託	18	4,552,503
単位型公社債投資信託	0	0
合計	785	14,201,674

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)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
株式会社 北日本銀行	7,238百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 千葉銀行	145,069百万円	

*平成23年3月末現在

(3)投資顧問会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメント U.K.リミテッド)	4,744,391	英国の1986年金融サービス業法に基づき 英国金融サービス庁に登録された当該法 律の定める範囲内で行う投資顧問業およ びそれに付随する一切の業務を営んでい ます。
NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC. (ノムラ・コーポレート・リサーチ ・アンド・アセット・マネージ 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

<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9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社 北日本銀行 株式会社 千葉銀行	7,238百万円 145,069百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

*平成23年9月末現在

(3)投資顧問会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメント U.K. リミテッド)	4,744,391	英国の1986年金融サービス業法に基づき 英国金融サービス庁に登録された当該法 律の定める範囲内で行う投資顧問業お よびそれに付随する一切の業務を営んで います。
NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC. (ノムラ・コーポレート・リサーチ ・アンド・アセット・マネージ 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9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 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. 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21年3月24日付内閣府令第5号により改正されておりますが、第51期事業年度(前事業年度)は、内閣府令第5号改正前の財務諸表等規則に基づき作成しており、第52期事業年度(当事業年度)は、内閣府令第5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。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(平成22年 3月31日)	(平成23年 3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		520	538
金銭の信託		38,530	39,575
有価証券		5,100	1,400
短期貸付金		126	166
前払金		0	0
前払費用		47	41
未収入金		79	171
未収委託者報酬		9,756	10,032
未収収益		2,645	3,761
繰延税金資産		1,513	1,736
その他		143	12
貸倒引当金		6	6
流動資産計		58,457	57,430
固定資産			
有形固定資産		1,729	1,823
建物	2	635	576
器具備品	2	1,094	1,246
無形固定資産		11,839	10,649
ソフトウェア		11,836	10,647
電話加入権		1	1
その他		1	0
投資その他の資産		28,988	32,430
投資有価証券		11,614	8,648
関係会社株式		16,099	22,609
従業員長期貸付金		366	235
長期差入保証金		66	64
長期前払費用		23	24
繰延税金資産		490	582
その他		327	265
貸倒引当金		0	0
固定資産計		42,557	44,903
資産合計		101,014	102,333

		前事業年度 (平成22年 3月31日)	当事業年度 (平成23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		11,000	8,000
預り金		95	87
未払金	1	6,217	7,645
未払収益分配金		4	4
未払償還金		61	79
未払手数料		4,226	4,517
その他未払金		1,925	3,043
未払費用	1	7,594	7,373
未払法人税等		849	800
前受収益		9	9
賞与引当金		2,538	2,900
流動負債計		28,305	26,818
固定負債			
退職給付引当金		4,576	4,064
時効後支払損引当金		475	481
その他		351	65
固定負債計		5,403	4,611
負債合計		33,708	31,429
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		17,180	17,180
資本剰余金		11,729	11,729
資本準備金		11,729	11,729
利益剰余金		35,164	39,369
利益準備金		685	685
その他利益剰余金		34,479	38,684
別途積立金		24,606	24,606
繰越利益剰余金		9,872	14,077
評価・換算差額等		3,231	2,624
その他有価証券評価差額金		3,056	2,694
繰延ヘッジ損益		175	69
純資産合計		67,306	70,903
負債・純資産合計		101,014	102,333

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)		当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			76,293		81,230
運用受託報酬			10,576		13,165
その他営業収益			57		143
営業収益計			86,927		94,539
営業費用					
支払手数料			35,199		39,741
広告宣伝費			1,155		1,155
公告費			0		-
受益証券発行費			10		6
調査費			20,998		20,709
調査費		1,394		1,310	
委託調査費		19,603		19,398	
委託計算費			883		917
営業雑経費			2,493		2,451
通信費		222		207	
印刷費		1,293		1,148	
協会費		71		73	
諸経費		905		1,022	
営業費用計			60,740		64,980
一般管理費					
給料			9,912		10,131
役員報酬	2	388		322	
給料・手当		6,740		6,822	
賞与		2,784		2,987	
交際費			153		141
旅費交通費			458		484
租税公課			206		231
不動産賃借料			1,464		1,452
退職給付費用			1,116		1,054
固定資産減価償却費			4,630		4,575
諸経費			6,529		6,106
一般管理費計			24,471		24,176
営業利益			1,715		5,382

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)		当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	3,698		4,771	
収益分配金		6		9	
受取利息		5		6	
金銭の信託運用益		2,385		1,222	
為替差益		45		62	
その他		283		319	
営業外収益計			6,424		6,391
営業外費用					
支払利息	1	98		75	
時効後支払損引当金繰入額		37		13	
その他		53		9	
営業外費用計			189		98
経常利益			7,950		11,676
特別利益					
投資有価証券売却益		72		419	
株式報酬受入益		226		173	
特別利益計			299		593
特別損失					
投資有価証券売却損		60		149	
投資有価証券等評価損		70		10	
固定資産除却損	3	16		412	
システム利用契約解約違約金		63		20	
特別損失計			210		591
税引前当期純利益			8,039		11,677
法人税、住民税及び事業税			2,662		3,759
法人税等調整額			492		108
当期純利益			5,869		7,810

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月 31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	17,180	17,180
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	17,180	17,180
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,729	11,729
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,729	11,729
資本剰余金合計		
前期末残高	11,729	11,729
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,729	11,729
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	685	685
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	685	685
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	24,606	24,606
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	24,606	24,606
繰越利益剰余金		
前期末残高	7,608	9,872
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	-
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
当期変動額合計	2,264	4,204

当期末残高	9,872	14,077
利益剰余金合計		
前期末残高	32,900	35,164
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
当期変動額合計	2,264	4,204
当期末残高	35,164	39,369
株主資本合計		
前期末残高	61,810	64,074
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
当期変動額合計	2,264	4,204
当期末残高	64,074	68,279
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	2,084	3,056
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	971	361
当期変動額合計	971	361
当期末残高	3,056	2,694
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	249	175
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	73	245
当期変動額合計	73	245
当期末残高	175	69
評価・換算差額等合計		
前期末残高	2,333	3,231
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	898	607
当期変動額合計	898	607
当期末残高	3,231	2,624
純資産合計		
前期末残高	64,143	67,306
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	898	607
当期変動額合計	3,162	3,597
当期末残高	67,306	70,903

[重要な会計方針]

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)								
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(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</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの... 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> <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</p> <p>3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <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。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0" data-bbox="319 1086 622 1209"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <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> <p>5. 引当金の計上基準</p> <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。 なお、破綻先に対する債権3百万円については、債権額から備忘価額を控除した額を取立不能見込額として債権額から直接減額しております。</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>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年	<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 (同左)</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの (同左)</p> <p>時価のないもの (同左)</p> <p>2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法 (同左)</p> <p>3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 (同左)</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 (同左)</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 (同左)</p> <p>5. 引当金の計上基準</p> <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 (同左)</p>
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
<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> <p>6. リース取引の処理方法 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> <p>7. ヘッジ会計 (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純資産の部において繰り延べる方法によっております。</p> <p>(2)ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象 - 投資有価証券</p> <p>(3)ヘッジ方針 投資有価証券に係る為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4)ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスク及び価格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。</p> <p>8. 消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>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。</p>	<p>(3) 退職給付引当金 (同左)</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 (同左)</p> <p>6. リース取引の処理方法 (同左)</p> <p>7. ヘッジ会計 (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純資産の部におい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。</p> <p>(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</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>8. 消費税等の会計処理方法 (同左)</p> <p>9. 連結納税制度の適用 (同左)</p>

