

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年8月29日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目 1 2 番 1 号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村米国好利回り社債投信 Cコース
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	野村米国好利回り社債投信 Dコース
	野村米国好利回り社債投信 Cコース
	1兆円を上限とします。
	野村米国好利回り社債投信 Dコース
	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2019年2月28日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に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】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

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

## 第一部【証券情報】

## （５）申込手数料

## &lt;訂正前&gt;

取得申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

## &lt;訂正後&gt;

取得申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%<sup>\*</sup>（税抜3.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

\* 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、3.3%となります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

## (3) ファンドの仕組み

## &lt; 更新後 &gt;

委託会社の概況(2019年7月末現在)

## ・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・ 本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・ 資本金の額

17,180百万円

## ・ 会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・ 大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

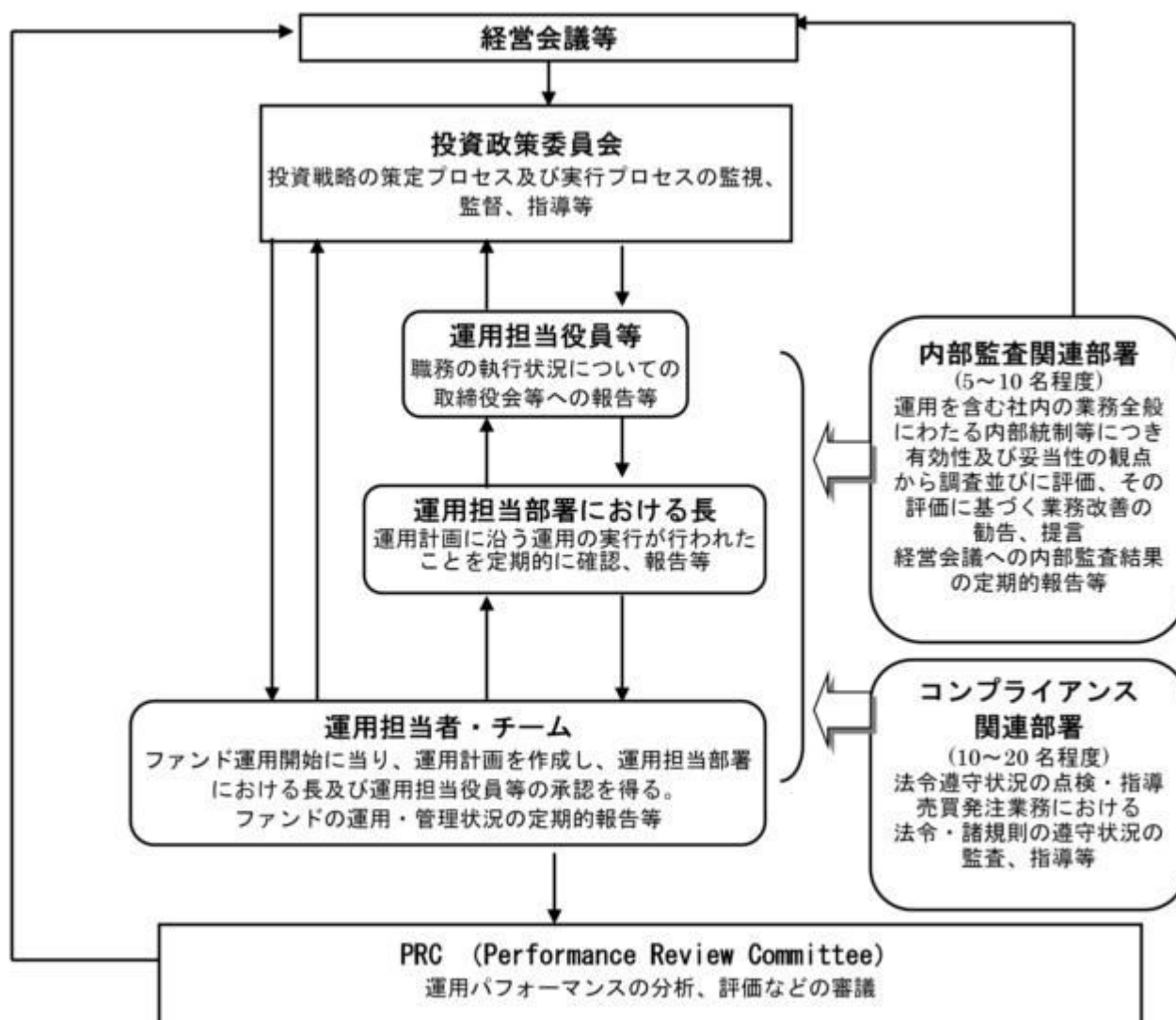
## 2 投資方針

## (3) 運用体制

## &lt; 更新後 &gt;

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りで

す。



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

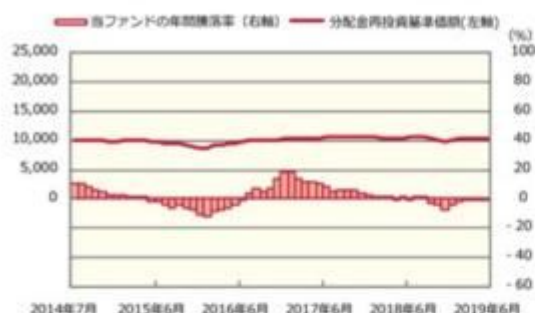
### 3 投資リスク

< 更新後 >

## ■ リスクの定量的比較（2014年7月末～2019年6月末：月次）

### ■ Cコース

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



#### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	18.6	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 12.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.8	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2014年7月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### ■ Dコース

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



#### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	22.6	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 18.5	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	5.5	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2014年7月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<p>&lt;代表的な資産クラスの指数&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）</li> <li>○先進国株：MSCI-KOKUSAⅠ指数（配当込み、円ベース）</li> <li>○新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）</li> <li>○日本国債：NOMURA-BPI 国債</li> <li>○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）</li> <li>○新興国債：JP モルガン・カバメント・インド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）</li> </ul>
<p>■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■</p> <p>○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> <p>○MSCI-KOKUSAⅠ指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAⅠ指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> <p>○NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。</p> <p>○FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。</p> <p>○JP モルガン・カバメント・インド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・カバメント・インド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase &amp; Co. 及びその子会社（以下、JPMC）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持っており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。</p> <p>米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSEC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推薦、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。</p> <p>JPMSEC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。</p>

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

#### 4 手数料等及び税金

##### （１）申込手数料

###### < 更新後 >

取得申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%<sup>\*</sup>（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜3.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

<sup>\*</sup> 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、3.3%となります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせ下さい。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

購入時手数料は、商品及び関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務コストの対価として、購入時に頂戴するものです。

##### （３）信託報酬等

###### < 更新後 >

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の172.8（税抜年10,000分の160）の率を乗じて得た額とし、信託報酬の配分については、次の通り（税抜）とします。

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
年10,000分の105	年10,000分の50	年10,000分の5

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、年10,000分の176となります。

「野村米国好利回り社債投信 マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬は、「野村米国好利回り社債投信 マザーファンド」を投資対象とする証券投資信託の委託者が受ける報酬から、毎年6月および12月ならびに信託契約終了のとき支払うものとし、その報酬額は、当該マザーファンドの平均純資産総額（日々の純資産総額の平均値）に、年10,000分60の率を乗じて得た額とします。

#### 支払先の役務の内容

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

#### （５）課税上の取扱い

##### ＜更新後＞

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

##### 個人の投資家に対する課税

##### ＜収益分配金に対する課税＞

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

なお、配当控除は適用されません。

##### ＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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

##### 損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>（注2）</sup>	《配当所得》
--------	---------------------------------	--------



<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 特定公社債<sup>(注1)</sup>の利子</li> <li>・ 公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul>	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 譲渡益</li> <li>・ 譲渡損</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 上場株式の配当</li> <li>・ 公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul>
--	---	---

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

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

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

#### 法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 換金（解約）時および償還時の課税について

##### [個人の投資家の場合]

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

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

##### [法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

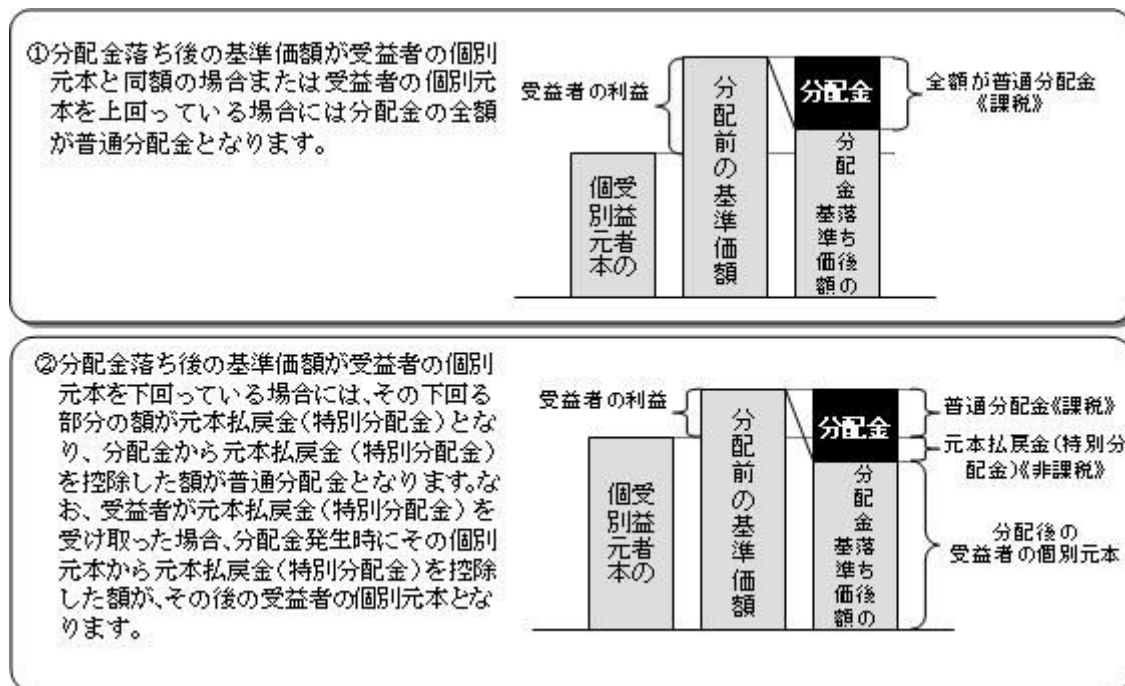
#### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

#### 分配金の課税について

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



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

税法が改正された場合等には、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2019年6月末現在）が変更になる場合があります。

## 5 運用状況

以下は2019年6月28日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### （１）投資状況

#### 野村米国好利回り社債投信 Ｃコース

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,263,944,342	97.55
現金・預金・その他資産（負債控除後）		56,627,186	2.44
合計（純資産総額）		2,320,571,528	100.00

#### 野村米国好利回り社債投信 Ｄコース

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	8,685,487,091	99.14
現金・預金・その他資産（負債控除後）		75,060,260	0.85
合計（純資産総額）		8,760,547,351	100.00

## （参考）野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	100,469,268	0.65
	カナダ	34,693	0.00
	小計	100,503,961	0.65
外国証券（優先証券）	アメリカ	24,537,916	0.16
新株予約権証券	アメリカ	522,847	0.00
新株予約権付社債券等	アメリカ	9,724,005	0.06
社債券	アメリカ	13,857,655,302	90.48
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,321,833,039	8.63
合計（純資産総額）		15,314,777,070	100.00

## その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り貸付債権を組入れております。

なお、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。

資産の種類	国 / 地域	数量	時価（円）	投資比率（％）
貸付債権	アメリカ	9,681,175.35	839,062,802	5.47

## （２）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 野村米国好利回り社債投信 Ｃコース

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	野村米国好利回り社債投信 マ ザーファンド	951,837,016	2.3745	2,260,136,995	2.3785	2,263,944,342	97.55

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.55
合 計	97.55

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	野村米国好利回り社債投信 マ ザーファンド	3,651,665,794	2.3745	8,670,880,428	2.3785	8,685,487,091	99.14

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.14
合 計	99.14

## （参考）野村米国好利回り社債投信 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	BAUSCH HEALTH COS INC	1,100,000	9,990.76	109,898,373	11,021.52	121,236,803	6.125	2025/4/15	0.79
2	アメリカ	社債券	SPRINT CAPITAL CORP	825,000	11,714.61	96,645,592	12,503.64	103,155,030	8.75	2032/3/15	0.67
3	アメリカ	社債券	VALEANT PHARMACEUTICALS	750,000	11,327.65	84,957,384	12,018.58	90,139,388	9	2025/12/15	0.58
4	アメリカ	社債券	LTF MERGER SUB INC	800,000	11,102.37	88,818,960	11,061.94	88,495,590	8.5	2023/6/15	0.57
5	アメリカ	社債券	FRONTIER COMMUNICATIONS	1,100,000	8,405.39	92,459,351	7,302.77	80,330,497	10.5	2022/9/15	0.52
6	アメリカ	社債券	BOYD GAMING CORP	675,000	11,156.26	75,304,789	11,169.73	75,395,737	6.875	2023/5/15	0.49
7	アメリカ	社債券	EMC CORP	700,000	10,438.04	73,066,285	10,726.93	75,088,539	2.65	2020/6/1	0.49
8	アメリカ	社債券	SPRINT CORP	575,000	11,345.83	65,238,550	11,708.68	67,324,960	7.875	2023/9/15	0.43
9	アメリカ	社債券	ARD FINANCE SA	600,000	10,118.78	60,712,718	10,967.63	65,805,795	7.125	2023/9/15	0.42
10	アメリカ	社債券	BOYD GAMING CORP	575,000	10,792.47	62,056,724	11,371.84	65,388,109	6.375	2026/4/1	0.42
11	アメリカ	社債券	CALIFORNIA RESOURCES CRP	800,000	8,328.88	66,631,062	8,165.09	65,320,740	8	2022/12/15	0.42
12	アメリカ	社債券	1011778 BC / NEW RED FIN	600,000	10,259.69	61,558,195	10,886.79	65,320,740	5	2025/10/15	0.42

13	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	550,000	10,901.34	59,957,379	11,741.40	64,577,717	6.25	2049/9/29	0.42
14	アメリカ	社債券	INFOR US INC	575,000	10,768.22	61,917,271	11,009.13	63,302,507	6.5	2022/5/15	0.41
15	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	550,000	10,846.36	59,655,028	11,045.02	60,747,641	5.75	2023/9/1	0.39
16	アメリカ	社債券	BUFFALO THUNDER DEV 144A	1,052,025	5,658.97	59,533,831	5,766.76	60,667,809	0	2022/12/9	0.39
17	アメリカ	社債券	FIRST QUANTUM MINERALS L	600,000	9,579.83	57,479,018	10,091.83	60,551,033	6.5	2024/3/1	0.39
18	アメリカ	社債券	VERTIV INT HOLD CORP	575,000	10,334.36	59,422,606	10,388.26	59,732,502	12	2022/2/15	0.39
19	アメリカ	社債券	SLM CORP	525,000	9,889.73	51,921,095	11,156.26	58,570,391	6.125	2024/3/25	0.38
20	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	525,000	10,796.40	56,681,100	10,940.68	57,438,595	6	2022/7/15	0.37
21	アメリカ	社債券	BUILDING MATERIALS CORP	500,000	10,280.47	51,402,356	11,140.95	55,704,794	5.375	2024/11/15	0.36
22	アメリカ	社債券	INTELSAT JACKSON HLDG	475,000	11,074.00	52,601,520	11,048.47	52,480,256	9.75	2025/7/15	0.34
23	アメリカ	社債券	BWAY HOLDING CO	500,000	9,929.61	49,648,074	10,442.15	52,210,781	7.25	2025/4/15	0.34
24	アメリカ	社債券	ARTESYN ESCROW INC	475,000	10,078.36	47,872,234	10,940.68	51,968,254	9.75	2020/10/15	0.33
25	アメリカ	社債券	CALPINE CORP	475,000	10,266.99	48,768,238	10,900.26	51,776,253	5.375	2023/1/15	0.33
26	アメリカ	社債券	GRIFFON CORPORATION	475,000	10,105.31	48,000,235	10,765.52	51,136,250	5.25	2022/3/1	0.33
27	アメリカ	社債券	CCO HOLDINGS LLC	450,000	10,782.23	48,520,052	11,311.21	50,900,459	5.75	2026/2/15	0.33
28	アメリカ	社債券	NAVIENT CORP	450,000	9,593.31	43,169,895	10,994.58	49,475,610	5.875	2024/10/25	0.32
29	アメリカ	社債券	NOVELIS CORP	450,000	9,997.52	44,988,852	10,940.68	49,233,083	5.875	2026/9/30	0.32
30	アメリカ	社債券	GARDA WORLD SECURITY COR	450,000	10,509.52	47,292,863	10,832.89	48,748,028	7.25	2021/11/15	0.31

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー設備・サービス	0.02
		石油・ガス・消耗燃料	0.05
		金属・鉱業	0.22
		紙製品・林産品	0.00
		建設関連製品	0.01
		自動車部品	0.11