[会計方針の変更]

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
(退職給付の処理方法) 「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3)(企業会計基準第19号 平成20年 7月31日)に伴い、当事業年度から同会計基準を適用しております。なお、同会計基準の適用に伴う退職給付債務の変動はないため、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。	
	(資産除去債務に関する会計基準) 当事業年度より、「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。

[追加情報]

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
(耐用年数の変更) 当社は、翌事業年度に導入予定のシステムにより置き換えられる現行のシステムの状況等を調査した結果、一部のシステム(ソフトウェア及び器具備品)について耐用年数が実態と乖離していることが判明したため、当該資産の耐用年数を実態に合わせて変更しております。 この結果、従来の方法と比較して、減価償却費が284百万円増加し、経常利益及び税引前当期純利益は284百万円減少しております。	
(賞与制度の改定) 従業員の賞与につきましては従来 6月及び12月の年2回の支給であり、賞与引当金には計算期間が10月 1日から 3月末日までに対応する金額を計上していましたが、制度改定により年 1回の支給と変更となり、当事業年度末においては賞与引当金には計算期間が 4月 1日から 3月末日までに対応する金額を計上しております。	

[注記事項]
貸借対照表関係

前事業年度末 (平成22年3月31日)	当事業年度末 (平成23年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。
未払金 1,655百万円	未払金 2,442百万円
未払費用 1,017	未払費用 762
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 369百万円	建物 437百万円
器具備品 1,647	器具備品 1,874
合計 2,017	合計 2,311

損益計算書関係

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23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。	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 3,542百万円	受取配当金 4,633百万円
支払利息 98	支払利息 75
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損	3. 固定資産除却損
建物 7百万円	ソフトウェア 412百万円
器具備品 5	
ソフトウェア 4	
合計 16	合計 412

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22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	前事業年度末株式数	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) 配当金支払額

平成21年5月28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	3,605百万円
1株当たり配当額	700円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月1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

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

配当金の総額	3,605百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	700円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年6月1日

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23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	前事業年度末株式数	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

配当金の総額	3,605百万円
1株当たり配当額	700円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年6月1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

該当事項はありません。

リース取引関係

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)																																																																
<p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(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。</p> <p>(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、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;"></th> <th style="text-align: center;">器具備品</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">603百万円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">415</td> </tr> <tr> <td>減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">188</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高 未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">99百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">195</td> </tr> </tbody> </table> <p>リース資産減損勘定期末残高 - 百万円</p> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">187百万円</td> </tr> <tr> <td>リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">175</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">7</td> </tr> <tr> <td>減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">5百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">3</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">8</td> </tr> </tbody> </table>		器具備品	取得価額相当額	603百万円	減価償却累計額相当額	415	減損損失累計額相当額	-	期末残高相当額	188	1年以内	99百万円	1年超	96	合計	195	支払リース料	187百万円	リース資産減損勘定の取崩額	-	減価償却費相当額	175	支払利息相当額	7	減損損失	-	1年以内	5百万円	1年超	3	合計	8	<p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(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) (同左)</p> <p>(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、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;"></th> <th style="text-align: center;">器具備品</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">417百万円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">325</td> </tr> <tr> <td>減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">91</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高 未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">73百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> </tbody> </table> <p>リース資産減損勘定期末残高 - 百万円</p> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">103百万円</td> </tr> <tr> <td>リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">3</td> </tr> <tr> <td>減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 (同左)</p> <p>利息相当額の算定方法 (同左)</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">6百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">4</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">10</td> </tr> </tbody> </table>		器具備品	取得価額相当額	417百万円	減価償却累計額相当額	325	減損損失累計額相当額	-	期末残高相当額	91	1年以内	73百万円	1年超	22	合計	96	支払リース料	103百万円	リース資産減損勘定の取崩額	-	減価償却費相当額	96	支払利息相当額	3	減損損失	-	1年以内	6百万円	1年超	4	合計	10
	器具備品																																																																
取得価額相当額	603百万円																																																																
減価償却累計額相当額	415																																																																
減損損失累計額相当額	-																																																																
期末残高相当額	188																																																																
1年以内	99百万円																																																																
1年超	96																																																																
合計	195																																																																
支払リース料	187百万円																																																																
リース資産減損勘定の取崩額	-																																																																
減価償却費相当額	175																																																																
支払利息相当額	7																																																																
減損損失	-																																																																
1年以内	5百万円																																																																
1年超	3																																																																
合計	8																																																																
	器具備品																																																																
取得価額相当額	417百万円																																																																
減価償却累計額相当額	325																																																																
減損損失累計額相当額	-																																																																
期末残高相当額	91																																																																
1年以内	73百万円																																																																
1年超	22																																																																
合計	96																																																																
支払リース料	103百万円																																																																
リース資産減損勘定の取崩額	-																																																																
減価償却費相当額	96																																																																
支払利息相当額	3																																																																
減損損失	-																																																																
1年以内	6百万円																																																																
1年超	4																																																																
合計	10																																																																

金融商品関係

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（追加情報）

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

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、当該投資信託を投資有価証券として、あるいは特定金銭信託を通じ保有しております。直接または特定金銭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、投資有価証券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

投資有価証券として、あるいは特定金銭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、スワップ取引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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	520	520	-
(2)金銭の信託	38,530	38,530	-
(3)短期貸付金	126	126	-
(4)未収委託者報酬	9,756	9,756	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	15,890	15,890	-
(6)関係会社株式	3,064	92,414	89,350
資産計	67,888	157,238	89,350
(7)関係会社短期借入金	11,000	11,000	-
(8)未払金	6,217	6,217	-
(9)未払費用	7,594	7,594	-
(10)未払法人税等	849	849	-
負債計	25,662	25,662	-
(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	86	86	-
デリバティブ取引計	86	86	-

(*) 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。

(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（貸借対照表計上額：投資有価証券824百万円、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。なお、当事業年度において、非上場株式について70百万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	519	-	-	-
金銭の信託	38,530	-	-	-
短期貸付金	126	-	-	-
未収委託者報酬	9,756	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	5,100	0	997	-
合計	54,032	0	997	-

当事業年度（自 平成22年 4月 1日 至 平成23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、当該投資信託を投資有価証券として、あるいは特定金銭信託を通じ保有しております。直接または特定金銭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、投資有価証券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

投資有価証券として、あるいは特定金銭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、スワップ取引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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	538	538	-
(2)金銭の信託	39,575	39,575	-
(3)短期貸付金	166	166	-
(4)未収委託者報酬	10,032	10,032	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	9,252	9,252	-
(6)関係会社株式	3,064	79,658	76,594
資産計	62,630	139,224	76,594
(7)関係会社短期借入金	8,000	8,000	-
(8)未払金	7,645	7,645	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	79	79	-
未払手数料	4,517	4,517	-
その他未払金	3,043	3,043	-
(9)未払費用	7,373	7,373	-
(10)未払法人税等	800	800	-
負債計	23,819	23,819	-
(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	65	65	-
デリバティブ取引計	65	65	-