		ホテル・レストラン・レジャー	0.06
		インターネット販売・通信販売	0.00
		専門小売り	0.00
		ソフトウェア	0.05
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.05
		その他の業種	0.05
外国証券（優先証券）			0.16
新株予約権証券			0.00
新株予約権付社債券等			0.06
社債券			90.48
合 計			91.36

### 投資不動産物件

#### 野村米国好利回り社債投信 Cコース

該当事項はありません。

#### 野村米国好利回り社債投信 Dコース

該当事項はありません。

#### （参考）野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

#### 野村米国好利回り社債投信 Cコース

該当事項はありません。

#### 野村米国好利回り社債投信 Dコース

該当事項はありません。

#### （参考）野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

その他の資産として、下記の通り貸付債権を組み入れております。

なお、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。

資産の名称	国 / 地域	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
貸付債権	アメリカ	9,681,175.35	842,318,362	839,062,802	5.47

## （３）運用実績

## 純資産の推移

## 野村米国好利回り社債投信 Ｃコース

2019年6月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6特定期間	(2009年12月 8日)	1,883	1,900	0.8597	0.8676
第7特定期間	(2010年 6月 8日)	1,043	1,052	0.8681	0.8761
第8特定期間	(2010年12月 8日)	931	937	0.9113	0.9173
第9特定期間	(2011年 6月 8日)	794	798	0.9451	0.9501
第10特定期間	(2011年12月 8日)	540	543	0.8656	0.8706
第11特定期間	(2012年 6月 8日)	445	447	0.8957	0.9007
第12特定期間	(2012年12月10日)	417	419	0.9517	0.9567
第13特定期間	(2013年 6月10日)	362	364	0.9877	0.9927
第14特定期間	(2013年12月 9日)	356	358	0.9994	1.0044
第15特定期間	(2014年 6月 9日)	522	524	1.0263	1.0313
第16特定期間	(2014年12月 8日)	518	521	0.9781	0.9831
第17特定期間	(2015年 6月 8日)	483	486	0.9663	0.9713
第18特定期間	(2015年12月 8日)	415	417	0.8548	0.8598
第19特定期間	(2016年 6月 8日)	484	486	0.8539	0.8589
第20特定期間	(2016年12月 8日)	1,511	1,520	0.8789	0.8839
第21特定期間	(2017年 6月 8日)	4,500	4,525	0.8821	0.8871
第22特定期間	(2017年12月 8日)	3,854	3,876	0.8562	0.8612
第23特定期間	(2018年 6月 8日)	3,082	3,101	0.8236	0.8286
第24特定期間	(2018年12月10日)	2,531	2,548	0.7655	0.7705
第25特定期間	(2019年 6月10日)	2,333	2,348	0.7522	0.7572
	2018年 6月末日	3,107		0.8206	
	7月末日	3,074		0.8202	
	8月末日	2,941		0.8181	
	9月末日	2,835		0.8159	
	10月末日	2,672		0.7921	
	11月末日	2,573		0.7749	
	12月末日	2,430		0.7424	
	2019年 1月末日	2,475		0.7646	
	2月末日	2,445		0.7701	
	3月末日	2,412		0.7644	

4月末日	2,417		0.7688	
5月末日	2,353		0.7553	
6月末日	2,320		0.7569	

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

2019年6月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6特定期間	(2009年12月 8日)	65,834	66,428	0.6534	0.6593
第7特定期間	(2010年 6月 8日)	55,134	55,622	0.6772	0.6832
第8特定期間	(2010年12月 8日)	38,842	39,080	0.6525	0.6565
第9特定期間	(2011年 6月 8日)	31,286	31,430	0.6522	0.6552
第10特定期間	(2011年12月 8日)	21,361	21,471	0.5807	0.5837
第11特定期間	(2012年 6月 8日)	19,086	19,178	0.6204	0.6234
第12特定期間	(2012年12月10日)	18,243	18,323	0.6862	0.6892
第13特定期間	(2013年 6月10日)	20,320	20,392	0.8458	0.8488
第14特定期間	(2013年12月 9日)	18,870	18,933	0.9104	0.9134
第15特定期間	(2014年 6月 9日)	16,586	16,638	0.9410	0.9440
第16特定期間	(2014年12月 8日)	16,947	16,994	1.0726	1.0756
第17特定期間	(2015年 6月 8日)	15,969	16,012	1.1106	1.1136
第18特定期間	(2015年12月 8日)	13,423	13,464	0.9843	0.9873
第19特定期間	(2016年 6月 8日)	10,954	10,991	0.8755	0.8785
第20特定期間	(2016年12月 8日)	11,834	11,870	0.9751	0.9781
第21特定期間	(2017年 6月 8日)	11,323	11,358	0.9713	0.9743
第22特定期間	(2017年12月 8日)	10,922	10,955	0.9940	0.9970
第23特定期間	(2018年 6月 8日)	10,189	10,221	0.9542	0.9572
第24特定期間	(2018年12月10日)	9,362	9,392	0.9367	0.9397
第25特定期間	(2019年 6月10日)	8,790	8,819	0.9209	0.9239
2018年 6月末日		10,145		0.9576	
7月末日		10,189		0.9661	
8月末日		9,989		0.9690	
9月末日		10,131		0.9920	
10月末日		9,770		0.9661	
11月末日		9,543		0.9521	
12月末日		8,947		0.8980	
2019年 1月末日		9,000		0.9149	
2月末日		9,209		0.9426	
3月末日		9,130		0.9420	
4月末日		9,204		0.9593	
5月末日		8,863		0.9276	
6月末日		8,760		0.9216	



## 分配の推移

## 野村米国好利回り社債投信 Cコース

	計算期間	1口当たりの分配金
第6特定期間	2009年 6月 9日～2009年12月 8日	0.0343円
第7特定期間	2009年12月 9日～2010年 6月 8日	0.0476円
第8特定期間	2010年 6月 9日～2010年12月 8日	0.0410円
第9特定期間	2010年12月 9日～2011年 6月 8日	0.0340円
第10特定期間	2011年 6月 9日～2011年12月 8日	0.0300円
第11特定期間	2011年12月 9日～2012年 6月 8日	0.0300円
第12特定期間	2012年 6月 9日～2012年12月10日	0.0300円
第13特定期間	2012年12月11日～2013年 6月10日	0.0300円
第14特定期間	2013年 6月11日～2013年12月 9日	0.0300円
第15特定期間	2013年12月10日～2014年 6月 9日	0.0300円
第16特定期間	2014年 6月10日～2014年12月 8日	0.0300円
第17特定期間	2014年12月 9日～2015年 6月 8日	0.0300円
第18特定期間	2015年 6月 9日～2015年12月 8日	0.0300円
第19特定期間	2015年12月 9日～2016年 6月 8日	0.0300円
第20特定期間	2016年 6月 9日～2016年12月 8日	0.0300円
第21特定期間	2016年12月 9日～2017年 6月 8日	0.0300円
第22特定期間	2017年 6月 9日～2017年12月 8日	0.0300円
第23特定期間	2017年12月 9日～2018年 6月 8日	0.0300円
第24特定期間	2018年 6月 9日～2018年12月10日	0.0300円
第25特定期間	2018年12月11日～2019年 6月10日	0.0300円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

	計算期間	1口当たりの分配金
第6特定期間	2009年 6月 9日～2009年12月 8日	0.0275円
第7特定期間	2009年12月 9日～2010年 6月 8日	0.0362円
第8特定期間	2010年 6月 9日～2010年12月 8日	0.0290円
第9特定期間	2010年12月 9日～2011年 6月 8日	0.0220円
第10特定期間	2011年 6月 9日～2011年12月 8日	0.0180円
第11特定期間	2011年12月 9日～2012年 6月 8日	0.0180円
第12特定期間	2012年 6月 9日～2012年12月10日	0.0180円
第13特定期間	2012年12月11日～2013年 6月10日	0.0180円
第14特定期間	2013年 6月11日～2013年12月 9日	0.0180円
第15特定期間	2013年12月10日～2014年 6月 9日	0.0180円

第16特定期間	2014年 6月10日～2014年12月 8日	0.0180円
第17特定期間	2014年12月 9日～2015年 6月 8日	0.0180円
第18特定期間	2015年 6月 9日～2015年12月 8日	0.0180円
第19特定期間	2015年12月 9日～2016年 6月 8日	0.0180円
第20特定期間	2016年 6月 9日～2016年12月 8日	0.0180円
第21特定期間	2016年12月 9日～2017年 6月 8日	0.0180円
第22特定期間	2017年 6月 9日～2017年12月 8日	0.0180円
第23特定期間	2017年12月 9日～2018年 6月 8日	0.0180円
第24特定期間	2018年 6月 9日～2018年12月10日	0.0180円
第25特定期間	2018年12月11日～2019年 6月10日	0.0180円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

#### 収益率の推移

#### 野村米国好利回り社債投信 Cコース

	計算期間	収益率
第6特定期間	2009年 6月 9日～2009年12月 8日	24.4%
第7特定期間	2009年12月 9日～2010年 6月 8日	6.5%
第8特定期間	2010年 6月 9日～2010年12月 8日	9.7%
第9特定期間	2010年12月 9日～2011年 6月 8日	7.4%
第10特定期間	2011年 6月 9日～2011年12月 8日	5.2%
第11特定期間	2011年12月 9日～2012年 6月 8日	6.9%
第12特定期間	2012年 6月 9日～2012年12月10日	9.6%
第13特定期間	2012年12月11日～2013年 6月10日	6.9%
第14特定期間	2013年 6月11日～2013年12月 9日	4.2%
第15特定期間	2013年12月10日～2014年 6月 9日	5.7%
第16特定期間	2014年 6月10日～2014年12月 8日	1.8%
第17特定期間	2014年12月 9日～2015年 6月 8日	1.9%
第18特定期間	2015年 6月 9日～2015年12月 8日	8.4%
第19特定期間	2015年12月 9日～2016年 6月 8日	3.4%
第20特定期間	2016年 6月 9日～2016年12月 8日	6.4%
第21特定期間	2016年12月 9日～2017年 6月 8日	3.8%
第22特定期間	2017年 6月 9日～2017年12月 8日	0.5%
第23特定期間	2017年12月 9日～2018年 6月 8日	0.3%
第24特定期間	2018年 6月 9日～2018年12月10日	3.4%
第25特定期間	2018年12月11日～2019年 6月10日	2.2%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

	計算期間	収益率
第6特定期間	2009年 6月 9日～2009年12月 8日	13.6%
第7特定期間	2009年12月 9日～2010年 6月 8日	9.2%
第8特定期間	2010年 6月 9日～2010年12月 8日	0.6%
第9特定期間	2010年12月 9日～2011年 6月 8日	3.3%
第10特定期間	2011年 6月 9日～2011年12月 8日	8.2%
第11特定期間	2011年12月 9日～2012年 6月 8日	9.9%
第12特定期間	2012年 6月 9日～2012年12月10日	13.5%
第13特定期間	2012年12月11日～2013年 6月10日	25.9%
第14特定期間	2013年 6月11日～2013年12月 9日	9.8%
第15特定期間	2013年12月10日～2014年 6月 9日	5.3%
第16特定期間	2014年 6月10日～2014年12月 8日	15.9%
第17特定期間	2014年12月 9日～2015年 6月 8日	5.2%
第18特定期間	2015年 6月 9日～2015年12月 8日	9.8%
第19特定期間	2015年12月 9日～2016年 6月 8日	9.2%
第20特定期間	2016年 6月 9日～2016年12月 8日	13.4%
第21特定期間	2016年12月 9日～2017年 6月 8日	1.5%
第22特定期間	2017年 6月 9日～2017年12月 8日	4.2%
第23特定期間	2017年12月 9日～2018年 6月 8日	2.2%
第24特定期間	2018年 6月 9日～2018年12月10日	0.1%
第25特定期間	2018年12月11日～2019年 6月10日	0.2%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

## （４）設定及び解約の実績

## 野村米国好利回り社債投信 Cコース

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第6特定期間	2009年 6月 9日～2009年12月 8日	1,574,012,392	5,271,064,764	2,190,559,239
第7特定期間	2009年12月 9日～2010年 6月 8日	394,001,436	1,382,910,306	1,201,650,369
第8特定期間	2010年 6月 9日～2010年12月 8日	179,575,243	359,485,253	1,021,740,359
第9特定期間	2010年12月 9日～2011年 6月 8日	71,913,284	253,566,332	840,087,311
第10特定期間	2011年 6月 9日～2011年12月 8日	17,981,845	233,582,903	624,486,253
第11特定期間	2011年12月 9日～2012年 6月 8日	70,139,467	197,462,458	497,163,262
第12特定期間	2012年 6月 9日～2012年12月10日	50,532,835	109,497,827	438,198,270
第13特定期間	2012年12月11日～2013年 6月10日	6,606,649	77,890,532	366,914,387

第14特定期間	2013年 6月11日～2013年12月 9日	10,779,599	21,270,721	356,423,265
第15特定期間	2013年12月10日～2014年 6月 9日	188,406,244	36,147,528	508,681,981
第16特定期間	2014年 6月10日～2014年12月 8日	88,428,671	67,021,140	530,089,512
第17特定期間	2014年12月 9日～2015年 6月 8日	17,047,624	46,571,687	500,565,449
第18特定期間	2015年 6月 9日～2015年12月 8日	12,917,781	27,694,969	485,788,261
第19特定期間	2015年12月 9日～2016年 6月 8日	98,240,464	17,168,696	566,860,029
第20特定期間	2016年 6月 9日～2016年12月 8日	1,170,294,131	17,319,155	1,719,835,005
第21特定期間	2016年12月 9日～2017年 6月 8日	3,665,902,367	284,044,220	5,101,693,152
第22特定期間	2017年 6月 9日～2017年12月 8日	322,438,422	922,589,558	4,501,542,016
第23特定期間	2017年12月 9日～2018年 6月 8日	179,630,684	938,665,227	3,742,507,473
第24特定期間	2018年 6月 9日～2018年12月10日	304,963,577	740,226,293	3,307,244,757
第25特定期間	2018年12月11日～2019年 6月10日	147,544,526	352,727,176	3,102,062,107

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 野村米国好利回り社債投信 Dコース

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第6特定期間	2009年 6月 9日～2009年12月 8日	277,702,265	45,562,886,620	100,764,025,765
第7特定期間	2009年12月 9日～2010年 6月 8日	486,426,405	19,839,852,045	81,410,600,125
第8特定期間	2010年 6月 9日～2010年12月 8日	603,755,958	22,485,785,134	59,528,570,949
第9特定期間	2010年12月 9日～2011年 6月 8日	206,224,118	11,765,830,276	47,968,964,791
第10特定期間	2011年 6月 9日～2011年12月 8日	32,843,370	11,215,435,309	36,786,372,852
第11特定期間	2011年12月 9日～2012年 6月 8日	22,937,391	6,046,421,730	30,762,888,513
第12特定期間	2012年 6月 9日～2012年12月10日	30,902,633	4,208,080,885	26,585,710,261
第13特定期間	2012年12月11日～2013年 6月10日	1,389,975,294	3,950,303,291	24,025,382,264
第14特定期間	2013年 6月11日～2013年12月 9日	149,657,635	3,447,932,912	20,727,106,987
第15特定期間	2013年12月10日～2014年 6月 9日	420,161,918	3,522,115,875	17,625,153,030
第16特定期間	2014年 6月10日～2014年12月 8日	273,732,180	2,099,153,834	15,799,731,376
第17特定期間	2014年12月 9日～2015年 6月 8日	95,264,654	1,516,506,530	14,378,489,500
第18特定期間	2015年 6月 9日～2015年12月 8日	366,549,043	1,108,011,733	13,637,026,810
第19特定期間	2015年12月 9日～2016年 6月 8日	76,576,466	1,201,529,193	12,512,074,083
第20特定期間	2016年 6月 9日～2016年12月 8日	501,003,954	876,868,956	12,136,209,081
第21特定期間	2016年12月 9日～2017年 6月 8日	589,191,690	1,067,215,190	11,658,185,581
第22特定期間	2017年 6月 9日～2017年12月 8日	78,785,915	748,782,477	10,988,189,019
第23特定期間	2017年12月 9日～2018年 6月 8日	270,410,398	580,291,124	10,678,308,293
第24特定期間	2018年 6月 9日～2018年12月10日	86,526,103	769,569,111	9,995,265,285
第25特定期間	2018年12月11日～2019年 6月10日	109,087,992	558,646,902	9,545,706,375

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

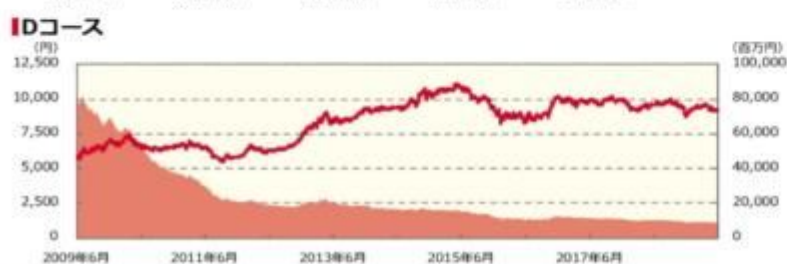
#### 参考情報

&lt; 更新後 &gt;



## 運用実績（2019年6月28日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

ICコース	
2019年6月	50 円
2019年5月	50 円
2019年4月	50 円
2019年3月	50 円
2019年2月	50 円
直近1年間累計	600 円
設定来累計	7,368 円