(*) 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（貸借対照表計上額：投資有価証券796百万円、関係会社株式19,545百万円）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。

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	537	-	-	-
金銭の信託	39,575	-	-	-
短期貸付金	166	-	-	-
未収委託者報酬	10,032	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	1,400	0	1	-
合計	51,713	0	1	-

有価証券関係

前事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成22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(平成22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(平成22年3月31日)

区分	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	92,414	89,350
合計	3,064	92,414	89,350

4. その他有価証券(平成22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	5,656	282	5,373
投資信託(1)	3,103	3,001	102
小計	8,759	3,283	5,475
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	2,031	2,326	295
譲渡性預金	5,100	5,100	-
小計	7,131	7,426	295
合計	15,890	10,710	5,179

- (1) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジするための為替予約取引及び株価指数先物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175百万円（税効果会計適用後）であり、貸借対照表に計上しております。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22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	38	-	60
投資信託	626	72	0
合計	664	72	60

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 売買目的有価証券(平成23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(平成23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(平成23年3月31日)

区分	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	79,658	76,594
合計	3,064	79,658	76,594

4. その他有価証券(平成23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	4,930	282	4,647
小計	4,930	282	4,647
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託(1)	2,922	3,003	80
譲渡性預金	1,400	1,400	-
小計	4,322	4,403	80
合計	9,252	4,685	4,566

- (1) 当事業年度末において、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損失は69百万円(税効果会計適用後)であり、貸借対照表に計上しております。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自平成22年4月1日至平成23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	67	39	-
投資信託	1,824	380	149
合計	1,891	419	149

デリバティブ取引関係

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31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	契約額等のうち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	3,082	-	17	先物為替相場によって いる
合 計			3,082	-	17	

（2）株式関連

（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	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	株価指数先物取引	投資信託	967	-	68	取引所の価格によって いる
合 計			967	-	68	

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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

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	契約額等のうち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	2,846	-	65	訂正有価証券届出書(内国投資信託受益証券)先物為替相場によつて
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	166	-	(*1) -	-
合 計			3,013	-	(*1) 65	-

(*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。

退職給付関係

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22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. 退職給付債務に関する事項(平成22年 3月31日)

イ. 退職給付債務	12,427百万円
ロ. 年金資産	6,488
ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ)	5,938
ニ. 会計基準変更時差異の未処理額	
ホ. 未認識数理計算上の差異	2,015
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	653
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ)	4,576
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト - チ)	4,576

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

イ. 勤務費用	524百万円
ロ. 利息費用	247
ハ. 期待運用収益	136
ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額	
ホ. 数理計算上の差異の費用処理額	357
ヘ. 過去勤務債務の費用処理額	40
ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ)	952
チ. その他(注)	163
計	1,116

(注) 確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
ロ. 割引率	2.1%
ハ. 期待運用収益率	2.5%
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	16年(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、費用処理することとしております。)
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	(1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(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、翌期から費用処理することとしております。)
ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数	該当はありません。

当事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項(平成23年 3月31日)

イ. 退職給付債務	12,965百万円
ロ. 年金資産	7,475
ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ)	5,489
ニ. 会計基準変更時差異の未処理額	
ホ. 未認識数理計算上の差異	2,037
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	613
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ)	4,064
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト - チ)	4,064

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

イ. 勤務費用	535百万円
ロ. 利息費用	260
ハ. 期待運用収益	162
ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額	
ホ. 数理計算上の差異の費用処理額	254
ヘ. 過去勤務債務の費用処理額	40
ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ)	848
チ. その他(注)	206
計	1,054

(注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
ロ. 割引率	2.1%
ハ. 期待運用収益率	2.5%
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	16年(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、費用処理することとしております。)
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	(1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(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、翌期から費用処理することとしております。)
ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数	該当はありません。

税効果会計関係

前事業年度末 (平成22年3月31日)	当事業年度末 (平成23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
退職給付引当金 1,876	退職給付引当金 1,666
賞与引当金 1,040	賞与引当金 1,189
所有株式税務簿価通算差異 884	所有株式税務簿価通算差異 884
投資有価証券評価減 614	投資有価証券評価減 569
ゴルフ会員権評価減 510	ゴルフ会員権評価減 509
減価償却超過額 369	減価償却超過額 307
未払確定拠出年金掛金 217	未払事業税 206
子会社株式売却損 196	時効後支払損引当金 197
時効後支払損引当金 194	子会社株式売却損 196
その他 268	未払確定拠出年金掛金 107
繰延税金資産小計 6,173	繰延ヘッジ損失 48
評価性引当金 1,923	その他 184
繰延税金資産計 4,250	繰延税金資産小計 6,069
繰延税金負債	評価性引当金 1,878
繰延ヘッジ利益 122	繰延税金資産計 4,190
有価証券評価差額金 2,123	繰延税金負債
繰延税金負債計 2,245	有価証券評価差額金 1,872
繰延税金資産(純額) 2,004	繰延税金負債計 1,872
	繰延税金資産(純額) 2,318
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 41.0%	法定実効税率 41.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 1.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.8%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 9.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 13.2%
住民税等均等割 0.0%	住民税等均等割 0.0%
タックスハイブン税制 3.5%	タックスハイブン税制 5.8%
外国税額控除 2.4%	外国税額控除 0.6%
その他 0.3%	その他 0.7%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.1%

セグメント情報等

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22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。

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(追加情報)

当事業年度より「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。

関連当事者情報

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22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	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金 (百万円)	事業の内容 又は職業	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	594,492	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借等 役員の兼任	資金の借入(*1)	168,000	関係会社 短期 借入金	11,000
							資金の返済	169,000		
							借入金利息の支払	98	未払費用	3

(イ) 関連会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金 (百万円)	事業の内容 又は職業	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)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600	情報サービス業	(所有) 直接 22.3%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*2)	6,866	未払費用	0

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金 (百万円)	事業の内容 又は職業	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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	26,417 (注)3	未払手数料	3,469
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400	投資顧問業		当社投資信託の運用委託 役員の兼任	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*4)	3,263	未払費用	940

(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せん。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (* 1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
 - (* 2) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。
 - (* 3) 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。
 - (* 4) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。
3. 平成21年11月23日付で野村証券(株)はジョインベスト証券(株)を吸収合併しており、当社とジョインベスト証券(株)の取引は野村証券(株)に引継がれております。野村証券(株)との取引金額には、合併前のジョインベスト証券(株)と当社の取引金額を含んでおります。

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(株) (東京証券取引所、大阪証券取引所、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

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所及び野村土地建物(株)であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

	(百万円)	
	(株)野村総合研究所	野村土地建物(株)
流動資産合計	128,800	5,765
固定資産合計	228,173	78,723
流動負債合計	76,471	8,010
固定負債合計	76,265	12,507
純資産合計	204,237	63,970
売上高	325,646	2,546
税引前当期純利益	40,539	4,841
当期純利益	26,416	4,445

当事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23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	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	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	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借等 役員の兼任	資金の借入(*1)	137,500	関係会社 短期 借入金	8,000
							資金の返済	140,500		
							借入金利息の支払	75	未払費用	3

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	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・アセット・マネジメント・ストラテジック・インベストメンツ・Pte リミテッド	シンガポール共和国	68,275 (千米ドル)	持株会社	(所有) 直接 100.0%	役員の派遣	増資の引受(*2)	5,762	-	-
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有) 直接 21.6%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託(*3)	6,794	未払費用	61