IDコース	
2019年6月	30 円
2019年5月	30 円
2019年4月	30 円
2019年3月	30 円
2019年2月	30 円
直近1年間累計	360 円
設定来累計	5,684 円

### ■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	種類	投資比率（％）	
			Cコース	Dコース
1	BAUSCH HEALTH COS INC	社債券	0.8	0.8
2	SPRINT CAPITAL CORP	社債券	0.7	0.7
3	VALEANT PHARMACEUTICALS	社債券	0.6	0.6
4	LTF MERGER SUB INC	社債券	0.6	0.6
5	FRONTIER COMMUNICATIONS	社債券	0.5	0.5
6	BOYD GAMING CORP	社債券	0.5	0.5
7	EMC CORP	社債券	0.5	0.5
8	SPRINT CORP	社債券	0.4	0.4
9	ARD FINANCE SA	社債券	0.4	0.4
10	BOYD GAMING CORP	社債券	0.4	0.4

実質的な証券種類別投資比率

種類	投資比率（％）	
	Cコース	Dコース
株式	0.6	0.6
外国証券（優先証券）	0.2	0.2
新株予約権証券	0.0	0.0
新株予約権付社債券等	0.1	0.1
社債券	88.3	89.7

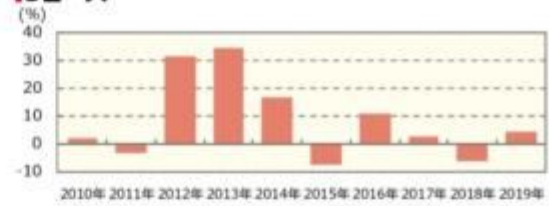
## ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

### ■ Cコース



- ・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。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

### ■ Dコース



●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1 申込（販売）手続等

## &lt; 訂正前 &gt;

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

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

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として取得およびスイッチングの申込みができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

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

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

なお、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合や、取得申込単位が前記と異なる場合等があります。原則として、お買付け後のコース変更はできません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 積立方式

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

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

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 申込手数料 >

( )取得申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.0%）以内で販売会社が独自に次に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせ下さい。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

( )収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

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

< 訂正後 >

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

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

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として取得およびスイッチングの申込みができません。(申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。)

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

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

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

なお、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合や、取得申込単位が前記



と異なる場合等があります。原則として、お買付け後のコース変更はできません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 積立方式

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

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

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

## 第3【ファンドの経理状況】

野村米国好利回り社債投信 Cコース

野村米国好利回り社債投信 Dコース

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

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2018年12月11日から2019年6月10日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1 財務諸表

野村米国好利回り社債投信 Cコース

## (1) 貸借対照表

(単位：円)		
	前期 (2018年12月10日現在)	当期 (2019年 6月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	25,669,000	23,371,500
親投資信託受益証券	2,525,962,717	2,270,521,912
派生商品評価勘定	3,778,940	26,898,370
未収入金	20,600,000	38,833,297
流動資産合計	2,576,010,657	2,359,625,079
資産合計	2,576,010,657	2,359,625,079
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,153,955	-
未払金	1,092,208	-
未払収益分配金	16,536,223	15,510,310
未払解約金	10,430,659	6,999,999
未払受託者報酬	123,197	115,872
未払委託者報酬	3,819,090	3,592,058
未払利息	51	36
その他未払費用	4,917	4,623
流動負債合計	44,160,300	26,222,898
負債合計	44,160,300	26,222,898
純資産の部		
元本等		
元本	3,307,244,757	3,102,062,107
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	775,394,400	768,659,926
(分配準備積立金)	27,898,817	50,102,116
元本等合計	2,531,850,357	2,333,402,181
純資産合計	2,531,850,357	2,333,402,181
負債純資産合計	2,576,010,657	2,359,625,079

## (2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	38,868,333	28,059,195
為替差損益	107,505,368	46,098,937
営業収益合計	68,637,035	74,158,132
営業費用		
支払利息	10,585	8,243
受託者報酬	788,715	655,039
委託者報酬	24,450,036	20,306,354
その他費用	42,288	26,144
営業費用合計	25,291,624	20,995,780
営業利益又は営業損失（ ）	93,928,659	53,162,352
経常利益又は経常損失（ ）	93,928,659	53,162,352
当期純利益又は当期純損失（ ）	93,928,659	53,162,352
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,777,539	453,712
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	660,125,292	775,394,400
剰余金増加額又は欠損金減少額	138,067,147	83,964,480
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	138,067,147	83,964,480
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,429,615	34,688,510
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,429,615	34,688,510
分配金	105,755,520	95,250,136
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	775,394,400	768,659,926

## （３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
２．費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、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。
４．その他	当該財務諸表の特定期間は、2018年12月11日から2019年 6月10日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

前期 2018年12月10日現在	当期 2019年 6月10日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,307,244,757口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,102,062,107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	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 775,394,400円	元本の欠損 768,659,926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	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額 0.7655円	1口当たり純資産額 0.7522円
(10,000口当たり純資産額) (7,655円)	(10,000口当たり純資産額) (7,522円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日																																																												
1.運用の外部委託費用  当ファンドの主要投資対象である野村米国好利回り社債投信マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用  なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。  支払金額 54,132,500円	1.運用の外部委託費用  当ファンドの主要投資対象である野村米国好利回り社債投信マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用  なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。  支払金額 47,525,346円																																																												
2.分配金の計算過程  2018年 6月 9日から2018年 7月 9日まで	2.分配金の計算過程  2018年12月11日から2019年 1月 8日まで																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>13,203,342円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,593,835,253円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>9,226,439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>1,616,265,034円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,769,753,804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>4,287円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>50円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>18,848,769円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	13,203,342円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,593,835,253円	分配準備積立金額	D	9,226,439円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,616,265,034円	当ファンドの期末残存口数	F	3,769,753,804口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,287円	10,000口当たり分配金額	H	50円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	18,848,769円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>10,675,380円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,335,612,642円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>27,569,436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>1,373,857,458円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,272,911,148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>4,197円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>50円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>16,364,555円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	10,675,380円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,335,612,642円	分配準備積立金額	D	27,569,436円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,373,857,458円	当ファンドの期末残存口数	F	3,272,911,148口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,197円	10,000口当たり分配金額	H	50円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	16,364,555円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	13,203,342円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,593,835,253円																																																											
分配準備積立金額	D	9,226,439円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,616,265,034円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,769,753,804口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,287円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	50円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	18,848,769円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	10,675,380円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,335,612,642円																																																											
分配準備積立金額	D	27,569,436円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,373,857,458円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,272,911,148口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,197円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	50円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	16,364,555円																																																											
2018年 7月10日から2018年 8月 8日まで	2019年 1月 9日から2019年 2月 8日まで																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>14,538,223円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,561,481,831円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>10,771,374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>1,586,791,428円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,710,146,652口</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	14,538,223円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,561,481,831円	分配準備積立金額	D	10,771,374円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,586,791,428円	当ファンドの期末残存口数	F	3,710,146,652口	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>12,879,557円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,308,114,186円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>31,186,331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>1,352,180,074円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,229,013,761口</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	12,879,557円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,308,114,186円	分配準備積立金額	D	31,186,331円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,352,180,074円	当ファンドの期末残存口数	F	3,229,013,761口																		
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	14,538,223円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,561,481,831円																																																											
分配準備積立金額	D	10,771,374円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,586,791,428円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,710,146,652口																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	12,879,557円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,308,114,186円																																																											
分配準備積立金額	D	31,186,331円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,352,180,074円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,229,013,761口																																																											

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,276円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	18,550,733円

2018年 8月 9日から2018年 9月10日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	13,061,424円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,477,413,172円
分配準備積立金額	D	13,332,221円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,503,806,817円
当ファンドの期末残存口数	F	3,526,473,754口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,264円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	17,632,368円

2018年 9月11日から2018年10月 9日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,012,261円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,446,211,802円
分配準備積立金額	D	15,423,484円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,472,647,547円
当ファンドの期末残存口数	F	3,468,159,920口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,246円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	17,340,799円

2018年10月10日から2018年11月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,334,174円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,395,012,684円
分配準備積立金額	D	18,867,509円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,425,214,367円
当ファンドの期末残存口数	F	3,369,325,650口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,229円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	16,846,628円

2018年11月 9日から2018年12月10日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,576,330円

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,187円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	16,145,068円

2019年 2月 9日から2019年 3月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,175,244円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,267,975,896円
分配準備積立金額	D	36,598,115円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,313,749,255円
当ファンドの期末残存口数	F	3,152,933,374口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,166円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	15,764,666円

2019年 3月 9日から2019年 4月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,847,238円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,250,181,311円
分配準備積立金額	D	38,841,281円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,300,869,830円
当ファンドの期末残存口数	F	3,131,072,889口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,154円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	15,655,364円

2019年 4月 9日から2019年 5月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,680,613円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,254,249,399円
分配準備積立金額	D	43,848,764円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,308,778,776円
当ファンドの期末残存口数	F	3,162,034,706口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,139円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	15,810,173円

2019年 5月 9日から2019年 6月10日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,354,090円

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	1,359,501,286円	収益調整金額	C	1,221,526,556円
分配準備積立金額	D	22,936,976円	分配準備積立金額	D	46,952,150円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,394,014,592円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,277,832,796円
当ファンドの期末残存口数	F	3,307,244,757口	当ファンドの期末残存口数	F	3,102,062,107口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,215円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,119円
10,000口当たり分配金額	H	50円	10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	16,536,223円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	15,510,310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 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(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> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2018年12月10日現在	当期 2019年 6月10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>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1．貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2．時価の算定方法</p> <p>同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10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 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
期首元本額 3,742,507,473円	期首元本額 3,307,244,757円
期中追加設定元本額 304,963,577円	期中追加設定元本額 147,544,526円
期中一部解約元本額 740,226,293円	期中一部解約元本額 352,727,176円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	84,116,291	38,248,423
合計	84,116,291	38,248,423

### 3 デリバティブ取引関係

#### デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	前期(2018年12月10日現在)				当期(2019年 6月10日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	2,463,665,497	-	2,472,040,512	8,375,015	2,260,559,638	-	2,233,661,268	26,898,370
米ドル	2,463,665,497	-	2,472,040,512	8,375,015	2,260,559,638	-	2,233,661,268	26,898,370
合計	2,463,665,497	-	2,472,040,512	8,375,015	2,260,559,638	-	2,233,661,268	26,898,370

#### （注）時価の算定方法

##### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

#### （４）附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2019年6月10日現在)

該当事項はありません。



## (2) 株式以外の有価証券(2019年6月10日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	野村米国好利回り社債投信 マザーファンド	956,210,534	2,270,521,912	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 97.3%	956,210,534	2,270,521,912 100.0%	
	合計			2,270,521,912	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	前期 (2018年12月10日現在)	当期 (2019年 6月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	95,828,353	82,875,437
親投資信託受益証券	9,282,668,996	8,705,032,414
未収入金	44,000,000	48,000,000
流動資産合計	9,422,497,349	8,835,907,851
資産合計	9,422,497,349	8,835,907,851
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	29,985,795	28,637,119
未払解約金	15,763,443	2,716,849
未払受託者報酬	453,860	434,838
未払委託者報酬	14,069,645	13,479,910
未払利息	192	131
その他未払費用	18,143	17,383
流動負債合計	60,291,078	45,286,230
負債合計	60,291,078	45,286,230
純資産の部		
元本等		
元本	9,995,265,285	9,545,706,375
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	633,059,014	755,084,754
(分配準備積立金)	1,743,317,914	1,723,533,047
元本等合計	9,362,206,271	8,790,621,621
純資産合計	9,362,206,271	8,790,621,621
負債純資産合計	9,422,497,349	8,835,907,851

## (2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	106,967,137	101,263,418
営業収益合計	106,967,137	101,263,418
営業費用		
支払利息	35,433	29,981
受託者報酬	2,735,209	2,448,430
委託者報酬	84,791,546	75,901,208
その他費用	109,345	97,878
営業費用合計	87,671,533	78,477,497
営業利益又は営業損失（ ）	19,295,604	22,785,921
経常利益又は経常損失（ ）	19,295,604	22,785,921
当期純利益又は当期純損失（ ）	19,295,604	22,785,921
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,284,011	3,360,101
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	489,071,056	633,059,014
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,949,134	40,154,192
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,949,134	40,154,192
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,435,391	6,694,739
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,435,391	6,694,739
分配金	185,081,316	174,911,013
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	633,059,014	755,084,754

## （３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２．費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、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。
４．その他	当該財務諸表の特定期間は、2018年12月11日から2019年 6月10日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

前期 2018年12月10日現在	当期 2019年 6月10日現在
１． 特定期間の末日における受益権の総数 9,995,265,285口	１． 特定期間の末日における受益権の総数 9,545,706,375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	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 633,059,014円	元本の欠損 755,084,754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	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額 0.9367円	1口当たり純資産額 0.9209円
(10,000口当たり純資産額) (9,367円)	(10,000口当たり純資産額) (9,209円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日																																																												
1. 運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象である野村米国好利回り社債投信マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。 支払金額 54,132,500円	1. 運用の外部委託費用 当ファンドの主要投資対象である野村米国好利回り社債投信マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。 支払金額 47,525,346円																																																												
2. 分配金の計算過程 2018年 6月 9日から2018年 7月 9日まで	2. 分配金の計算過程 2018年12月11日から2019年 1月 8日まで																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>42,328,292円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>310,958,314円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,773,410,703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>2,126,697,309円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>10,589,839,214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>2,008円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>30円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>31,769,517円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	42,328,292円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	310,958,314円	分配準備積立金額	D	1,773,410,703円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,126,697,309円	当ファンドの期末残存口数	F	10,589,839,214口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,008円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	31,769,517円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>40,172,713円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>308,384,033円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,735,716,511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>2,084,273,257円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>9,959,893,884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>2,092円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>30円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>29,879,681円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	40,172,713円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	308,384,033円	分配準備積立金額	D	1,735,716,511円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,084,273,257円	当ファンドの期末残存口数	F	9,959,893,884口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,092円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	29,879,681円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	42,328,292円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	310,958,314円																																																											
分配準備積立金額	D	1,773,410,703円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,126,697,309円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,589,839,214口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,008円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	31,769,517円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	40,172,713円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	308,384,033円																																																											
分配準備積立金額	D	1,735,716,511円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,084,273,257円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	9,959,893,884口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,092円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	29,879,681円																																																											
2018年 7月10日から2018年 8月 8日まで	2019年 1月 9日から2019年 2月 8日まで																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>51,466,698円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>310,631,483円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,773,499,262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>2,135,597,443円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>10,535,199,169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>2,027円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>30円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>31,605,597円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	51,466,698円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	310,631,483円	分配準備積立金額	D	1,773,499,262円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,135,597,443円	当ファンドの期末残存口数	F	10,535,199,169口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,027円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	31,605,597円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>48,867,455円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>307,286,549円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,719,845,240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>2,075,999,244円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>9,827,584,654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>2,112円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>30円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>29,482,753円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	48,867,455円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	307,286,549円	分配準備積立金額	D	1,719,845,240円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,075,999,244円	当ファンドの期末残存口数	F	9,827,584,654口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,112円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	29,482,753円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	51,466,698円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	310,631,483円																																																											
分配準備積立金額	D	1,773,499,262円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,135,597,443円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,535,199,169口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,027円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	31,605,597円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	48,867,455円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	307,286,549円																																																											
分配準備積立金額	D	1,719,845,240円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,075,999,244円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	9,827,584,654口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,112円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	29,482,753円																																																											
2018年 8月 9日から2018年 9月10日まで	2019年 2月 9日から2019年 3月 8日まで																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>45,009,698円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	45,009,698円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>43,891,800円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	43,891,800円																																																
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	45,009,698円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	43,891,800円																																																											

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	304,341,485円
分配準備積立金額	D	1,751,830,556円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,101,181,739円
当ファンドの期末残存口数	F	10,295,684,031口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,040円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	30,887,052円

2018年 9月11日から2018年10月 9日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	49,168,742円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	301,900,740円
分配準備積立金額	D	1,748,718,000円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,099,787,482円
当ファンドの期末残存口数	F	10,197,812,212口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,059円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	30,593,436円

2018年10月10日から2018年11月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,933,220円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	305,001,032円
分配準備積立金額	D	1,740,430,590円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,086,364,842円
当ファンドの期末残存口数	F	10,079,973,286口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,069円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	30,239,919円

2018年11月 9日から2018年12月10日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	42,425,740円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	308,025,878円
分配準備積立金額	D	1,730,877,969円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,081,329,587円
当ファンドの期末残存口数	F	9,995,265,285口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,082円

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	306,402,108円
分配準備積立金額	D	1,722,122,153円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,072,416,061円
当ファンドの期末残存口数	F	9,741,017,549口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,127円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	29,223,052円

2019年 3月 9日から2019年 4月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	45,066,849円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	308,490,231円
分配準備積立金額	D	1,713,189,491円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,066,746,571円
当ファンドの期末残存口数	F	9,638,189,231口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,144円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	28,914,567円

2019年 4月 9日から2019年 5月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,029,384円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	312,442,507円
分配準備積立金額	D	1,715,576,098円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,068,047,989円
当ファンドの期末残存口数	F	9,591,280,343口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,156円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	28,773,841円