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	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(*4)	31,596	未払手数料	3,835
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託 役員の兼任	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*5)	2,657	未払費用	939

- (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せん。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (* 1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
 - (* 2) 増資の引受けにつきましては、当社が平成22年12月23日及び12月28日に1株1米ドルで引受けしております。
 - (* 3) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。
 - (* 4) 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。
 - (* 5) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様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(株) (東京証券取引所、大阪証券取引所、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

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所及び野村土地建物(株)であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(百万円)

	(株)野村総合研究所	野村土地建物(株)
流動資産合計	167,970	7,506
固定資産合計	205,568	76,404
流動負債合計	79,436	7,926
固定負債合計	80,690	9,832
純資産合計	213,412	66,152
売上高	312,345	2,546
税引前当期純利益	36,149	3,289
当期純利益	21,100	2,944

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,067円44銭	1株当たり純資産額	13,765円90銭
1株当たり当期純利益	1,139円63銭	1株当たり当期純利益	1,516円39銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	5,869百万円	損益計算書上の当期純利益	7,810百万円
普通株式に係る当期純利益	5,869百万円	普通株式に係る当期純利益	7,810百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

2 「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

対象年月日	平成23年9月15日現在
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	666,150,293
コール・ローン	240,435,881
社債券	18,669,579,802
未収入金	169,633,771
未収利息	452,578,408
前払費用	10,488,219
流動資産合計	20,208,866,374
資産合計	20,208,866,374
負債の部	
流動負債	
未払解約金	25,200,000
流動負債合計	25,200,000
負債合計	25,200,000
純資産の部	
元本等	
元本	6,372,391,413
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	13,811,274,961
元本等合計	20,183,666,374
純資産合計	20,183,666,374
負債純資産合計	20,208,866,374

(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23年3月16日 至 平成23年9月15日
1 運用資産の評価基準及び評価方法	(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。
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	(1) 有価証券売買等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成23年9月15日現在
1 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	3.1674 円
(10,000口当たり純資産額)	31,674 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23年3月16日 至 平成23年9月15日	
1	<p>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>
2	<p>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、(3)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。</p>
3	<p>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>
4	<p>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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月15日現在	
1	<p>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>
2	<p>時価の算定方法 社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(その他の注記)

平成23年9月15日現在	
1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年3月16日
期首元本額	6,991,951,300 円
期首より平成23年9月15日までの期中追加設定元本額	358,096,339 円
期首より平成23年9月15日までの期中一部解約元本額	977,656,226 円
期末元本額	6,372,391,413 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	1,188,294,284 円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース	1,814,644,823 円
ハイ・イールド ボンド オープンCコース	61,234,378 円
ハイ・イールド ボンド オープンDコース	912,887,114 円
ハイブリッド・インカムオープン	1,393,531,651 円
ハイ・イールド ボンド オープンAコース(野村SMA向け)	250,596,555 円
ハイ・イールド ボンド オープンBコース(野村SMA向け)	751,202,608 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9月15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9月15日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	ACCURIDE CORP	100,000.00	101,500.00	
	AES CORPORATION	500,000.00	500,625.00	
	AFFINION GROUP INC	400,000.00	348,000.00	
	AGUILA 3 SA	275,000.00	262,625.00	
	AGY HOLDING CORP	1,950,000.00	1,711,125.00	
	AIR CANADA	775,000.00	740,125.00	
	ALERE INC	650,000.00	640,250.00	
	ALERIS INTL INC	375,000.00	350,625.00	
	ALLEN SYSTEMS GROUP INC	450,000.00	418,500.00	
	ALLIANCE HEALTHCARE SVCS	1,025,000.00	855,875.00	
	ALLIANT TECHSYSTEMS INC	400,000.00	400,000.00	
	ALLY FINANCIAL	250,000.00	253,750.00	
	ALLY FINANCIAL	1,675,000.00	1,647,781.25	
	ALLY FINANCIAL INC	950,000.00	906,062.50	
	ALPHA NATURAL RESOURCES	400,000.00	401,000.00	
	ALPHA NATURAL RESOURCES	300,000.00	301,125.00	
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	450,000.00	420,750.00	
	AMC ENTERTAINMENT INC	275,000.00	276,375.00	
	AMC NETWORKS INC	350,000.00	361,375.00	
	AMERICAN AIRLINES INC	400,000.00	360,000.00	
	AMERICAN AXLE & MFG INC	653,000.00	697,077.50	
	AMERICAN GENERAL FINANCE	25,000.00	24,125.00	
	AMERICAN INTL GROUP	500,000.00	377,500.00	
	AMERICAN INTL GROUP	500,000.00	479,375.00	

	AMERICAN REPROGRAPHICS C	375,000.00	345,000.00	
	AMERISTAR CASINOS INC	475,000.00	479,156.25	
	AMGH MERGER SUB INC	250,000.00	254,375.00	
	AMKOR TECHNOLOGIES INC	225,000.00	209,250.00	
	ANTERO RESOURCES FINANCE	400,000.00	387,000.00	
	APERAM	150,000.00	140,250.00	
	APERAM	150,000.00	138,750.00	
	AQUILEX HDG/AQUILEX FIN	225,000.00	90,000.00	
	ARAMARK HOLDINGS CORP	625,000.00	632,812.50	
	ARCH COAL INC	125,000.00	136,250.00	
	ARCH COAL INC	575,000.00	580,750.00	
	ARCH COAL INC	650,000.00	658,125.00	
	AS AMERICAS	100,000.00	81,000.00	
	ASBURY AUTO GROUP 7.625%	400,000.00	392,000.00	
	ATKORE INTERNATIONAL INC	700,000.00	673,750.00	
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	225,000.00	226,125.00	
	AVIS BUDGET CAR RENTAL	575,000.00	541,218.75	
	AVIV HEALTHCARE PROPERTI	275,000.00	263,312.50	
	B&G FOODS INC	650,000.00	678,437.50	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	BAKER & TAYLOR INC	1,950,000.00	1,530,750.00	
	BASIC ENERGY SERVICES	350,000.00	349,125.00	
	BELO CORP	425,000.00	452,625.00	
	BERRY PETROLEUM CO	475,000.00	535,562.50	
	BI-LO LLC/BI-LO FIN CORP	225,000.00	223,875.00	
	BIOMET INC	524,000.00	549,545.00	
	BIOSCRIP INC	225,000.00	223,312.50	
	BLUE MERGER SUB INC	625,000.00	585,156.25	
	BOART LONGYEAR MANAGEMEN	275,000.00	273,625.00	
	BOISE PAPER HDG/CO-ISSR	750,000.00	768,750.00	
	BOISE PAPER HOLDINGS LLC	350,000.00	369,250.00	
	BRIGHTSTAR CORP	150,000.00	156,000.00	
	BROWN SHOE CO INC	275,000.00	237,875.00	
	BUILDING MATERIALS CORP	550,000.00	558,937.50	
	BUILDING MATERIALS CORP	300,000.00	304,500.00	
	BUILDING MATERIALS CORP	525,000.00	505,312.50	
	BUMBLE BEE ACQUISITON CO	200,000.00	196,250.00	
	BWAY HOLDING CO	325,000.00	346,125.00	
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	1,300,000.00	1,371,500.00	
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	800,000.00	826,000.00	
	CALCIPAR SA	425,000.00	387,281.25	
	CALFRAC HOLDINGS LP	325,000.00	316,062.50	
	CALPINE CONS FIN/CCFC FI	500,000.00	527,500.00	
	CALPINE CORP	1,600,000.00	1,640,000.00	
	CALPINE CORP	225,000.00	226,125.00	
	CAPELLA HEALTHCARE	500,000.00	490,000.00	
	CASCADES INC	525,000.00	513,187.50	
	CASE NEW HOLLAND INC	1,110,000.00	1,212,675.00	
	CATALYST PAPER C	1,485,000.00	972,675.00	
	CB RICHARD ELLIS SERVICE	450,000.00	442,125.00	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	425,000.00	432,437.50	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	50,750.00	
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	1,000,000.00	1,067,500.00	
	CDW LLC/CDW FINANCE	300,000.00	300,000.00	
	CEDAR FAIR LP/CANADA'S W	700,000.00	749,000.00	