2019年 5月 9日から2019年 6月10日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,056,207円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	313,495,971円
分配準備積立金額	D	1,716,113,959円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,065,666,137円
当ファンドの期末残存口数	F	9,545,706,375口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,163円

10,000口当たり分配金額	H	30円	10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	$I = F \times H / 10,000$	29,985,795円	収益分配金金額	$I = F \times H / 10,000$	28,637,119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 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(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> <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>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2018年12月10日現在	当期 2019年 6月10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>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>

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10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 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
期首元本額 10,678,308,293円	期首元本額 9,995,265,285円
期中追加設定元本額 86,526,103円	期中追加設定元本額 109,087,992円
期中一部解約元本額 769,569,111円	期中一部解約元本額 558,646,902円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2018年 6月 9日 至 2018年12月10日	当期 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	309,119,243	147,741,760
合計	309,119,243	147,741,760

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月10日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	野村米国好利回り社債投信 マザーファンド	3,666,048,606	8,705,032,414	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 99.0%	3,666,048,606	8,705,032,414 100.0%	
	合計			8,705,032,414	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「野村米国好利回り社債投信 Cコース」および「野村米国好利回り社債投信 Dコース」は「野村米国好利回り社債投信 マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2019年 6月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	530,775,617
コール・ローン	142,208,295
株式	102,432,248
新株予約権証券	575,846
社債券	13,687,182,838
貸付債権	854,076,920
未収入金	72,525,179
未収利息	224,992,271
前払費用	4,030,389
流動資産合計	15,618,799,603
資産合計	
15,618,799,603	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,000
未払金	173,075,157
未払解約金	93,600,000
未払利息	224

(2019年 6月10日現在)

流動負債合計	266,703,381
負債合計	266,703,381
純資産の部	
元本等	
元本	6,465,452,746
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,886,643,476
元本等合計	15,352,096,222
純資産合計	15,352,096,222
負債純資産合計	15,618,799,603

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>社債券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>貸付債権</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<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>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>



## （貸借対照表に関する注記）

2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,3745円
(10,000口当たり純資産額)	(23,745円)

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月10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>

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 新株予約権証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 貸付債権

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務（貸付債権は除く）

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月10日現在	
期首	2018年12月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	6,943,361,299円
同期中における追加設定元本額	118,854,401円
同期中における一部解約元本額	596,762,954円
期末元本額	6,465,452,746円
期末元本額の内訳＊	
野村米国好利回り社債投信 Aコース	322,913,095円
野村米国好利回り社債投信 Bコース	576,278,583円
野村米国好利回り社債投信 Cコース	956,210,534円
野村米国好利回り社債投信 Dコース	3,666,048,606円
ノムラ・グローバル・オールスターズ	921,585,429円
野村オールウェザー・ファクターアロケーションファンド（非課税適格機関投資家専用）	22,416,499円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年6月10日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	GENON HOLDINGS INC A COMMON STOCK	139	160.00	22,240.00	
		JONES ENERGY II INC	2,489	15.00	37,335.00	
		MOOD MEDIA CORP COMMON STOCK	35,000	0.15	5,250.00	

		MOOD MEDIA CORP RESTRICTED COMMON STOCK	28,571	0.15	4,285.65	
		NINE POINT ENERGY HOLDINGS COMMON	2,707	1.00	2,707.00	
		RUE21 CLASS A COM	347	1.30	451.10	
		VISTRA ENERGY CORP RIGHTS	3,853	0.77	2,966.81	
		WARREN RESOURCES INC	3,649	0.25	912.25	
		HERCULES OFFSHORE ESCROW COM	11,943	0.99	11,934.63	
		NINE POINT ENERGY HOLDINGS-PFD	46	100.00	4,600.00	
		PARKER DRILLING CO-POST BANK	968	19.28	18,663.04	
		BONANZA CREEK ENERGY INC	3,943	19.24	75,863.32	
		RIVIERA RESOURCES INC/LINN	494	12.60	6,224.40	
		NEENAH ENTERPRISES INC	107,778	3.00	323,334.00	
		CORNERSTONE BUILDING BRANDS INC	3,022	4.42	13,357.24	
		UC HOLDINGS INC	6,825	23.00	156,975.00	
		GATEWAY CASINOS ENTERTAINMENT LTD	140,813	0.61	87,004.12	
		BLUESTEM GROUP INC	11,344	0.47	5,388.40	
		DIRECTBUY HOLDINGS INC	2,772	0.00	0.00	
		AVAYA HOLDINGS CORP	6,760	12.36	83,553.60	
		VISTRA ENERGY CORP	3,313	24.31	80,539.03	
	小計	銘柄数：21			943,584.59	
					(102,397,799)	
		組入時価比率：0.7%			100.0%	
	カナダドル	CATALYST PAPER CORP	84,281	0.00	421.40	
	小計	銘柄数：1			421.40	
					(34,449)	
		組入時価比率：0.0%			0.0%	
	合計				102,432,248	
					(102,432,248)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2019年6月10日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

訂正有価証券届出書（内国投資信託）

新株予約権証券	米ドル	APPVION CORP WRT US03835B1180	341.00	0.00	
		APPVION CORP WRT US03835B1263	341.00	0.00	
		IPAYMENT HOLDINGS INC WARRANT 12/29/2022	836,360.00	0.00	
		JACK COOPER E 144A WARRANT	226.00	1,638.50	
		JONES ENERGY II INC WARRANT	904.00	0.00	
		MIDSTATES PETROLEUM CO INC WARRANT	2,186.00	21.86	
		VISTRA ENERGY CORP - CW24	1,823.00	3,646.00	
		銘柄数：7	842,181.00	5,306.36 (575,846)	
		組入時価比率：0.0%		0.0%	
	合計		575,846 (575,846)		
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	100,000.00	100,625.00	
		1011778 BC / NEW RED FIN	600,000.00	601,500.00	
		1839688 ALBERTA ULC	181,719.00	1,181.17	
		ABC SUPPLY CO INC	75,000.00	78,000.00	
		ACI WORLDWIDE INC	75,000.00	77,437.50	
		ACRISURE LLC / FIN INC	75,000.00	77,109.37	
		ACRISURE LLC / FIN INC	275,000.00	251,625.00	
		ADT SEC CORP	225,000.00	228,937.50	
		ADVANCED MICRO DEVICES	271,000.00	304,197.50	
		ADVANCED MICRO DEVICES	290,000.00	301,252.00	
		AHERN RENTALS INC	275,000.00	240,625.00	
		AIR CANADA	275,000.00	294,937.50	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	275,000.00	270,875.00	
		ALCOA INC	50,000.00	51,562.50	
		ALCOA INC	25,000.00	25,767.87	
		ALCOA INC	325,000.00	327,637.37	
		ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000.00	212,500.00	
		ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000.00	204,500.00	
		ALERIS INTL INC	50,000.00	52,500.00	
		ALGECO SCOTSMAN GLOB FIN	200,000.00	200,500.00	
		ALLY FINANCIAL	75,000.00	77,882.81	
		ALLY FINANCIAL INC	25,000.00	26,343.75	

ALLY FINANCIAL INC	100,000.00	101,750.00	
ALLY FINANCIAL INC	175,000.00	227,519.25	
ALPHA 2 BV	200,000.00	196,500.00	
ALPHA 3 BV / US BIDCO	200,000.00	197,000.00	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	198,625.00	
ALTICE LUXEMBOURG SA	400,000.00	404,000.00	
ALTICE SA	133,000.00	134,995.00	
ALTOS ESCROW DEBT	1,675,000.00	138,187.50	
ALTOS ESCROW DEBT	4,010,000.00	330,825.00	
AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	75,000.00	68,437.50	
AMC ENTERTAINMENT INC	175,000.00	159,792.50	
AMERICAN AIRLINES GROUP	175,000.00	179,812.50	
AMERICAN MIDSTREAM PTR/F	75,000.00	73,312.50	
AMERICAN WOODMARK CORP	25,000.00	24,562.50	
AMERIGAS PART/FIN CORP	100,000.00	104,250.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	150,000.00	154,500.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	175,000.00	181,930.00	
AMKOR TECHNOLOGY INC	75,000.00	73,687.50	
AMSTED INDUSTRIES	50,000.00	51,062.50	
ANGLO AMERICAN CAPITAL	200,000.00	206,199.00	
ANIXTER INC	200,000.00	206,000.00	
ANIXTER INC	75,000.00	79,687.50	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	200,000.00	201,500.00	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	100,000.00	100,750.00	
APPVION ESCROW	350,000.00	3,500.00	
ARAMARK SERVICES INC	100,000.00	102,970.00	
ARAMARK SERVICES INC	100,000.00	101,250.00	
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	125,000.00	127,187.50	
ARCONIC INC	25,000.00	26,446.25	
ARD FINANCE SA	600,000.00	603,180.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	200,500.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	211,750.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	300,000.00	301,875.00	
ARROW BIDCO LLC	50,000.00	49,625.00	
ARTESYN ESCROW INC	475,000.00	484,500.00	

ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	125,000.00	129,662.50	
ASCEND LEARNING LLC	75,000.00	75,750.00	
ASCEND LEARNING LLC	50,000.00	50,437.50	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	96,000.00	103,440.00	
ASHTON WOODS USA/FINANCE	125,000.00	118,437.50	
ASP AMC MERGER SUB	375,000.00	264,375.00	
ASSUREDPARTNERS INC	200,000.00	191,000.00	
AV HOMES INC	200,000.00	207,750.00	
AVANTOR INC	25,000.00	26,468.75	
AVANTOR INC	125,000.00	139,218.75	
AVAYA INC ESCROW 144A	275,000.00	0.00	
AVAYA INC ESCROW 144A	175,000.00	0.00	
AVENTINE ENERGY ESCROW	2,850,000.00	0.00	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	50,000.00	50,312.50	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	50,000.00	52,360.00	
B&G FOODS INC	100,000.00	98,625.00	
BAFFINLAND IRON CORP/LP	125,000.00	125,625.00	
BANFF MERGER SUB INC	100,000.00	93,850.00	
BANK OF AMERICA CORP	50,000.00	51,683.00	
BANK OF AMERICA CORP	550,000.00	591,406.75	
BANK OF AMERICA CORP	300,000.00	329,686.50	
BANK OF AMERICA CORP	75,000.00	82,564.12	
BANK OF NOVA SCOTIA	75,000.00	70,154.62	
BARCLAYS BANK PLC	200,000.00	217,067.00	
BARMINCO FINANCE PTY LTD	25,000.00	25,703.12	
BASIC ENERGY SERVICES	50,000.00	39,250.00	
BAUSCH HEALTH AMERICAS	175,000.00	188,562.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	55,000.00	55,618.75	
BAUSCH HEALTH COS INC	1,100,000.00	1,104,125.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	50,000.00	51,687.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	125,000.00	126,562.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	125,000.00	127,068.75	
BCD ACQUISITION INC	175,000.00	184,294.25	
BEACON ESCROW CORP	50,000.00	48,437.50	
BEACON ROOFING SUPPLY IN	175,000.00	182,656.25	

BEAZER HOMES USA	200,000.00	208,414.00	
BEAZER HOMES USA	2,000.00	1,970.00	
BEAZER HOMES USA	100,000.00	95,375.00	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	175,000.00	177,324.17	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	50,000.00	51,375.00	
BERRY PLASTICS CORP	100,000.00	102,500.00	
BIG RIVER STEEL/BRS FIN	175,000.00	182,656.25	
BILL BARRETT CORP	25,000.00	23,875.75	
BLOCK COMMUNICATIONS INC	150,000.00	156,000.00	
BLUE RACER MID LLC/FINAN	75,000.00	75,187.50	
BLUE RACER MID LLC/FINAN	50,000.00	50,375.00	
BMC EAST LLC	125,000.00	125,937.50	
BOMBARDIER INC	375,000.00	373,125.00	
BOMBARDIER INC	225,000.00	223,875.00	
BOMBARDIER INC	75,000.00	75,375.00	
BOMBARDIER INC	250,000.00	248,625.00	
BOYD GAMING CORP	675,000.00	701,156.25	
BOYD GAMING CORP	575,000.00	600,875.00	
BOYD GAMING CORP	100,000.00	102,875.00	
BOYNE USA INC	50,000.00	54,437.50	
BRAND ENERGY & INFRASTRU	150,000.00	132,375.00	
BROOKFIELD RESIDENTIAL	100,000.00	99,500.00	
BRUIN E&P PARTNERS LLC	250,000.00	223,750.00	
BUFFALO THUNDER DEV 144A	466,533.84	46.65	
BUFFALO THUNDER DEV 144A	1,052,025.00	562,833.37	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	25,000.00	25,531.25	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	125,000.00	128,750.00	
BUILDING MATERIALS CORP	500,000.00	515,625.00	
BWAY HOLDING CO	150,000.00	150,562.50	
BWAY HOLDING CO	500,000.00	482,500.00	
BWX TECHNOLOGIES INC	125,000.00	128,125.00	
CABLEVISION SYSTEMS CORP	50,000.00	51,812.50	
CALFRAC HOLDINGS LP	150,000.00	108,000.00	
CALIFORNIA RESOURCES CRP	750,000.00	533,906.18	
CALLON PETROLEUM CO	150,000.00	149,812.50	

CALLON PETROLEUM CO	150,000.00	147,750.00	
CALPINE CORP	475,000.00	476,638.75	
CALPINE CORP	275,000.00	283,250.00	
CALPINE CORP	150,000.00	148,582.50	
CALPINE CORP	225,000.00	225,281.25	
CAMELOT FINANCE SA	350,000.00	366,625.00	
CARDTRONICS INC / USA	150,000.00	149,250.00	
CARLSON TRAVEL INC	200,000.00	196,000.00	
CARRIZO OIL & GAS INC	112,000.00	106,120.00	
CARVANA CO	100,000.00	98,987.00	
CASCADES INC	75,000.00	75,750.00	
CBS OUT AMER CAP LLC/COR	125,000.00	127,343.75	
CCM MERGER INC	200,000.00	205,750.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	50,843.75	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	228,656.25	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	150,000.00	150,562.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	25,000.00	25,562.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	550,000.00	561,687.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	145,000.00	151,482.95	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	125,000.00	129,062.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	51,765.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	50,937.50	
CCO HOLDINGS LLC	450,000.00	469,968.75	
CDK GLOBAL INC	125,000.00	130,937.50	
CDK GLOBAL INC	25,000.00	25,250.00	
CDW LLC/CDW FINANCE	125,000.00	128,593.75	
CENTENE CORP	125,000.00	128,281.25	
CENTENE ESCROW I CORP	325,000.00	339,332.50	
CENTENNIAL RESOURCE PROD	125,000.00	119,375.00	
CENTRAL GARDEN & PET CO	125,000.00	130,000.00	
CENTURY COMMUNITIES	200,000.00	199,000.00	
CENTURY COMMUNITIES	200,000.00	200,000.00	
CENTURYLINK INC	100,000.00	103,346.00	
CENTURYLINK INC	25,000.00	26,500.00	
CF INDUSTRIES INC	118,000.00	122,141.80	



CF INDUSTRIES INC	375,000.00	337,500.00	
CHANGE HEALTH / FIN INC	75,000.00	73,218.75	
CHAPARRAL ENERGY INC	125,000.00	75,937.50	
CHARLES RIVER LABORATORI	100,000.00	105,250.00	
CHARLES SCHWAB CORP	175,000.00	173,250.00	
CHENIERE CORP CHRISTI HD	200,000.00	227,750.00	
CHENIERE CORP CHRISTI HD	125,000.00	137,343.75	
CHENIERE ENERGY PARTNERS	250,000.00	258,437.50	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	275,000.00	279,812.50	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	75,000.00	76,687.50	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	350,000.00	345,625.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	150,000.00	142,095.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	50,000.00	45,125.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	50,000.00	40,593.75	
CHOBANI LLC/FINANCE CORP	200,000.00	184,000.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH	171,000.00	115,425.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	100,000.00	80,750.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	50,000.00	50,187.50	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	96,000.00	71,520.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	150,000.00	144,937.50	
CHURCHILL DOWNS INC	100,000.00	103,250.00	
CHURCHILL DOWNS INC	175,000.00	172,156.25	
CINEMARK USA INC	325,000.00	330,687.50	
CIT GROUP INC	50,000.00	50,939.00	
CIT GROUP INC	50,000.00	52,750.00	
CITGO HOLDING INC	400,000.00	413,000.00	
CITGO PETROLEUM CORP	75,000.00	75,093.75	
CITIGROUP INC	25,000.00	24,913.00	
CITIGROUP INC	100,000.00	101,271.50	
CITIGROUP INC	100,000.00	108,039.50	
CLEAR CHANNEL COMM	232,853.00	23,971.07	
CLEAR CHANNEL INTL BV	25,000.00	25,718.75	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	225,000.00	231,187.50	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	100,000.00	107,750.00	
CLEARWATER SEAFOODS INC	25,000.00	24,906.25	

CLEARWAY ENERGY OP LLC	150,000.00	152,250.00	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	100,000.00	97,000.00	
CLEAVER-BROOKS INC	75,000.00	71,812.50	
CLEVELAND-CLIFFS INC	150,000.00	142,125.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	25,000.00	21,757.50	
CLIFFS NATURAL RESOURCES	72,000.00	70,380.00	
CLOUD CRANE LLC	175,000.00	188,125.00	
CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	225,000.00	23,625.00	
CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	300,000.00	6,000.00	
CNG HOLDINGS INC	75,000.00	74,812.50	
CNX MIDSTREAM PTR/CNX	100,000.00	96,250.00	
COEUR MINING INC	100,000.00	90,900.00	
COGENT COMMUNICATIONS GR	75,000.00	77,343.75	
COLFAX CORP	50,000.00	52,522.00	
COLFAX CORP	25,000.00	26,500.00	
COMMERCIAL METALS CO	125,000.00	123,437.50	
COMMScope FINANCE LLC	125,000.00	127,343.75	
COMMScope FINANCE LLC	75,000.00	76,500.00	
COMMScope FINANCE LLC	200,000.00	202,000.00	
COMMScope TECH FINANCE L	275,000.00	259,360.75	
COMPASS MINERALS INTERNA	200,000.00	190,500.00	
COMPRESSCO PARTNERS/FINA	150,000.00	135,375.00	
CONSOL ENERGY INC	57,000.00	55,734.60	
CONSOL MINING CORP	100,000.00	108,000.00	
CONSOLIDATED ENERGY FIN	150,000.00	149,250.00	
CONSTELLATION MERGER SUB	50,000.00	47,000.00	
CONSTELLIUM NV	250,000.00	258,125.00	
COOKE OMEGA/ALPHA VESSEL	175,000.00	172,812.50	
COOPER-STANDARD AUTOMOTI	150,000.00	132,000.00	
CORTES NP ACQUISITION	100,000.00	97,000.00	
COVEY PARK ENERGY LLC/FI	100,000.00	89,000.00	
CRC ESCROW ISSUER LLC	125,000.00	125,000.00	
CREDIT ACCEPTANC	75,000.00	78,281.25	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	125,000.00	127,187.50	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	150,000.00	148,117.50	

CRESTWOOD MIDSTREAM PART	125,000.00	128,747.50	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	200,000.00	194,250.00	
CSC HOLDINGS LLC	250,000.00	250,625.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	215,566.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	214,875.00	
CSTN MERGER SUB INC	100,000.00	93,750.00	
CSV ACQUISITION CORP	350,000.00	278,250.00	
CUMBERLAND FARMS	250,000.00	261,250.00	
CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN	50,000.00	51,125.00	
DAE FUNDING LLC	25,000.00	25,062.50	
DAE FUNDING LLC	225,000.00	230,343.75	
DAE FUNDING LLC	275,000.00	276,375.00	
DAE FUNDING LLC	75,000.00	76,125.00	
DANA HOLDING CORP	200,000.00	205,350.00	
DARLING INGREDIENTS INC	50,000.00	51,125.00	
DAVITA INC	75,000.00	76,125.00	
DCP MIDSTREAM OPERATING	150,000.00	157,486.50	
DCP MIDSTREAM OPERATING	100,000.00	101,562.50	
DELEK LOGISTICS PARTNERS	150,000.00	150,000.00	
DELL INC	75,000.00	75,093.75	
DELL INT LLC/EMC CORP	180,000.00	182,876.36	
DELL INT LLC/EMC CORP	25,000.00	26,783.86	
DELPHI JERSEY HOLDINGS	50,000.00	43,500.00	
DENBURY RESOURCES INC	345,000.00	335,512.50	
DENBURY RESOURCES INC	300,000.00	244,500.00	
DIAMOND OFFSHORE DRILL	100,000.00	90,500.00	
DIEBOLD INC	50,000.00	44,625.00	
DIGICEL GROUP LTD	449,000.00	161,640.00	
DIGICEL GROUP LTD	401,000.00	253,632.50	
DIGICEL LIMITED	400,000.00	265,000.00	
DISH DBS CORP	25,000.00	25,031.25	
DISH DBS CORP	50,000.00	47,312.50	
DISH DBS CORP	332,000.00	304,195.00	
DISH DBS CORP	50,000.00	47,437.50	
DONNELLEY FINANCIAL SOL	200,000.00	206,000.00	

DOWNSTREAM DEVELOPMENT	100,000.00	104,750.00	
DRIVETIME AUTO GP & ACCE	100,000.00	101,500.00	
EAGLE HOLDING CO II LLC	175,000.00	176,968.75	
EAGLE HOLDING CO II LLC	75,000.00	76,218.75	
EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000.00	199,560.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	50,000.00	52,240.61	
ELDORADA RESORTS INC	375,000.00	388,125.00	
ELDORADO RESORTS INC	125,000.00	130,156.25	
EMBARQ CORP	325,000.00	311,187.50	
EMC CORP	700,000.00	694,712.69	
EMI MUSIC PUBLISHING GRP	50,000.00	53,000.00	
ENDO FIN/ENDO LTD/E FINC	491,000.00	368,250.00	
ENERGIZER GAMMA ACQ INC	125,000.00	127,323.75	
ENERGIZER HOLDINGS INC	150,000.00	158,578.11	
ENERGY TRANSFER	125,000.00	129,253.81	
ENERGY TRANSFER OPERATNG	25,000.00	28,474.88	
ENLINK MIDSTREAM LLC	50,000.00	50,375.00	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	175,000.00	173,906.25	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	75,000.00	67,125.00	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	25,000.00	21,312.50	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	25,000.00	21,905.00	
ENPRO INDUSTRIES INC	100,000.00	101,250.00	
ENSIGN DRILLING INC	275,000.00	266,750.00	
ENTEGRIS INC	150,000.00	150,375.00	
ENTERCOM MEDIA CORP	25,000.00	25,593.75	
ENTERPRISE DEVELOP AUTH	150,000.00	160,500.00	
ENTERPRISE MERGER SUB IN	100,000.00	81,250.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	543,000.00	19,005.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	119,000.00	38,080.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	75,000.00	23,250.00	
EQUINIX INC	25,000.00	26,531.25	
EQUINIX INC	75,000.00	79,875.00	
ESCROW NEWPAGE CORP 10%	1,775,000.00	532.50	
EVEREST ACQ LLC/FINANCE	287,000.00	35,875.00	
EVERI PAYMENTS INC	150,000.00	156,750.00	

EW SCRIPPS CO	100,000.00	94,250.00	
EXELA INTERMED/EXELA FIN	125,000.00	100,625.00	
EXTERRAN NRG SOLUTIONS/F	225,000.00	230,625.00	
EXTRACTION OIL & GAS INC	150,000.00	121,500.00	
EXTRACTION OIL & GAS LLC	75,000.00	65,250.00	
FELCOR LODGING LP	175,000.00	182,656.25	
FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	50,000.00	36,875.00	
FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	100,000.00	86,500.00	
FERRELLGAS PARTNERS LP	50,000.00	36,875.00	
FIDELITY & GUARANTY LIFE	200,000.00	204,250.00	
FINANCIAL & RISK US HOLD	175,000.00	178,937.50	
FIRST DATA CORPORATION	25,000.00	25,808.75	
FIRST DATA CORPORATION	150,000.00	153,375.00	
FIRST QUALITY FINANCE CO	75,000.00	74,625.00	
FIRST QUANTUM MINERALS L	600,000.00	542,250.00	
FIRSTCASH INC	100,000.00	101,500.00	
FIVE POINT OP CO LP/FIVE	75,000.00	74,937.75	
FLEX ACQUISITION CO INC	75,000.00	68,062.50	
FLEX ACQUISITION CO INC	125,000.00	114,375.00	
FMG RESOURCES AUG 2006	125,000.00	127,031.25	
FONTAINEBLEAU LAS VEGAS	11,815,760.01	28,948.61	
FORESTAR GROUP INC	200,000.00	206,500.00	
FORTRESS TRANS & INFRAST	25,000.00	25,500.00	
FORTRESS TRANS & INFRAST	125,000.00	126,562.50	
FOUR FINANCE SA	200,000.00	191,202.80	
FREEPORT-MCMORAN C & G	200,000.00	177,500.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	100,000.00	100,969.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	225,000.00	222,117.75	
FRONTIER COMMUNICATIONS	1,100,000.00	807,812.48	
FRONTIER COMMUNICATIONS	25,000.00	16,312.50	
FRONTIER COMMUNICATIONS	150,000.00	144,375.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS	125,000.00	130,312.50	
FTS INTERNATIONAL INC	150,000.00	142,500.00	
GANNETT CO INC	125,000.00	125,625.00	
GANNETT CO INC	200,000.00	207,250.00	

GARDA WORLD SECURITY COR	450,000.00	448,875.00	
GARTNER INC	125,000.00	127,812.50	
GATEWAY CASINOS & ENTERT	200,000.00	210,000.00	
GCI LLC	75,000.00	76,312.50	
GCP APPLIED TECHNOLOGIES	50,000.00	50,640.00	
GENERAL MOTORS FINL CO	75,000.00	70,614.00	
GENESIS ENERGY LP/FIN	50,000.00	46,625.00	
GENON ENERGY NRG AMER	11,085.00	10,974.15	
GENWORTH HOLDINGS INC	50,000.00	50,250.00	
GEO GROUP INC/THE	100,000.00	93,500.00	
GLP CAPITAL LP / FIN II	75,000.00	79,642.50	
GMAC	175,000.00	224,875.00	
GO DADDY OPCO/FINCO	175,000.00	178,062.50	
GOEASY LTD	75,000.00	78,750.00	
GOLDEN ENTERTAINMENT INC	150,000.00	150,000.00	
GOLDEN NUGGET INC	225,000.00	227,880.00	
GOLDEN NUGGET INC	175,000.00	179,375.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,000.00	74,820.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	125,000.00	125,603.75	
GRAHAM HOLDINGS CO	125,000.00	131,400.00	
GRAY ESCROW INC	75,000.00	80,272.50	
GRAY TELEVISION INC	150,000.00	152,250.00	
GRAY TELEVISION INC	300,000.00	311,625.00	
GREAT LAKES DREDGE&DOCK	125,000.00	131,875.00	
GREIF INC	100,000.00	102,042.00	
GRIFFON CORPORATION	475,000.00	474,919.25	
GRINDING MED/MC GRINDING	175,000.00	162,531.25	
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	200,000.00	201,500.00	
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	125,000.00	128,125.00	
GRUBHUB HOLDINGS INC	75,000.00	75,000.00	
GTCR AP FINANCE INC	75,000.00	73,875.00	
GULFPORT ENERGY CORP	25,000.00	20,437.50	
GULFPORT ENERGY CORP	200,000.00	164,000.00	
GW HONOS SECURITY CORP	400,000.00	391,832.00	
H&E EQUIPMENT SERVICES	250,000.00	253,750.00	

HARLAND CLARKE HLDINGS	100,000.00	98,750.00	
HARLAND CLARKE HOLDINGS	225,000.00	192,093.75	
HARLAND ESCROW CORP	350,000.00	336,000.00	
HCA INC	150,000.00	165,937.50	
HCA INC	50,000.00	54,125.00	
HCA INC	150,000.00	171,375.00	
HCA INC	150,000.00	171,750.00	
HCA INC	50,000.00	54,500.00	
HCA INC	50,000.00	53,250.00	
HCA INC	25,000.00	27,000.00	
HCA INC	25,000.00	25,293.46	
HEALTHSOUTH CORP	46,000.00	46,920.00	
HECLA MINING CO	150,000.00	141,474.00	
HELLAS II	5,050,000.00	0.00	
HERC RENTALS INC	157,000.00	163,280.00	
HERC RENTALS INC	89,000.00	94,395.62	
HESS INF PART / FIN CORP	150,000.00	154,500.00	
HEXION 2 US FIN CORP	325,000.00	61,750.00	
HEXION INC	150,000.00	118,125.00	
HEXION US FIN/NOVA SCOTI	370,000.00	71,687.50	
HILLMAN GROUP INC	170,000.00	156,400.00	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	325,000.00	334,847.50	
HLF FIN SARL LLC/HERBALI	75,000.00	75,468.75	
HOLLY ENERGY PARTNERS LP	125,000.00	129,687.50	
HUB INTERNATIONAL LTD	225,000.00	225,562.50	
HUDBAY MINERALS INC	75,000.00	76,218.75	
HUDBAY MINERALS INC	150,000.00	150,927.00	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	400,000.00	410,000.00	
HUNT COS INC	175,000.00	163,187.50	
IAA SPINCO INC	100,000.00	101,760.00	
IAMGOLD CORP	200,000.00	201,480.00	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	400,000.00	402,180.00	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	350,000.00	359,187.50	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	100,000.00	102,125.00	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	75,000.00	75,562.50	

IHEARTCOMMUNICATIONS INC	52,867.00	55,725.51	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	5,375.00	5,677.34	
ILFC E-CAPITAL TRUST I	470,000.00	338,677.30	
INCEPTION MRGR/RACKSPACE	150,000.00	136,500.00	
INDALEX HOLDING	3,767,000.00	75,340.00	
INDIGO NATURAL RES LLC	125,000.00	112,812.50	
INEOS GROUP HOLDINGS SA	200,000.00	198,000.00	
INFOR US INC	575,000.00	586,287.25	
INGLES MARKETS INC	75,000.00	76,875.00	
INMARSAT FINANCE PLC	100,000.00	101,625.00	
INMARSAT FINANCE PLC	25,000.00	26,312.50	
INN OF THE MOUNTAIN GODS	104,416.00	104,546.52	
INTELSAT CONNECT FINANCE	375,000.00	325,781.25	
INTELSAT JACKSON HLDG	225,000.00	220,005.00	
INTELSAT JACKSON HLDG	475,000.00	478,562.50	
INTELSAT LUXEMBOURG SA	225,000.00	164,812.50	
INTERGEN NV	100,000.00	91,500.00	
INVENTIVE GRP HLDGS INC	135,000.00	141,750.00	
IRB HOLDING CORP	125,000.00	122,812.50	
IRON MOUNTAIN INC	25,000.00	25,187.50	
ITALICS MERGER SUB	100,000.00	101,750.00	
ITRON INC	75,000.00	75,187.50	
JACK OHIO FIN LLC/FIN 1	175,000.00	187,906.25	
JACOBS ENTERTAINMENT INC	325,000.00	346,937.50	
JAGGED PEAK ENERGY LLC	125,000.00	119,062.50	
JB POINDEXTER & CO INC	125,000.00	128,437.50	
JBS USA LLC/JBS USA FINA	50,000.00	51,712.50	
JBS USA LLC/JBS USA FINA	50,000.00	51,500.00	
JBS USA/FOOD/FINANCE	175,000.00	185,937.50	
JC PENNEY CORP INC	125,000.00	64,375.00	
JC PENNEY CORPORATION IN	100,000.00	25,500.00	
JELD-WEN INC	75,000.00	72,562.50	
JPMORGAN CHASE & CO	375,000.00	412,700.62	
JPMORGAN CHASE & CO	125,000.00	132,940.62	
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	159,302.25	



JPMORGAN CHASE & CO	75,000.00	74,531.25	
K HOVNANIAN ENTERPRISES	79,000.00	76,630.00	
K HOVNANIAN ENTERPRISES	79,000.00	32,785.00	
KAR AUCTION SERVICES INC	50,000.00	50,350.50	
KB HOME	100,000.00	107,375.00	
KB HOME	25,000.00	27,531.25	
KB HOME	75,000.00	78,890.62	
KCA DEUTAG UK FINANCE PL	200,000.00	146,000.00	
KENNEDY-WILSON INC	200,000.00	202,000.00	
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	150,000.00	155,062.50	
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	175,000.00	175,437.50	
KINROSS GOLD CORP	100,000.00	103,130.00	
KINROSS GOLD CORP	125,000.00	121,875.00	
KIRS MIDCO 3 PLC	200,000.00	183,500.00	
KISSNER GR HLDG	175,000.00	182,000.00	
KOPPERS INC	75,000.00	70,500.00	
KRATON POLYMERS LLC/CAP	250,000.00	250,625.00	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	225,000.00	226,125.00	
LAMAR MEDIA CORP	25,000.00	26,401.25	
LAREDO PETROLEUM INC	25,000.00	22,750.00	
LBC TANK TERMINAL HLDING	200,000.00	195,500.00	
LENNAR CORP	300,000.00	306,375.00	
LENNAR CORP	25,000.00	26,468.75	
LENNAR CORP	50,000.00	51,687.50	
LEVEL 3 FINANCING INC	25,000.00	25,218.75	
LEVEL 3 FINANCING INC	400,000.00	408,000.00	
LHMC FINCO SARL	200,000.00	209,137.60	
LIONS GATE CAPITAL HOLD	200,000.00	208,500.00	
LIONS GATE CAPITAL HOLD	100,000.00	102,250.00	
LITHIA MOTORS INC	100,000.00	101,375.00	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	100,000.00	101,500.00	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	75,000.00	78,468.75	
LONESTAR RESOURCES AMERI	75,000.00	72,984.00	
LTF MERGER SUB INC	800,000.00	822,000.00	
LUCENT TECHNOLOGIES	75,000.00	74,250.00	