	CELANESE US HOLDINGS LLC	325,000.00	342,875.00	
	CEMEX FINANCE LLC	675,000.00	585,562.50	
	CENTRAL GARDEN & PET CO	275,000.00	270,531.25	
	CEQUEL COM HLDG I/CAP CP	750,000.00	768,750.00	
	CF INDUSTRIES INC	150,000.00	175,312.50	
	CHC HELICOPTER SA	1,050,000.00	895,125.00	
	CHECKOUT HOLDINGS CORP	350,000.00	203,875.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	832,000.00	877,760.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	125,000.00	127,656.25	
	CHESAPEAKE MIDSTREAM PT/ CORP	150,000.00	144,000.00	
	CHOCTAW RESORT DEVEL OPMENT	5,798,000.00	3,594,760.00	
	CHRYSLER GP/CG CO-ISSUER	325,000.00	276,250.00	
	CHRYSLER GP/CG CO-ISSUER	725,000.00	612,625.00	
	CINCINNATI BELL INC	500,000.00	452,500.00	
	CINCINNATI BELL INC	800,000.00	778,000.00	
	CINEMARK USA INC	475,000.00	503,500.00	
	CIT GROUP INC	1,500,000.00	1,458,750.00	
	CIT GROUP INC	250,000.00	248,437.50	
	CIT GROUP INC	1,600,000.00	1,580,000.00	
	CIT GROUP INC	1,125,000.00	1,106,718.75	
	CITADEL BROADCASTING CORP	175,000.00	189,000.00	
	CITIGROUP CAPITAL XXI	350,000.00	344,312.50	
	CITYCENTER HLDGS/FINANCE	600,000.00	594,000.00	
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	950,000.00	1,011,750.00	
	CLEAVER-BROOKS INC	825,000.00	820,875.00	
	CMA CGM	175,000.00	81,375.00	
	COFFEYVILLE RESOURCES	337,000.00	359,747.50	
	COGENT COMMUNICATIONS GR	475,000.00	494,000.00	
	COLT DEFENSE/FINANCE	400,000.00	262,000.00	
	COMMSCOPE INC	725,000.00	725,000.00	
	COMMUNITY CHOICE FINANCE	350,000.00	353,500.00	
	COMMUNITY HEALTH SYSTEMS	875,000.00	883,750.00	
	COMSTOCK RESOURCES INC	125,000.00	121,406.25	
	CONCHO RESOURCES INC	350,000.00	357,000.00	
	CONCHO RESOURCES INC	525,000.00	524,343.75	

	CONSOL ENERGY INC	320,000.00	341,600.00	
	CONSOL ENERGY INC	550,000.00	595,375.00	
	CONSOL ENERGY INC	225,000.00	223,875.00	
	CONSTELLATION BRANDS INC	470,000.00	502,312.50	
	CONTINENTAL RESOURCES	250,000.00	255,625.00	
	CORELOGIC INC	425,000.00	384,625.00	
	COTT BEVERAGES USA INC	325,000.00	338,812.50	
	CPM HOLDINGS INC	225,000.00	239,625.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	CRICKET COMMUNICATIONS I	900,000.00	778,500.00	
	CROWN AMER/CAP CORP III	375,000.00	378,750.00	
	DARLING INTERNATIONAL IN	425,000.00	463,781.25	
	DAVITA INC	425,000.00	418,625.00	
	DAVITA INC	325,000.00	322,156.25	
	DEAN FOODS CO	50,000.00	48,437.50	
	DEAN FOODS CO	350,000.00	357,000.00	
	DELPHI CORP	125,000.00	122,187.50	
	DELPHI CORP	300,000.00	293,250.00	
	DELTA AIR LINES	500,000.00	528,750.00	
	DELUXE CORP	300,000.00	297,750.00	
	DENBURY RESOURCES INC	249,000.00	263,940.00	
	DIGICEL GROUP LTD	1,200,000.00	1,198,800.00	
	DISH DBS CORP	1,250,000.00	1,325,000.00	
	DOLE FOODS CO	375,000.00	390,937.50	
	DOMTAR INC	750,000.00	896,250.00	
	DUCOMMUN INC	100,000.00	100,500.00	
	DYNACAST INTL LLC/FIN IN	525,000.00	503,343.75	
	DYNEGY HOLDINGS INC	675,000.00	455,625.00	
	EACCESS LTD	325,000.00	313,625.00	
	EARTHLINK INC	500,000.00	448,750.00	
	EDISON MISSION ENERGY	1,300,000.00	871,000.00	
	EDISON MISSION ENERGY	625,000.00	403,125.00	
	EDISON MISSION ENERGY	1,625,000.00	975,000.00	
	EH HOLDING CORP	200,000.00	200,000.00	
	EH HOLDING CORP	300,000.00	300,750.00	
	EL PASO CORP	1,950,000.00	2,133,378.00	
	EL PASO CORPORATION	825,000.00	949,351.42	
	ELDORADO RESORTS LLC/CAP	300,000.00	258,750.00	
	ELIZABETH ARDEN INC	150,000.00	149,625.00	
	ENDO PHARMACEUT HLDGS IN	300,000.00	304,500.00	
	ENDO PHARMACEUT HLDGS IN	175,000.00	176,750.00	
	ENDO PHARMACEUT HLDGS IN	300,000.00	305,250.00	
	ENERGY FUTURE	641,000.00	652,217.50	
	ENERGYSOLUTIONS INC/LLC	525,000.00	534,187.50	
	ENTRAVISION COMMUNICATIO	600,000.00	579,000.00	
	EQUINIX INC	985,000.00	1,059,490.62	
	EQUINIX INC	475,000.00	482,125.00	
	EQUINOX HOLDINGS INC	375,000.00	374,062.50	