MAGNOLIA OIL GAS/MAG FIN	50,000.00	50,750.00	
MALLINCKRODT FIN/SB	150,000.00	106,500.00	
MANITOWOC COMPANY INC	50,000.00	48,750.00	
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	25,000.00	26,375.00	
MASONITE INTERNATIONAL C	50,000.00	51,125.00	
MATCH GROUP INC	250,000.00	263,281.25	
MATCH GROUP INC	50,000.00	50,750.00	
MATCH GROUP INC	50,000.00	52,265.00	
MATTHEWS INTERNATIONAL C	125,000.00	119,687.50	
MBIA INC	150,000.00	146,250.00	
MBIA INSURANCE CO	425,000.00	299,625.00	
MCDERMOTT ESCROW 1/ESC 2	125,000.00	110,468.75	
MEDIACOM BRDBND LLC/CORP	31,000.00	31,038.75	
MEDNAX INC	75,000.00	76,312.50	
MEG ENERGY CORP	225,000.00	199,406.25	
MELCO RESORTS FINANCE	200,000.00	197,773.50	
MERCER INTL INC	235,000.00	242,050.00	
MERCER INTL INC	100,000.00	105,500.00	
MERISANT ESCROW	4,750,000.00	0.00	
MERITAGE HOMES CORP	300,000.00	317,250.00	
MERLIN ENTERTAINMENTS PL	200,000.00	206,750.00	
MGIC INVESTMENT CORP	150,000.00	162,000.00	
MGM GROWTH/MGM FINANCE	50,000.00	52,562.50	
MGM RESORTS INTL	275,000.00	287,223.06	
MGM RESORTS INTL	100,000.00	111,250.00	
MGM RESORTS INTL	25,000.00	25,687.50	
MICHAEL BAKER INTL	100,000.00	101,000.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	25,000.00	25,651.39	
MICRON TECHNOLOGY INC	25,000.00	25,747.50	
MICRON TECHNOLOGY INC	25,000.00	25,697.31	
MIDAS INT HOLDCO II/FIN	150,000.00	139,500.00	
MIDCONTINENT COMM & FIN	350,000.00	365,750.00	
MIDSTATES PETRO ESCROW	525,000.00	0.00	
MIDSTATES PETRO ESCROW	125,000.00	0.00	
MIDWEST VANADIUM PTY LTD	186,458.05	242.39	

MINERAL RESOURCES LTD	175,000.00	176,750.00	
MIRABELA NICKEL LTD SUBO	5,379.74	0.00	
MOHEGAN TRIBAL GAMING AU	375,000.00	362,925.00	
MOOD MED BWR/MOOD MED CO	112,557.00	98,768.76	
MOSS CREEK RESOURCES HLD	225,000.00	187,312.50	
MOUNTAIN PROVINCE DIAMON	75,000.00	75,281.25	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	150,000.00	150,750.00	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	175,000.00	182,656.25	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	75,000.00	76,875.00	
MSCI INC	100,000.00	102,125.00	
MSCI INC	75,000.00	79,406.25	
MUELLER WATER PRODUCTS	25,000.00	25,562.50	
MULTI-COLOR CORP	150,000.00	154,875.00	
MURPHY OIL CORP	125,000.00	130,000.00	
MURRAY ENERGY CORP	795,621.00	274,489.24	
NABORS INDUSTRIES INC	100,000.00	101,375.00	
NATHAN'S FAMOUS INC	75,000.00	73,875.00	
NATIONAL CINEMEDIA LLC	350,000.00	353,500.00	
NATIONAL CINEMEDIA LLC	25,000.00	23,875.00	
NATIONSTAR MORT/CAP CORP	125,000.00	123,046.87	
NATIONSTAR MTG	150,000.00	150,375.00	
NATIONSTAR MTG	50,000.00	50,125.00	
NAVIENT CORP	50,000.00	50,687.50	
NAVIENT CORP	75,000.00	78,750.00	
NAVIENT CORP	75,000.00	78,656.25	
NAVIENT CORP	200,000.00	211,250.00	
NAVIENT CORP	450,000.00	452,250.00	
NAVIENT CORP	150,000.00	154,875.00	
NAVIENT CORP	150,000.00	153,750.00	
NAVIOS MARITIME ACQ CORP	225,000.00	185,625.00	
NAVISTAR INTL CORP	25,000.00	25,745.00	
NCL CORP LTD	182,000.00	185,867.50	
NCR CORP	125,000.00	126,718.75	
NETFLIX INC	75,000.00	77,625.00	
NETFLIX INC	50,000.00	52,515.00	

NETFLIX INC	157,000.00	158,570.00	
NETFLIX INC	100,000.00	107,500.00	
NETFLIX INC	300,000.00	332,625.00	
NETFLIX INC	125,000.00	129,843.75	
NEW ENTERPRISE STONE & L	275,000.00	280,417.50	
NEW ENTERPRISE STONE & L	100,000.00	99,750.00	
NEWMARK GROUP INC	100,000.00	103,470.20	
NEXSTAR BROADCASTING INC	100,000.00	101,375.00	
NEXSTAR ESCROW CORP	225,000.00	230,062.50	
NEXTERA ENERGY OPERATING	125,000.00	125,000.00	
NFP CORP	250,000.00	241,875.00	
NGPL PIPECO LLC	175,000.00	180,906.25	
NINE ENERGY SERVICE INC	50,000.00	49,500.00	
NMG FINCO PLC	200,000.00	193,680.00	
NOBLE HOLDING INTL LTD	99,000.00	77,715.00	
NOBLE HOLDING INTL LTD	25,000.00	14,750.00	
NOBLE HOLDING INTL LTD	75,000.00	54,000.00	
NOKIA OYJ	75,000.00	75,000.00	
NORTHERN OIL AND GAS INC	50,625.00	52,270.31	
NORTHWEST ACQ/DOMINION	100,000.00	70,250.00	
NOVA CHEMICALS CORP	125,000.00	118,281.25	
NOVELIS CORP	25,000.00	25,875.00	
NOVELIS CORP	450,000.00	448,875.00	
NRG ENERGY INC	150,000.00	162,562.50	
NRG ENERGY INC	25,000.00	25,968.75	
NUSTAR LOGISTICS LP	100,000.00	101,625.00	
NVA HOLDINGS	50,000.00	49,875.00	
NWH ESCROW CORP	125,000.00	76,250.00	
OASIS PETROLEUM INC	100,000.00	98,500.00	
OASIS PETROLEUM INC	100,000.00	92,250.00	
OCI NV	200,000.00	206,000.00	
OI EUROPEAN GROUP BV	100,000.00	99,250.00	
OLIN CORP	75,000.00	73,218.75	
OPEN TEXT CORP	200,000.00	210,000.00	
ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTI	400,000.00	379,000.00	

OWENS-BROCKWAY	125,000.00	133,827.50	
OXFORD FIN LLC/CO-ISS II	125,000.00	129,350.00	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	50,000.00	50,500.00	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	175,000.00	175,000.00	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	75,000.00	72,562.50	
PANTHER BF AGGREGATOR 2	25,000.00	25,812.50	
PANTHER BF AGGREGATOR 2	225,000.00	230,062.50	
PARK AEROSPACE HOLDINGS	425,000.00	444,490.50	
PARK-OHIO INDUSTRIES INC	75,000.00	74,250.00	
PARKLAND FUEL CORP	50,000.00	51,000.00	
PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	225,000.00	232,312.50	
PATTERN ENERGY GROUP INC	100,000.00	102,250.00	
PBF LOGISTICS LP/FINANCE	370,000.00	380,175.00	
PENSKE AUTO GROUP INC	275,000.00	280,156.25	
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	75,000.00	75,187.50	
PETRA DIAMONDS US TREAS	200,000.00	192,500.00	
PETROBAKKEN ENERGY LTD	450,000.00	0.00	
PGT ESCROW ISSUER INC	100,000.00	105,625.00	
PILGRIM'S PRIDE CORP	100,000.00	102,650.00	
PILGRIM'S PRIDE CORP	75,000.00	77,625.00	
PIONEER HOLDING/FINANCE	125,000.00	128,125.00	
PLASTIPAK HOLDINGS INC	75,000.00	67,578.75	
PLATFORM SPECIALTY PROD	175,000.00	179,375.00	
POLARIS INTERMEDIATE	225,000.00	224,437.50	
POST HOLDINGS INC	75,000.00	76,807.50	
POST HOLDINGS INC	50,000.00	49,937.50	
POST HOLDINGS INC	275,000.00	281,187.50	
POST HOLDINGS INC	125,000.00	126,406.25	
PQ CORP	50,000.00	50,375.00	
PRECISION DRILLING CORP	150,000.00	142,875.00	
PRESTIGE BRANDS INC	75,000.00	75,562.50	
PRESTIGE BRANDS INC	125,000.00	129,531.25	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	65,000.00	68,290.62	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	75,000.00	75,093.75	
PRISO ACQUISITION CORP	350,000.00	329,437.50	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,000.00	26,149.50	
QEP RESOURCES INC	25,000.00	22,437.50	
QORVO INC	100,000.00	102,411.00	
QTS LP/FINANCE	100,000.00	98,500.00	
RADIAN GROUP INC	131,000.00	133,947.50	
RADIAN GROUP INC	79,000.00	84,332.50	
RADIAN GROUP INC	175,000.00	176,968.75	
RADIATE HOLDCO / FINANCE	225,000.00	222,750.00	
RANGE RESOURCES CORP	150,000.00	149,250.00	
RANGE RESOURCES CORP	25,000.00	24,257.50	
RANGE RESOURCES CORP	75,000.00	71,269.50	
REALOGY GROUP/CO- ISSUER	175,000.00	164,500.00	
REALOGY GROUP/CO- ISSUER	25,000.00	24,125.00	
REVLON ESCROW CORP	50,000.00	32,750.00	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	145,366.16	145,729.57	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	250,000.00	253,955.00	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	150,000.00	153,281.25	
RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	150,000.00	151,875.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	150,000.00	153,816.00	
RITE AID CORP	25,000.00	14,875.00	
RITE AID CORP	150,000.00	84,750.00	
ROCKIES EXPRESS PIPELINE	25,000.00	27,125.00	
ROCKPOINT GAS STORAGE CA	100,000.00	101,250.00	
ROSE ROCK MIDSTREAM/FIN	75,000.00	73,875.00	
ROWAN COMPANIES INC	175,000.00	140,175.00	
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	200,000.00	206,150.00	
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	200,000.00	213,750.00	
RP CROWN PARENT LLC	275,000.00	284,968.75	
RRI ENERGY ESCROW	50,000.00	0.00	
SABLE INTL FINANCE LTD	67,000.00	69,512.50	
SABRA HEALTH/CAPTL CORP	125,000.00	126,875.00	
SALEM MEDIA GROUP INC.	50,000.00	44,250.00	
SANCHEZ ENERGY CORP	342,000.00	39,330.00	
SANCHEZ ENERGY CORP	325,000.00	37,375.00	
SANJEL CORP	200,000.00	1,124.00	

SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	225,000.00	226,687.50	
SCHWEITZER-MAUDUIT INTL	100,000.00	101,750.00	
SCOTTS MIRACLE-GRO CO	50,000.00	52,000.00	
SELECT MEDICAL CORP	150,000.00	150,337.50	
SERVICE CORP INTL	75,000.00	77,625.00	
SESI LLC	100,000.00	72,000.00	
SESI LLC	125,000.00	79,375.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY	200,000.00	190,000.00	
SEVENTY SEVEN ESCROW	175,000.00	0.00	
SHEA HOMES LP/FNDG CP	25,000.00	25,000.00	
SHELF DRILL HOLD LTD	175,000.00	164,500.00	
SINCLAIR TELEVISION GROU	100,000.00	102,625.00	
SINCLAIR TELEVISION GROU	175,000.00	172,812.50	
SIRIUS XM RADIO INC	225,000.00	226,406.25	
SIRIUS XM RADIO INC	100,000.00	99,875.00	
SIRIUS XM RADIO INC	275,000.00	278,781.25	
SLM CORP	525,000.00	532,875.00	
SM ENERGY CO	150,000.00	149,295.00	
SM ENERGY CO	50,000.00	45,000.00	
SM ENERGY CO	25,000.00	22,719.75	
SOLERA LLC / SOLERA FINA	200,000.00	217,500.00	
SONIC AUTOMOTIVE INC	175,000.00	171,062.50	
SOTHEBY'S	175,000.00	167,261.50	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	63,000.00	59,062.50	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	175,000.00	197,750.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	25,000.00	26,375.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	225,000.00	240,187.50	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	400,000.00	427,750.00	

SPRINGLEAF FINANCE CORP	125,000.00	127,812.50	
SPRINT CAPITAL CORP	825,000.00	957,000.00	
SPRINT COMMUNICATIONS	175,000.00	203,875.00	
SPRINT COMMUNICATIONS	25,000.00	25,685.00	
SPRINT CORP	575,000.00	621,000.00	
SPX FLOW INC	100,000.00	104,028.00	
SPX FLOW INC	100,000.00	104,250.00	
SS&C TECHNOLOGIES INC	350,000.00	363,343.75	
STANDARD INDUSTRIES INC	25,000.00	25,656.25	
STANDARD INDUSTRIES INC	75,000.00	73,218.75	
STAPLES INC	275,000.00	269,500.00	
STAPLES INC	100,000.00	98,375.00	
STAR MERGER SUB INC	75,000.00	77,578.12	
STAR MERGER SUB INC	300,000.00	312,375.00	
STARS GRP HLDS/STARS GRP	125,000.00	130,312.50	
STARWOOD PROPERTY TRUST	50,000.00	50,125.00	
STATION CASINOS LLC	75,000.00	73,010.25	
STEVENS HOLDING CO INC	75,000.00	78,750.00	
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	300,000.00	297,750.00	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	50,000.00	49,625.00	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	50,000.00	51,625.00	
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	300,000.00	294,000.00	
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	75,000.00	66,000.00	
SUMMIT MIDSTREAM PARTNER	275,000.00	250,446.62	
SUNGARD AVAIL SERV CAP	250,000.00	9,375.00	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	225,000.00	229,781.25	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	25,000.00	25,375.00	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	175,000.00	178,988.25	
SUPERIOR PLUS/GEN PRTNR	50,000.00	50,750.00	
SURGERY CENTER HOLDINGS	50,000.00	50,875.00	
T-MOBILE USA INC	125,000.00	126,782.50	
T-MOBILE USA INC	75,000.00	76,968.75	
T-MOBILE USA INC	100,000.00	104,500.00	
T-MOBILE USA INC	125,000.00	128,125.00	
T-MOBILE USA INC	50,000.00	50,250.00	



T-MOBILE USA INC	225,000.00	227,261.25	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	75,000.00	75,187.50	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	25,000.00	25,937.50	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	75,000.00	74,906.25	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	100,000.00	102,598.00	
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	49,375.00	
TARGA RESOURCES PARTNERS	75,000.00	75,656.25	
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	53,043.50	
TARGA RESOURCES PARTNERS	75,000.00	80,531.25	
TASEKO MINES LTD	275,000.00	263,312.50	
TECK COMINCO LIMITED	300,000.00	328,253.49	
TECK RESOURCES LIMITED	75,000.00	76,137.69	
TECK RESOURCES LIMITED	250,000.00	257,789.95	
TECK RESOURCES LIMITED	75,000.00	75,922.41	
TECK RESOURCES LIMITED	175,000.00	181,193.79	
TECK RESOURCES LIMITED	50,000.00	52,927.64	
TECK RESOURCES LIMITED	25,000.00	24,115.84	
TECK RESOURCES LIMITED	50,000.00	49,805.56	
TEMPO ACQUISITION LLC/FI	275,000.00	281,875.00	
TENET HEALTHCARE CORP	75,000.00	77,437.50	
TENET HEALTHCARE CORP	200,000.00	202,500.00	
TENET HEALTHCARE CORP	200,000.00	202,000.00	
TENET HEALTHCARE CORP	25,000.00	25,812.50	
TENNANT CO	100,000.00	102,500.00	
TENNECO INC	225,000.00	189,562.50	
TENNECO INC	25,000.00	19,000.00	
TERRAFORM POWER OPERATIN	75,000.00	74,010.00	
TERRAFORM POWER OPERATIN	150,000.00	157,500.00	
TESLA INC	150,000.00	129,000.00	
TEXAS COMPETITIVE ESCROW	225,000.00	1,125.00	
TITAN INTERNATIONAL INC	250,000.00	217,187.50	
TMS INTERNATIONAL CORP	100,000.00	98,000.00	
TOLL BROS FINANCE CORP	350,000.00	373,187.50	
TOPBUILD ESCROW CORP	150,000.00	152,250.00	
TOPS HOLDING II ESCROW	307,000.00	0.00	

TOWNSQUARE MEDIA INC	250,000.00	244,687.50	
TPC GROUP INC	300,000.00	300,600.00	
TRANSDIGM INC	525,000.00	532,875.00	
TRANSDIGM INC	175,000.00	177,458.75	
TRANSDIGM INC	125,000.00	130,000.00	
TRANSDIGM INC	175,000.00	179,375.00	
TRANSMONTAIGE PARTNERS	100,000.00	96,500.00	
TRANSOCEAN GUARDIAN LTD	23,625.00	23,920.31	
TRANSOCEAN INC	100,000.00	98,000.00	
TRANSOCEAN INC	200,000.00	209,744.00	
TRANSOCEAN INC	25,000.00	23,468.75	
TRANSOCEAN INC	75,000.00	70,890.00	
TRANSOCEAN PONTUS LTD	70,875.00	72,115.31	
TRANSOCEAN POSEIDON	75,000.00	78,000.00	
TRANSOCEAN SEDCO FOREX	100,000.00	83,000.00	
TRANSOCEAN SENTRY LTD	75,000.00	74,672.25	
TRI POINTE GROUP INC	150,000.00	141,000.00	
TRI POINTE HOLDINGS INC	250,000.00	250,000.00	
TRIANGLE USA PETROLEUM	125,000.00	0.00	
TRIDENT MERGER SUB INC	75,000.00	69,375.00	
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	225,000.00	211,223.25	
TRIUMPH GROUP INC	100,000.00	97,250.00	
TRONOX FINANCE PLC	200,000.00	190,750.00	
TULLOW OIL PLC	200,000.00	199,950.00	
TULLOW OIL PLC	200,000.00	198,250.00	
TWIN RIVER WORLDWIDE HLD	50,000.00	51,500.00	
UNITED CONTINENTAL HLDGS	75,000.00	75,649.50	
UNITED RENTALS NORTH AM	75,000.00	79,687.50	
UNITED RENTALS NORTH AM	25,000.00	27,057.50	
UNITED STATES STEEL CORP	125,000.00	108,593.75	
UNITI GROUP/CSL CAPITAL	125,000.00	110,625.00	
UNITYMEDIA KABELBW GMBH	400,000.00	415,200.00	
UNIVISION COMMUNICATIONS	24,000.00	24,510.00	
UPC HOLDING BV	200,000.00	198,500.00	
UPCB FINANCE IV LTD	200,000.00	204,500.00	

US AIRWAYS 2012-2B PTT	69,834.69	73,843.83	
US CONCRETE INC	275,000.00	285,312.50	
US FOODS INC	125,000.00	129,043.75	
USA COM PART/USA COM FIN	175,000.00	180,687.50	
USA COM PART/USA COM FIN	125,000.00	128,437.50	
USI INC	175,000.00	171,535.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS	16,000.00	16,180.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS	750,000.00	828,937.50	
VALVOLINE FINCO TWO LLC	25,000.00	25,625.00	
VANTIV LLC/ISSUER CORP	200,000.00	207,040.00	
VECTOR GROUP LTD	50,000.00	45,875.00	
VECTOR GROUP LTD	125,000.00	118,125.00	
VERITAS US INC/BERMUDA L	200,000.00	168,500.00	
VERSCEND HOLDING CORP	150,000.00	161,062.50	
VERSUM MATERIALS INC	75,000.00	80,250.00	
VERTIV INT HOLD CORP	575,000.00	555,593.75	
VHF PARENT LLC/ORCHESTRA	75,000.00	77,794.50	
VIASAT INC	75,000.00	76,546.50	
VIKING CRUISES LTD	100,000.00	102,500.00	
VIKING CRUISES LTD	125,000.00	123,313.75	
VINE OIL & GAS LP / FIN	225,000.00	158,062.50	
VISTAJET MALTA/XO MGMT	150,000.00	146,625.00	
VISTRA ENERGY CORP	372,000.00	385,578.00	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	150,000.00	150,583.23	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	150,000.00	157,312.50	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	225,000.00	225,000.00	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	100,000.00	100,462.07	
VIZIENT INC	50,000.00	52,500.00	
VTR FINANCE BV	360,000.00	371,250.00	
WABASH NATIONAL CORP	100,000.00	95,000.00	
WARRIOR MET COAL LLC	87,000.00	90,751.87	
WEATHERFORD BERMUDA	50,000.00	24,875.00	
WEATHERFORD BERMUDA	75,000.00	38,062.50	
WEATHERFORD BERMUDA	25,000.00	12,437.50	
WEATHERFORD BERMUDA	75,000.00	37,125.00	

WEATHERFORD INTL LLC	50,000.00	24,625.00	
WEATHERFORD INTL LTD	250,000.00	126,250.00	
WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	250,000.00	246,800.00	
WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	175,000.00	172,375.00	
WEIGHT WATCHERS INTL INC	100,000.00	95,375.00	
WELLCARE HEALTH PLANS	125,000.00	130,156.25	
WELLS FARGO & COMPANY	175,000.00	180,159.87	
WERNER FINCO LP/INC	300,000.00	260,250.00	
WEST STREET MERGER SUB	225,000.00	212,062.50	
WESTERN DIGITAL CORP	100,000.00	97,125.00	
WHITING PETROLEUM CORP	25,000.00	25,000.00	
WHITING PETROLEUM CORP	25,000.00	24,656.25	
WILDHORSE RESOURCE DEVEL	250,000.00	244,687.50	
WILLIAM LYON HOMES INC	100,000.00	100,500.00	
WILLIAM LYON HOMES INC	100,000.00	101,500.00	
WILLIAM LYON HOMES INC	200,000.00	194,500.00	
WILLIAMS COMPANIES INC	100,000.00	102,372.02	
WILLIAMS COS INC	148,000.00	163,771.51	
WILLIAMS SCOTSMAN INTL	175,000.00	178,557.75	
WINDSTREAM SRVC / FIN	112,000.00	113,120.00	
WINDSTREAM SRVC/FIN	511,000.00	158,410.00	
WMG ACQUISITION CORP	75,000.00	76,500.00	
WMG ACQUISITION CORP	100,000.00	101,750.00	
WPX ENERGY INC	75,000.00	83,589.56	
WR GRACE & CO-CONN	125,000.00	127,187.50	
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	200,000.00	195,250.00	
WYNN MACAU LTD	200,000.00	192,500.00	
WYNN MACAU LTD	200,000.00	190,000.00	
XPLORNET COMMUNICATIONS	123,038.00	127,344.33	
XPO LOGISTICS INC	81,000.00	82,923.75	
XPO LOGISTICS INC	85,000.00	87,358.75	
ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	200,000.00	205,250.00	
ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	25,000.00	25,726.00	
ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	425,000.00	435,625.00	
ZIGGO BOND CO BV	350,000.00	343,010.50	

		CITIGROUP INC 6.8750% Series K	206,725.00	228,389.78	
	小計	銘柄数：863	171,476,238.49	126,125,901.58 (13,687,182,838)	
		組入時価比率：89.2%		100.0%	
	合計			13,687,182,838 (13,687,182,838)	
	合計			13,687,758,684 (13,687,758,684)	

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

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

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

(注4)備考欄の の銘柄はハイブリッド優先証券であることを表しております。

## 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	2019年 6月10日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	86,780,000	-	86,808,000	28,000
米ドル	86,780,000	-	86,808,000	28,000
合計	86,780,000	-	86,808,000	28,000

### (注) 時価の算定方法

#### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 第3 その他特定資産の明細表(2019年6月10日現在)

特定資産の種類 (銘柄名)	数量	帳簿価額		評価額		評価損益	備考
		単価	金額	単価	金額		
貸付債権							

米ドル							
21ST CENTURY TRM B	121,277.35	91.67	111,174.94	86.63	105,056.50	6,118.44	
ABC SUPPLY TL B #2	49,872.77	99.18	49,463.81	98.36	49,055.40	408.41	
ADIENT INITIAL TERM LOAN	31,250.00	99.50	31,093.75	97.92	30,598.96	494.79	
ADIENT INITIAL TL 02	18,750.00	99.50	18,656.25	97.92	18,359.38	296.87	
AIR METHODS CORP TRM	147,375.00	84.67	124,782.41	86.93	128,111.02	3,328.61	
ALERIS INTERNATI INI TRM	124,062.50	100.21	124,323.03	100.04	124,114.23	208.80	
ALTRA INDUSTRIAL TL	71,921.64	97.50	70,123.59	98.83	71,082.53	958.94	
ASURION REPLACE B6 TRM	95,361.58	98.00	93,454.34	99.69	95,063.57	1,609.23	
ASURION(LONESTAR) B4 IRL	224,974.71	98.21	220,947.66	99.72	224,342.08	3,394.42	
BCP RENAISSANCE INI TL B	173,563.13	98.80	171,480.37	99.45	172,602.28	1,121.91	
BIG RIVER STEEL TL	49,126.55	100.56	49,401.65	100.38	49,310.77	90.88	
BOSTON GENERATING TRM 2L	1,357,664.13	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
BOYD GMNG REFINNCNG TL B	48,122.64	99.12	47,699.16	99.43	47,845.93	146.77	
BURGER KING CORP TL B3#1	67,965.39	97.50	66,266.25	98.94	67,243.25	977.00	
BURGER KING CORP TL B3#2	54,790.03	97.50	53,420.27	98.94	54,207.88	787.61	
BWAY CORP INITIAL #9	622.17	96.49	600.39	97.20	604.72	4.33	
BWAY CORP INITIAL TRM	243,889.15	96.50	235,353.03	97.20	237,051.47	1,698.44	
CAESARS ENTERTIMNT TRM B	197,500.00	96.93	191,436.75	99.03	195,586.62	4,149.87	
CALIFORNIA RESOURCES TRM	50,000.00	105.75	52,875.00	101.75	50,875.00	2,000.00	
CAMELOT FIN TRM #1	7,776.12	99.27	7,719.35	100.06	7,780.98	61.63	
CAMELOT FIN TRM #2	4,788.36	99.27	4,753.40	100.06	4,791.35	37.95	
CAMELOT FIN TRM #3	591.35	99.27	587.09	100.06	591.71	4.62	
CAMELOT FIN TRM #4	1,166.28	99.27	1,157.87	100.06	1,167.00	9.13	
CITYCENTER HLDGS TRM B	73,501.88	96.91	71,230.67	99.33	73,011.84	1,781.17	
CLOUD PEAK ENERGY DIP TL	74,230.33	100.00	74,230.33	100.00	74,230.33	0.00	
COMMSCOPE B-2 TRM	25,000.00	98.60	24,650.00	99.75	24,937.50	287.50	
CONSOLIDATED INIT TL 02	19,823.11	98.50	19,525.76	99.41	19,705.40	179.64	
CONSOLIDATED INITIAL TRM	173,687.50	98.25	170,647.96	97.50	169,345.31	1,302.65	
CONSOLIDATED INITIAL TRM	103,305.79	98.50	101,756.20	99.41	102,692.36	936.16	
DAVIS VISION(WINK) INTL	123,437.50	97.81	120,734.21	97.69	120,583.00	151.21	
DUN AND BRDST INITIAL TL	75,000.00	99.98	74,990.13	99.81	74,859.37	130.76	
DYNASTY ACQUISITN TL B-1	16,258.74	99.50	16,177.45	100.30	16,308.10	130.65	
DYNASTY ACQUISITN TL B-2	8,741.26	99.49	8,697.55	100.30	8,767.79	70.24	
EQUINOX HOLDINGS TRM B1	25,000.00	99.87	24,968.75	99.83	24,958.32	10.43	
EVERI PAYMENTS TRM B	193,905.99	99.20	192,354.74	99.88	193,663.60	1,308.86	
FINANCIAL&RISK DOLLAR TL	124,687.50	96.42	120,223.68	97.44	121,492.38	1,268.70	
FIRST DATA 2024A NEW DTL	25,000.00	97.12	24,281.02	99.89	24,973.22	692.20	
FLEX ACQUISITION INI TRM	145,415.17	96.25	139,962.10	95.96	139,546.64	415.46	
FOUNDATION BUILDING B TL	124,687.50	96.87	120,784.78	98.81	123,206.83	2,422.05	
GATEWAY CASINOS INI TRM	148,875.00	98.68	146,909.85	99.88	148,688.90	1,779.05	
GENWORTH HOLDING INI TRM	74,250.00	100.87	74,895.97	100.75	74,806.87	89.10	
GLOBAL AVIATION 2ND LIEN	276,371.44	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
GOLDEN NUGGET TRM B	66,742.95	98.41	65,681.73	99.30	66,278.15	596.42	
GOLDEN NUGGET TRM B02	53,247.59	98.41	52,401.62	99.30	52,876.77	475.15	
HD SUPPLY WATERWORKS TL2	69,709.01	98.00	68,314.82	99.79	69,563.80	1,248.98	
HD SUPPLY WATERWORKS TRM	77,917.23	98.00	76,358.88	99.79	77,754.92	1,396.04	
HILTON WORLDWIDE B2 TRM	75,000.00	100.00	75,000.00	99.85	74,885.40	114.60	

HILTON WORLDWIDE B2 TRM	100,000.00	99.30	99,300.18	99.85	99,847.20	547.02	
HUB INTERNATIONAL TL	123,750.00	97.06	120,114.84	97.33	120,443.52	328.68	
HUB INTERNATIONAL TLO5	312.50	97.06	303.32	97.33	304.15	0.83	
IQVIA INC TRM B3	99,748.74	98.85	98,601.62	99.39	99,143.16	541.54	
KEANE GROUP INITIAL TRM	49,625.00	94.25	46,771.56	98.50	48,880.62	2,109.06	
KSBR HOLDING (SABRE)TRM	25,000.00	99.00	24,750.00	100.88	25,218.75	468.75	
LIFE TIME FITNESS #1 B	389,884.75	97.59	380,525.06	99.42	387,610.55	7,085.49	
LIFE TIME FITNESS #8 B	992.07	97.59	968.25	99.42	986.28	18.03	
MRO HOLDINGS INITIAL TRM	100,000.00	99.50	99,500.00	99.75	99,750.00	250.00	
MULTIPLAN INITIAL TL	155,243.99	97.45	151,285.26	97.64	151,578.52	293.26	
NATIONAL INTERGOV TRM	28,684.59	99.06	28,414.96	98.63	28,290.17	124.79	
NATIONAL INTERGOV TRM	72,253.37	98.99	71,530.83	98.63	71,259.88	270.95	
NATIONAL INTERGOV TRM 02	29,866.40	99.00	29,567.74	98.63	29,455.73	112.01	
NATIONAL INTERGOV TRM 02	11,856.96	99.05	11,745.50	98.63	11,693.92	51.58	
NATIONAL INTERGOV TRM 03	9,083.45	99.05	8,998.05	98.63	8,958.55	39.50	
NATIONAL INTERGOV TRM 03	22,880.23	99.00	22,651.43	98.63	22,565.62	85.81	
NAVISTAR B TRM	197,128.13	97.87	192,929.30	99.83	196,799.51	3,870.21	
NUMERICABLE \$ TLB13 IRL	373,125.00	94.43	352,341.93	97.44	363,563.67	11,221.74	
PANTHER BF AGGRE 2ND TLB	250,000.00	99.00	247,500.00	99.42	248,541.75	1,041.75	
PAREXEL INTER INITIAL TL	117,071.73	96.43	112,892.26	95.69	112,023.01	869.25	
PARKER DRILLING 2ND	20,571.43	91.63	18,851.32	103.25	21,240.00	2,388.68	
PCI GAMING TRM B FACILTY	50,000.00	99.50	49,750.00	99.95	49,973.20	223.20	
PISCES MIDCO INITL TL	49,625.00	96.25	47,764.06	97.75	48,508.43	744.37	
PRAIRIE ECI ACQUIOR TRM	75,000.00	99.25	74,437.50	100.47	75,351.60	914.10	
PRISO ACQUISI TL B	291,108.10	96.87	282,010.97	94.75	275,824.92	6,186.05	
RADIATE CLOSING DATE TL	122,500.00	97.50	119,437.50	98.22	120,322.19	884.69	
RHP HOTEL PROP B TRM NEW	97,257.56	98.50	95,798.69	99.53	96,801.61	1,002.92	
SERTA SIMMONS TRM 2L	166,133.33	73.58	122,246.38	48.88	81,197.66	41,048.72	
SIX FLAGS TRANCHE B TL	25,000.00	99.75	24,937.50	99.84	24,960.95	23.45	
SS&C TECHNOLOGIES TL B-3	29,086.72	99.89	29,057.49	99.41	28,914.00	143.49	
SS&C TECHNOLOGIES TL B-4	20,403.04	99.89	20,380.59	99.41	20,281.88	98.71	
STAPLES 2019 RFNIG B1 TL	150,000.00	99.00	148,500.00	95.83	143,749.95	4,750.05	
SURGERY PARTNERS INIT TL	123,373.74	98.25	121,214.69	98.06	120,983.37	231.32	
TACALA INVESTMEN 1L TRM	24,625.62	98.12	24,162.65	99.19	24,425.53	262.88	
TEAM HEALTH INITIAL TL	119,500.00	92.75	110,836.25	89.38	106,803.12	4,033.13	
TEMPO ACQUISITION INI TL	147,375.00	98.52	145,193.85	99.56	146,730.23	1,536.38	
UFC TRM 1ST LIEN	98,125.00	99.32	97,462.87	99.94	98,063.67	600.80	
UNIFRAX USD TERM LOAN	49,875.00	99.50	49,625.62	97.50	48,628.12	997.50	
UNITED SITE INI TRM 1L	98,500.00	98.87	97,386.95	99.88	98,376.87	989.92	
VISTRA ENERGY 2018 IRL#1	52,437.15	98.78	51,802.10	99.73	52,292.94	490.84	
VISTRA ENERGY 2018 IRL#2	147,123.16	98.79	145,346.96	99.73	146,718.57	1,371.61	
VISTRA ENERGY INITIAL TL	50,000.00	99.87	49,937.50	99.84	49,921.90	15.60	
WESTERN DIG US TRM B-4	81,428.93	96.77	78,798.77	97.00	78,986.06	187.29	
WINDSTREAM SERVICES TRM	75,000.00	99.50	74,625.00	100.00	75,000.00	375.00	
WP DELUXE INITL TRM	49,375.00	97.37	48,076.43	97.50	48,140.62	64.19	
WP DELUXE INITL TRM 2L	49,148.94	98.00	48,165.96	98.75	48,534.57	368.61	
小計			7,868,048.25		7,870,225.95	2,177.70	
銘柄数：93			(853,840,596)		(854,076,920)	(236,324)	