ESSAR STEEL ALGOMA INC	775,000.00	734,312.50	
EXCO RESOURCES INC	275,000.00	257,812.50	
EXIDE TECHNOLOGIES	400,000.00	380,000.00	
EXPRESS LLC	1,210,000.00	1,288,650.00	
EXPRO FINANCE LUXEMBOURG	800,000.00	764,000.00	
FELCOR ESCROW HOLDINGS	150,000.00	139,875.00	
FERRELLGAS PARTNERS LP	341,000.00	341,852.50	
FGI OPERATIONS CO INC	450,000.00	470,250.00	
FIDELITY NATIONAL INFORM	150,000.00	158,250.00	
FIESTA RESTAURANT GROUP	225,000.00	225,000.00	
FIRST DATA CORPORATION	225,000.00	212,625.00	
FLORIDA EAST RR	400,000.00	394,000.00	
FORD MOTOR COMPANY	250,000.00	280,891.25	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	1,050,000.00	1,026,396.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	1,450,000.00	1,625,123.75	
FRAC TECH SVCS/FRAC TECH	225,000.00	234,562.50	
FREESCALE SEMICONDUCTOR	575,000.00	602,312.50	
FRONTIER COMMUNICATIONS	1,625,000.00	1,708,281.25	
FTI CONSULTING INC	1,330,000.00	1,363,250.00	
GANNETT CO INC	250,000.00	268,750.00	
GANNETT CO INC	300,000.00	327,750.00	
GANNETT CO INC	700,000.00	668,500.00	
GAP INC/THE	300,000.00	282,547.20	
GARDA WORLD SECURITY COR	675,000.00	698,625.00	
GCI INC	525,000.00	561,750.00	
GCI INC	225,000.00	218,250.00	
GENON ESCROW CORP	725,000.00	726,812.50	
GENON ESCROW CORP	825,000.00	827,062.50	
GEO GROUP INC/THE	200,000.00	211,000.00	
GEOEYE INC	475,000.00	492,812.50	
GEOKINETICS HOLDINGS INC	700,000.00	605,500.00	
GEORGIA-PACIFIC CORP	2,450,000.00	2,863,741.30	
GMAC LLC	1,800,000.00	1,683,000.00	
GREAT LAKES DREDGE&DOCK	250,000.00	236,250.00	
GREIF INC	250,000.00	265,000.00	
GRIFOLS INC	500,000.00	507,500.00	
HANESBRANDS INC	350,000.00	374,500.00	
HANESBRANDS INC	325,000.00	322,562.50	

	HANGER ORTHOPEDIC GROUP	100,000.00	98,000.00	
--	----------------------------	------------	-----------	--

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	HCA INC	1,625,000.00	1,726,562.50	
	HCA INC	350,000.00	350,000.00	
	HCA INC	1,475,000.00	1,438,125.00	
	HEADWATERS INC	125,000.00	101,562.50	
	HEALTHSOUTH CORP	300,000.00	303,750.00	
	HERCULES OFFSHORE LLC	250,000.00	243,750.00	
	HERTZ CORP	660,000.00	617,100.00	
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	525,000.00	546,000.00	
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	850,000.00	867,000.00	
	HOA RESTAURANT GP/FINANC	375,000.00	354,375.00	
	HOLLY CORP	975,000.00	1,083,468.75	
	HOLLY ENERGY PARTNERS LP	700,000.00	735,000.00	
	HORNBECK OFFSHORE SRVCS	425,000.00	426,062.50	
	HOST HOTELS & RESORTS	350,000.00	347,375.00	
	HOST HOTELS & RESORTS LP	325,000.00	358,718.75	
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	325,000.00	307,937.50	
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	450,000.00	426,375.00	
	HUNTSMAN INTERNATIONAL L	725,000.00	753,093.75	
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	425,000.00	432,968.75	
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	1,175,000.00	1,197,031.25	
	ICON HEALTH & FITNESS	575,000.00	543,375.00	
	IFM US COLONIAL PIPELINE	150,000.00	169,046.70	
	IGATE CORP	650,000.00	619,125.00	
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	300,000.00	221,019.00	
	INEOS FINANCE PLC	200,000.00	199,000.00	
	INERGY LP/INERGY FIN	536,000.00	538,680.00	
	INERGY LP/INERGY FIN	175,000.00	169,750.00	
	INERGY LP/INERGY FIN	575,000.00	546,968.75	
	INGLES MARKETS INC	400,000.00	421,000.00	
	INSIGHT COMMUNICATIONS	750,000.00	860,625.00	
	INTELSAT JACKSON HLDG	750,000.00	721,875.00	
	INTELSAT JACKSON HLDG	250,000.00	255,625.00	
	INTELSAT JACKSON HLDG	550,000.00	528,000.00	
	INTELSAT JACKSON HLDG	250,000.00	240,625.00	
	INTL LEASE FINANCE CORP	500,000.00	480,000.00	
	INTL LEASE FINANCE CORP	200,000.00	205,750.00	

	INTL LEASE FINANCE CORP	75,000.00	68,258.10	
	INTL LEASE FINANCE CORP	1,225,000.00	1,252,562.50	
	INTL LEASE FINANCE CORP	75,000.00	67,640.25	
	INTL LEASE FINANCE CORP	575,000.00	583,625.00	
	IPALCO ENTERPRISES INC	400,000.00	423,146.40	
	IRON MOUNTAIN INC	1,100,000.00	1,135,750.00	
	IRON MOUNTAIN INC	250,000.00	256,875.00	
	IRON MOUNTAIN INC	50,000.00	52,125.00	
	ITC DELTACOM INC	450,000.00	462,937.50	
	J.B.POINDEXTER & CO	700,000.00	696,500.00	
	JABIL CIRCUIT INC	100,000.00	96,750.00	
	JAGUAR LAND ROVER PLC	150,000.00	139,875.00	
	JAMES RIVER ESCROW INC	125,000.00	111,250.00	
	JARDEN CORP	775,000.00	800,187.50	
	JBS USA LLC/JBS USA FINA	75,000.00	66,375.00	
	JMC STEEL GROUP	300,000.00	289,500.00	
	JOHNSON DIVERSEY HOLD INC	350,000.00	416,500.00	
	KABEL BW ERSTE BETEILIGU	150,000.00	147,750.00	
	KB HOME	600,000.00	525,000.00	
	KENNEDY-WILSON INC	300,000.00	286,875.00	
	KEY ENERGY SERVICES INC	175,000.00	171,062.50	
	KINDRED HEALTHCARE INC	575,000.00	500,250.00	
	KINOVE GERMAN BONDCO GMB	250,000.00	243,125.00	
	KRATON POLYMERS LLC/CAP	150,000.00	141,750.00	
	LANDRY'S RESTAURANT INC	475,000.00	498,750.00	
	LBI ESCROW CORP	735,000.00	814,931.25	
	LEAR CORP	250,000.00	263,125.00	
	LEAR CORP	325,000.00	349,375.00	
	LENNAR CORP	275,000.00	247,500.00	
	LEVI STRAUSS & CO	25,000.00	25,875.00	
	LIBERTY TIRE RECYCLING	425,000.00	444,125.00	
	LIMITED BRANDS INC	600,000.00	675,000.00	
	LIMITED BRANDS INC	225,000.00	234,562.50	
	LIMITED BRANDS INC	525,000.00	538,125.00	
	LIN TELEVISION CORP	400,000.00	409,000.00	
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	300,000.00	287,250.00	
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	225,000.00	240,750.00	

	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	600,000.00	609,000.00	
	LIONS GATE ENTERTAINMENT	1,075,000.00	1,061,562.50	
	LONGVIEW FIBRE PAPER & P	425,000.00	416,500.00	
	LUCENT TECHNOLOGIES	1,379,000.00	1,192,835.00	
	MAGNACHIP SEMICONDUCTOR	375,000.00	400,312.50	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	MANITOWOC COMPANY INC	350,000.00	348,687.50	
	MARINA DISTRICT FINANCE	325,000.00	312,000.00	
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	325,000.00	336,375.00	
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	200,000.00	205,000.00	
	MARQUETTE TRANS CO/FINAN	450,000.00	443,250.00	
	MCCLATCHY CO	425,000.00	403,750.00	
	MCJUNKIN RED MAN CORP	575,000.00	570,687.50	
	MEDASSETS INC	175,000.00	168,875.00	
	MEDIA GENERAL INC	175,000.00	141,750.00	
	MEDIACOM LLC/CAPTL CORP	500,000.00	513,750.00	
	MEG ENERGY CORP	325,000.00	324,593.75	
	MEMC ELECTRONICS MATERIA	375,000.00	328,125.00	
	METHANEX CORP	875,000.00	922,191.37	
	METROPCS WIRELESS INC	1,300,000.00	1,304,875.00	
	MGM RESORT INTERNATIONAL	875,000.00	947,187.50	
	MIRABELA NICKEL LTD	175,000.00	161,000.00	
	MOBILE MINI INC	1,000,000.00	990,000.00	
	MPL 2 ACQUISITION CANCO	325,000.00	313,625.00	
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	600,000.00	573,000.00	
	MYLAN INC	400,000.00	424,000.00	
	MYLAN INC	875,000.00	936,250.00	
	NAI ENTER HOLDINGS LLC	200,000.00	206,500.00	
	NALCO CO	650,000.00	720,687.50	
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	375,000.00	373,125.00	
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	475,000.00	475,000.00	
	NBTY INC	675,000.00	699,468.75	
	NEXEO SOLUTIONS LLC/CORP	75,000.00	75,562.50	
	NORTH AMERICAN ENERGY AL	175,000.00	187,250.00	
	NORTH ATLANTIC TRADING	200,000.00	190,000.00	
	NORTHERN TIER ENERGY LLC	200,000.00	216,000.00	
	NOVELIS INC	975,000.00	1,006,687.50	
	NOVELIS INC	325,000.00	341,656.25	
	NRG ENERGY INC	975,000.00	996,937.50	

	NRG ENERGY INC	1,125,000.00	1,139,062.50	
	NRG ENERGY INC	700,000.00	682,500.00	
	NSG HOLDINGS LLC/NSG HLD	726,000.00	707,850.00	
	OMEGA HLTHCARE INVESTORS	275,000.00	264,343.75	
	ONCURE MEDICAL CORP	800,000.00	723,000.00	
	OPPENHEIMER HOLDINGS INC	275,000.00	273,625.00	
	OXEA FINANCE/CY SCA	647,000.00	647,000.00	
	P.H. GLATFELTER	1,025,000.00	1,040,375.00	
	P.H. GLATFELTER	300,000.00	304,500.00	
	PACKAGING DYNAMICS CORP	50,000.00	49,875.00	
	PAETEC HOLDING CORP	875,000.00	945,000.00	
	PALACE ENT HLDG LLC/CORP	150,000.00	145,687.50	
	PANTRY INC	1,100,000.00	1,095,875.00	
	PARKER DRILLING CO	250,000.00	258,750.00	
	PATHEON INC	475,000.00	437,000.00	
	PATRIOT COAL CORP	400,000.00	387,000.00	
	PEABODY ENERGY CORP	700,000.00	771,750.00	
	PENN NATIONAL GAMING INC	175,000.00	185,500.00	
	PENN VIRGINIA RESOURCE	575,000.00	567,812.50	
	PETROHAWK ENERGY CORP	675,000.00	765,281.25	
	PETROHAWK ENERGY CORP	400,000.00	467,000.00	
	PETROLEUM DEVELOPMENT CO	1,025,000.00	1,107,000.00	
	PETROPLUS FINANCE LTD	200,000.00	183,000.00	
	PETROPLUS FINANCE LTD	675,000.00	573,750.00	
	PHH CORP	375,000.00	390,937.50	
	PHIBRO ANIMAL HEALTH COR	275,000.00	273,625.00	
	PINNACLE ENTERTAINMENT	375,000.00	391,875.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCE	1,000,000.00	1,085,440.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRO	500,000.00	546,250.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRO	275,000.00	285,312.50	
	PLAINS EXPLORATION & PRO	450,000.00	456,187.50	
	PLAINS EXPLORATION 7% 3/	550,000.00	556,875.00	
	PLASTIPAK HOLDINGS INC	375,000.00	401,250.00	
	POLYONE CORP	300,000.00	308,250.00	

	POLYPORE INTERNATIONAL I	125,000.00	125,312.50	
	PRESTIGE BRANDS INC	1,130,000.00	1,175,200.00	
	PRODUCTION RES GROUP	400,000.00	372,000.00	
	PROQUEST LLC/PROQUEST	450,000.00	438,750.00	
	PROVIDENT FDG/PFG FIN	150,000.00	133,500.00	
	PUBLIC SERVICE CO OF NEW	550,000.00	632,919.10	
	PUGET ENERGY INC	275,000.00	280,992.80	
	PUGET ENERGY INC	325,000.00	320,567.00	
	QUADRA FNX MINING LTD	300,000.00	300,750.00	
	QUEBECOR MEDIA	425,000.00	425,000.00	
	QUICKSILVER RESOURCE	1,700,000.00	1,593,750.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	QVC INC	75,000.00	78,750.00	
	QVC INC	1,075,000.00	1,166,375.00	
	QVC INC	275,000.00	298,375.00	
	RADIOSHACK CORP	225,000.00	209,812.50	
	RAIN CII CARBON LLC/CII	450,000.00	457,875.00	
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	250,000.00	253,750.00	
	REGENCY ENERGY PARTNERS	775,000.00	844,750.00	
	REGENCY ENERGY PARTNERS	400,000.00	415,000.00	
	REGENCY ENERGY PARTNERS	225,000.00	228,375.00	
	RELIANCE INTERMEDIATE HO	700,000.00	745,500.00	
	RENT-A-CENTER INC	275,000.00	268,125.00	
	RES-CARE INC	450,000.00	451,125.00	
	REYNOLDS GROUP HOLDINGS	200,000.00	187,500.00	
	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	475,000.00	456,000.00	
	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	225,000.00	225,000.00	
	RITE AID CORP	625,000.00	668,750.00	
	ROADHOUSE FINANCING INC	425,000.00	417,031.25	
	ROOFING SUPPLY/FINANCE	600,000.00	582,000.00	
	ROTECH HEALTHCARE INC	150,000.00	127,875.00	
	RR DONNELLEY & SONS CO	325,000.00	295,018.75	
	RYLAND GROUP	425,000.00	367,625.00	
	SABINE PASS LNG LP	1,400,000.00	1,400,000.00	
	SABRA HEALTH/CAPTL CORP	200,000.00	194,000.00	
	SALEM COMMUNICATIONS	296,000.00	307,100.00	
	SANDRIDGE ENERGY INC	500,000.00	532,500.00	
	SANDRIDGE ENERGY INC	500,000.00	502,500.00	
	SANDRIDGE ENERGY INC	375,000.00	355,781.25	
	SANMINA-SCI CORP	875,000.00	791,875.00	
	SCIENTIFIC GAMES CORP	250,000.00	252,500.00	
	SCIENTIFIC GAMES INTERNA	250,000.00	261,250.00	
	SEALED AIR CORP	450,000.00	477,513.00	
	SEITEL ACQUISITION CORP	619,000.00	583,407.50	
	SEMINOLE TRIBE OF FLORID	425,000.00	433,500.00	
	SENECA GAMING CORP	650,000.00	643,500.00	

	SERVICE CORP INTL	875,000.00	931,875.00	
	SESI LLC	300,000.00	294,375.00	
	SGS INTERNATIONAL INC	1,575,000.00	1,596,656.25	
	SHEA HOMES LP/FNDG CP	225,000.00	191,812.50	
	SLM CORP	625,000.00	635,937.50	
	SM ENERGY CO	75,000.00	76,125.00	
	SMITHFIELD FOODS INC	1,200,000.00	1,365,000.00	
	SNOQUALMIE ENT AUTH	1,800,000.00	1,746,000.00	
	SOLO CUP COMPANY	850,000.00	862,750.00	
	SPECTRUM BRANDS INC	550,000.00	596,750.00	
	SPEEDWAY MOTORSPORTS INC	325,000.00	345,312.50	
	SPEEDWAY MOTORSPORTS INC	100,000.00	97,750.00	
	SPENCER SPIRIT HLDG/GIFT	175,000.00	170,625.00	
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	375,000.00	375,937.50	
	SPRINGLEAF FINANCE CORP	900,000.00	733,500.00	
	SPRINT CAPITAL CORP	1,025,000.00	1,023,718.75	
	SPRINT NEXTEL CORP	2,375,000.00	2,440,312.50	
	STANDARD PACIFIC CORP	950,000.00	831,250.00	
	STANDARD PACIFIC CORP	150,000.00	128,625.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORT	650,000.00	709,312.50	
	STEEL DYNAMICS INC	1,000,000.00	1,007,500.00	
	STEWART ENTERPRISES	150,000.00	146,250.00	
	STONERIDGE INC	325,000.00	338,812.50	
	STRATUS TECHNOLOGIES INC	853,000.00	755,971.25	
	SUNCOKE ENERGY INC	225,000.00	225,000.00	
	SUPERVALU INC	1,825,000.00	1,820,437.50	
	SYNCREON GLOBAL IRE/FIN	550,000.00	525,250.00	
	TARGA RESOURCES PARTNERS	425,000.00	442,000.00	
	TARGA RESOURCES PARTNERS	350,000.00	342,125.00	
	TELEFLEX INC	300,000.00	297,000.00	
	TEMPEL STEEL COMPANY	100,000.00	96,000.00	
	TENASKA ALABAMA PART	308,772.85	321,123.76	
	TENNECO INC	225,000.00	231,187.50	
	TESORO CORP	475,000.00	516,562.50	
	THERMADYNE HOLDINGS CORP	150,000.00	155,250.00	
	THOMPSON CREEK METALS CO	275,000.00	250,250.00	
	TITAN INTERNATIONAL INC	475,000.00	500,531.25	
	TOLL BROS FINANCE CORP	725,000.00	827,907.95	
	TOLL BROS FINANCE CORP	225,000.00	227,269.57	

	TOPS MARKETS	325,000.00	326,625.00	
	TOYS R US DELAWARE INC	425,000.00	416,500.00	
	TPC GROUP LLC	275,000.00	276,375.00	
	TRANS UNION LLC/TRANSUNI	375,000.00	417,187.50	
	TRINIDAD DRILLING LTD	250,000.00	255,000.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	TRIUMPH GROUP INC	275,000.00	286,687.50	
	UNIT CORP	175,000.00	175,000.00	
	UNITED MARITIME LLC/CORP	575,000.00	583,625.00	
	UNITED REFINING	250,000.00	248,125.00	
	UNITED RENTALS NORTH AM	250,000.00	275,625.00	
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	375,000.00	335,625.00	
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	550,000.00	551,375.00	
	UNIVISION COMMUNICATIONS	525,000.00	488,250.00	
	UNIVISION COMMUNICATIONS	375,000.00	362,812.50	
	UPC GERMANY GMBH	300,000.00	303,750.00	
	UPC HOLDING BV	650,000.00	666,250.00	
	US STEEL CORP	150,000.00	145,125.00	
	US STEEL CORP	275,000.00	265,375.00	
	USG CORP	400,000.00	389,000.00	
	VAIL RESORTS INC	225,000.00	226,687.50	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	150,000.00	141,750.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	500,000.00	471,250.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	250,000.00	231,250.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	550,000.00	500,500.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	250,000.00	229,375.00	
	VANGUARD HLT HDG LLC/INC	650,000.00	607,750.00	
	VERSO PAPER HLDGS LLC/IN	250,000.00	189,375.00	
	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	400,000.00	439,000.00	
	VISTEON CORP	475,000.00	440,562.50	
	VULCAN MATERIALS	225,000.00	223,242.75	
	WEST CORP	850,000.00	845,750.00	
	WEST CORP	350,000.00	333,375.00	
	WESTERN REFINING INC	625,000.00	681,250.00	
	WIND ACQUISITION FIN SA	400,000.00	361,000.00	
	WIND ACQUISITION HOLDING	331,850.00	306,961.25	
	WINDSTREAM CORP	375,000.00	395,625.00	
	WINDSTREAM CORP	275,000.00	288,062.50	
	WINDSTREAM CORP	100,000.00	100,875.00	
	WINDSTREAM CORP	375,000.00	380,625.00	
	WM FINANCE CORP	325,000.00	337,593.75	
	WM FINANCE CORP	450,000.00	418,500.00	

	WM FINANCE HOLDINGS CORP	300,000.00	271,500.00	
	WGM ACQUISITION CORP	150,000.00	155,812.50	
	WYLE SERVICES CORP	225,000.00	222,750.00	
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	575,000.00	627,468.75	
	XM SATELLITE RADIO INC	550,000.00	567,875.00	
米ドル計	銘柄数：474	247,406,622.85	243,283,552.29	
			(18,669,579,802)	
	組入時価比率：92.5%		100%	
社債券計			18,669,579,802	
			(18,669,579,802)	
合計			18,669,579,802	
			(18,669,579,802)	

- (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
 該当事項はございません。

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10月31日現在

資産総額	8,914,404,196	円
負債総額	68,040,173	円
純資産総額(-)	8,846,364,023	円
発行済口数	12,906,384,112	口
1口当たり純資産額(/)	0.6854	円

<ご参考>

「海外アクティブ債券マザーファンド」

資産総額	10,460,900,010	円
負債総額	918,323,009	円
純資産総額(-)	9,542,577,001	円
発行済口数	8,044,898,071	口
1口当たり純資産額(/)	1.1862	円

「ハイ・イールド ボンド オープンマザーファンド」

資産総額	20,170,661,879	円
負債総額	158,600,000	円
純資産総額(-)	20,012,061,879	円
発行済口数	6,043,435,407	口
1口当たり純資産額(/)	3.3114	円

独立監査人の監査報告書

平成22年6月21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、「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21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書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であり、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、野村アセットマネジメント株式会社の平成22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。

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23年6月17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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書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、野村アセットマネジメント株式会社の平成23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。

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23年4月28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ブリッド・インカムオープンの平成22年9月16日から平成23年3月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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、ハイブリッド・インカムオープンの平成23年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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11月2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 内田 満 雄指定有限責任社員
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ブリッド・インカムオープンの平成23年3月16日から平成23年9月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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、ハイブリッド・インカムオープンの平成23年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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](#)