組入時価比率：5.6%					100.0%		
貸付債権計			853,840,596		854,076,920	236,324	
			(853,840,596)		(854,076,920)	(236,324)	
					100.0%		
合計			853,840,596		854,076,920	236,324	
			(853,840,596)		(854,076,920)	(236,324)	

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

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

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

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

#### 野村米国好利回り社債投信 Cコース

2019年6月28日現在

資産総額	4,563,497,918円
負債総額	2,242,926,390円
純資産総額（ - ）	2,320,571,528円
発行済口数	3,065,963,249口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7569円

#### 野村米国好利回り社債投信 Dコース

2019年6月28日現在

資産総額	8,773,208,007円
負債総額	12,660,656円
純資産総額（ - ）	8,760,547,351円
発行済口数	9,505,357,094口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9216円

#### （参考）野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

2019年6月28日現在

資産総額	15,317,277,325円
負債総額	2,500,255円
純資産総額（ - ）	15,314,777,070円
発行済口数	6,438,938,659口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3785円





### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1 委託会社等の概況

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

2019年7月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

##### (a) 会社の意思決定機構

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

##### 株主総会

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

##### 取締役会

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

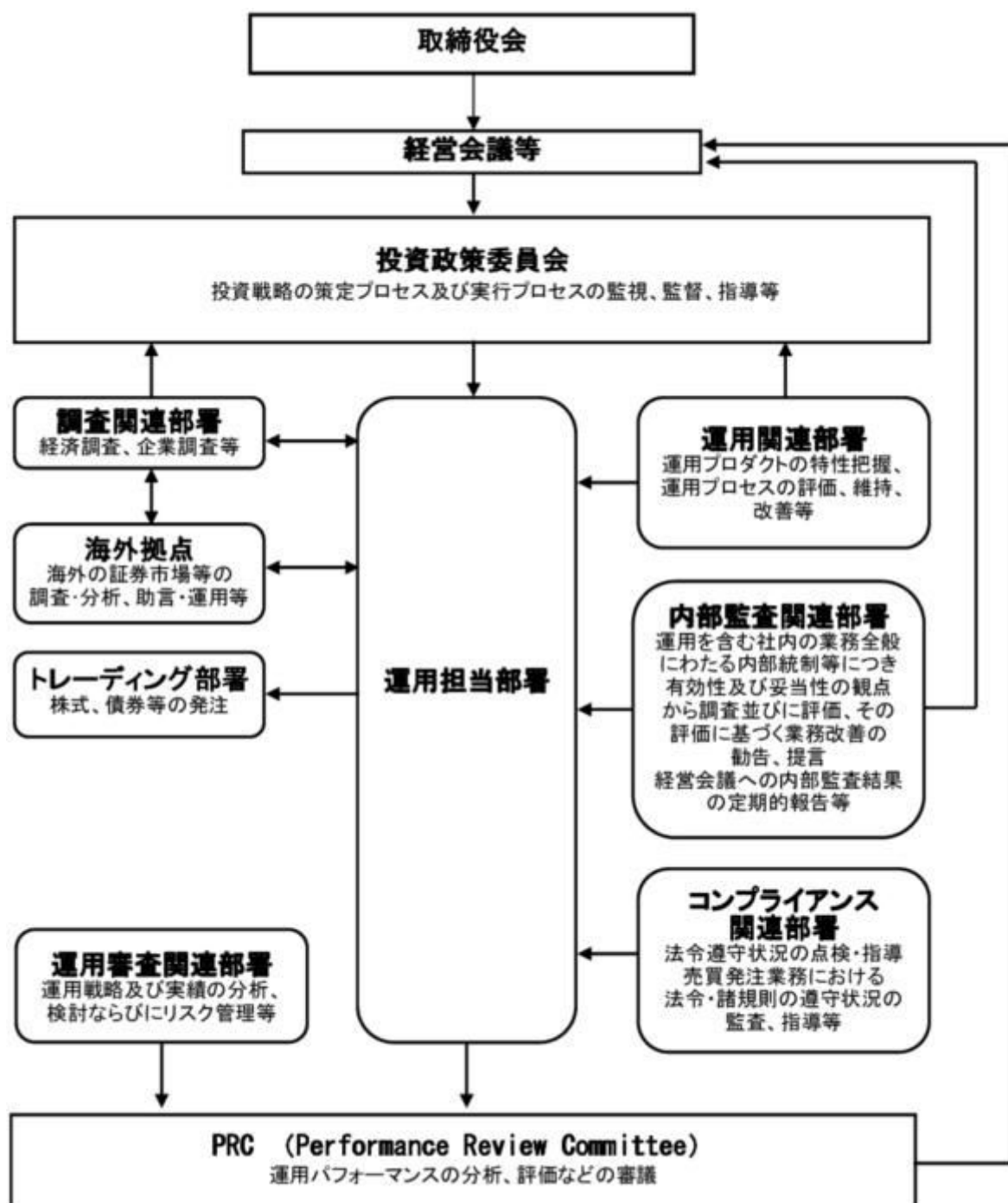
##### 代表取締役・業務執行取締役

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

##### 監査等委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2 事業の内容及び営業の概況

## &lt;更新後&gt;

「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2019年6月28日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。 )。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,025	28,005,123
単位型株式投資信託	178	1,004,188
追加型公社債投資信託	14	5,223,933
単位型公社債投資信託	426	1,725,132
合計	1,643	35,958,375

### 3 委託会社等の経理状況

#### < 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。  
なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

#### ( 1 ) 貸借対照表

		前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			919		1,562
金銭の信託			47,936		45,493
有価証券			22,600		19,900
前払金			0		-
前払費用			26		27
未収入金			464		500
未収委託者報酬			24,059		25,246
未収運用受託報酬			6,764		5,933
その他			181		269
貸倒引当金			15		15
流動資産計			102,937		98,917
固定資産					

有形固定資産			874		714
建物	2	348		320	
器具備品	2	525		393	
無形固定資産			7,157		6,438
ソフトウェア		7,156		6,437	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,825		18,608
投資有価証券		1,184		1,562	
関係会社株式		9,033		12,631	
従業員長期貸付金		36		-	
長期差入保証金		54		235	
長期前払費用		36		22	
前払年金費用		2,350		2,001	
繰延税金資産		3,074		2,694	
その他		168		168	
貸倒引当金		0		-	
投資損失引当金		-		707	
固定資産計			23,969		25,761
資産合計			126,906		124,679

		前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			133		145
未払金	1		17,853		16,709
未払収益分配金		1		0	
未払償還金		31		25	
未払手数料		7,884		7,724	
関係会社未払金		7,930		7,422	
その他未払金		2,005		1,535	
未払費用	1		12,441		11,704
未払法人税等			2,241		1,560
前受収益			33		29
賞与引当金			4,626		3,792
流動負債計			37,329		33,942
固定負債					
退職給付引当金			2,938		3,219
時効後支払損引当金			548		558
固定負債計			3,486		3,777
負債合計			40,816		37,720
(純資産の部)					
株主資本			86,078		86,924
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,168		56,014
利益準備金		685		685	

その他利益剰余金		54,483		55,329	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,876		30,723	
評価・換算差額等			11		33
その他有価証券評価差額金			11		33
純資産合計			86,090		86,958
負債・純資産合計			126,906		124,679

## ( 2 ) 損益計算書

		前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			115,907		119,196
運用受託報酬			26,200		21,440
その他営業収益			338		355
営業収益計			142,447		140,992
営業費用					
支払手数料			45,252		42,675
広告宣伝費			1,079		1,210
公告費			0		0
調査費			30,516		30,082
調査費		5,830		5,998	
委託調査費		24,685		24,083	
委託計算費			1,376		1,311
営業雑経費			5,464		5,435
通信費		125		92	
印刷費		966		970	
協会費		79		86	
諸経費		4,293		4,286	
営業費用計			83,689		80,715
一般管理費					
給料			11,716		11,113
役員報酬		425		379	
給料・手当		6,856		7,067	
賞与		4,433		3,666	
交際費			132		107
旅費交通費			482		514
租税公課			1,107		1,048
不動産賃借料			1,221		1,223
退職給付費用			1,110		1,474
固定資産減価償却費			2,706		2,835
諸経費			9,131		10,115
一般管理費計			27,609		28,433
営業利益			31,148		31,843

		前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,031		6,538	
受取利息		4		0	
その他		362		424	
営業外収益計			4,398		6,964
営業外費用					
支払利息		2		1	
金銭の信託運用損		312		489	
時効後支払損引当金繰入額		13		43	
為替差損		46		34	
その他		31		17	
営業外費用計			405		585
経常利益			35,141		38,222
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		20	
関係会社清算益	3	-		29	
株式報酬受入益		75		85	
特別利益計			95		135
特別損失					
投資有価証券等評価損		2		938	
関係会社株式評価損		-		161	
固定資産除却損	2	58		310	
投資損失引当金繰入額		-		707	
特別損失計			60		2,118
税引前当期純利益			35,176		36,239
法人税、住民税及び事業税			10,775		10,196
法人税等調整額			439		370
当期純利益			24,840		25,672

## ( 3 ) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	41	41	86,878
当期変動額			
剰余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924



(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
剰余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<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 ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法  (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)  時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産  定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。  主な耐用年数は以下の通りであります。  建物 38～50年  附属設備 8～15年  構築物 20年  器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産  定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金  一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金  賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>

<p>5. 消費税等の会計処理方法</p> <p>6. 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</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>(5) 投資損失引当金 子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p> <p>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>連結納税制度を適用しております。</p>
---	--

## 【未適用の会計基準等】

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 【表示方法の変更に関する注記】

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期

首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」2,111百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」3,074百万円に含めて表示しております。

## [注記事項]

### 貸借対照表関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。
未払費用 1,781百万円	未払費用 1,434百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 708百万円	建物 736百万円
器具備品 3,491	器具備品 3,106
合計 4,200	合計 3,842

### 損益計算書関係

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019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 4,026百万円	受取配当金 6,531百万円
支払利息 2	支払利息 1
2. 固定資産除却損	2. 固定資産除却損
建物 4百万円	建物 -百万円
器具備品 0	器具備品 3
ソ フ ト ウ エ 53	ソ フ ト ウ エ 307
ア	ア
合計 58	合計 310
	3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。

### 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 剰余金の配当に関する事項

## ( 1 ) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12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	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

当事業年度(自 2018年4月 1 日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## ( 1 ) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25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

2019年5月15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	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

## 金融商品関係

前事業年度(自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2018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	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-

その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

## 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	919	-	-	-
金銭の信託	47,936	-	-	-
未収委託者報酬	24,059	-	-	-
未収運用受託報酬	6,764	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
其他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2019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	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-
(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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



ます。

#### (5) 有価証券及び投資有価証券

##### その他有価証券

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

#### (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）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	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

#### 有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日）

##### 1．売買目的有価証券(2018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(2018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(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2018年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2019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(2019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(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2019年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

## 5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

### 退職給付関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	18,163 百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	929 百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	887

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

## 及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019年3月31日)
------------------------	------------------------

<p>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</p> <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>百万円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金</td><td>1,434</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>910</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td><td>417</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>409</td></tr> <tr> <td>投資損失引当金</td><td>-</td></tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td><td>207</td></tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td><td>169</td></tr> <tr> <td>減価償却超過額</td><td>171</td></tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td><td>148</td></tr> <tr> <td>未払社会保険料</td><td>107</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>566</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>4,543</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>735</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>3,808</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>    その他有価証券評価差額金</td><td>5</td></tr> <tr> <td>    前払年金費用</td><td>728</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>733</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td><td>3,074</td></tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,434	退職給付引当金	910	投資有価証券評価減	417	未払事業税	409	投資損失引当金	-	ゴルフ会員権評価減	207	時効後支払損引当金	169	減価償却超過額	171	子会社株式売却損	148	未払社会保険料	107	その他	566	繰延税金資産小計	4,543	評価性引当額	735	繰延税金資産合計	3,808	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	5	前払年金費用	728	繰延税金負債合計	733	繰延税金資産の純額	3,074	<p>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</p> <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>百万円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金</td><td>1,175</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>998</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td><td>708</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>288</td></tr> <tr> <td>投資損失引当金</td><td>219</td></tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td><td>192</td></tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td><td>172</td></tr> <tr> <td>減価償却超過額</td><td>171</td></tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td><td>148</td></tr> <tr> <td>未払社会保険料</td><td>82</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>466</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>4,625</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>1,295</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>3,329</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>    その他有価証券評価差額金</td><td>15</td></tr> <tr> <td>    前払年金費用</td><td>620</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>635</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td><td>2,694</td></tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,175	退職給付引当金	998	投資有価証券評価減	708	未払事業税	288	投資損失引当金	219	ゴルフ会員権評価減	192	時効後支払損引当金	172	減価償却超過額	171	子会社株式売却損	148	未払社会保険料	82	その他	466	繰延税金資産小計	4,625	評価性引当額	1,295	繰延税金資産合計	3,329	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	15	前払年金費用	620	繰延税金負債合計	635	繰延税金資産の純額	2,694
繰延税金資産	百万円																																																																																
賞与引当金	1,434																																																																																
退職給付引当金	910																																																																																
投資有価証券評価減	417																																																																																
未払事業税	409																																																																																
投資損失引当金	-																																																																																
ゴルフ会員権評価減	207																																																																																
時効後支払損引当金	169																																																																																
減価償却超過額	171																																																																																
子会社株式売却損	148																																																																																
未払社会保険料	107																																																																																
その他	566																																																																																
繰延税金資産小計	4,543																																																																																
評価性引当額	735																																																																																
繰延税金資産合計	3,808																																																																																
繰延税金負債																																																																																	
その他有価証券評価差額金	5																																																																																
前払年金費用	728																																																																																
繰延税金負債合計	733																																																																																
繰延税金資産の純額	3,074																																																																																
繰延税金資産	百万円																																																																																
賞与引当金	1,175																																																																																
退職給付引当金	998																																																																																
投資有価証券評価減	708																																																																																
未払事業税	288																																																																																
投資損失引当金	219																																																																																
ゴルフ会員権評価減	192																																																																																
時効後支払損引当金	172																																																																																
減価償却超過額	171																																																																																
子会社株式売却損	148																																																																																
未払社会保険料	82																																																																																
その他	466																																																																																
繰延税金資産小計	4,625																																																																																
評価性引当額	1,295																																																																																
繰延税金資産合計	3,329																																																																																
繰延税金負債																																																																																	
その他有価証券評価差額金	15																																																																																
前払年金費用	620																																																																																
繰延税金負債合計	635																																																																																
繰延税金資産の純額	2,694																																																																																
<p>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</p> <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>31.0%</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>3.4%</td></tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td><td>1.8%</td></tr> <tr> <td>外国税額控除</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td><td>0.3%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>29.3%</td></tr> </table>	法定実効税率	31.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.4%	タックスヘイブン税制	1.8%	外国税額控除	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.3%	<p>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</p> <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>31.0%</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.1%</td></tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>5.6%</td></tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td><td>2.6%</td></tr> <tr> <td>外国税額控除</td><td>0.6%</td></tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td><td>0.3%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>1.3%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>29.1%</td></tr> </table>	法定実効税率	31.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	タックスヘイブン税制	2.6%	外国税額控除	0.6%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	その他	1.3%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%																																												
法定実効税率	31.0%																																																																																
(調整)																																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%																																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.4%																																																																																
タックスヘイブン税制	1.8%																																																																																
外国税額控除	0.2%																																																																																
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%																																																																																
その他	0.4%																																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.3%																																																																																
法定実効税率	31.0%																																																																																
(調整)																																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%																																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%																																																																																
タックスヘイブン税制	2.6%																																																																																
外国税額控除	0.6%																																																																																
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%																																																																																
その他	1.3%																																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%																																																																																

## セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借及び購入等  役員の兼任	資金の借入(*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息の支払	2	未払費用	-

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	37,482	未払手数料	6,691

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借及び購入等  役員の兼任	資金の借入(*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息の支払	1	未払費用	-

## (イ) 子会社等

該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等



種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*2）	34,646	未払手数料	6,410

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

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

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1 株当たり純資産額	16,714円33銭	1 株当たり純資産額	16,882円89銭
1 株当たり当期純利益	4,822円68銭	1 株当たり当期純利益	4,984円30銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1 株当たり当期純利益の算定上の基礎		1 株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	24,840百万円	損益計算書上の当期純利益	25,672百万円
普通株式に係る当期純利益	24,840百万円	普通株式に係る当期純利益	25,672百万円
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

## 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

&lt; 更新後 &gt;

## (1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	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。

\* 2019年6月末現在

## (2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

\* 2019年6月末現在

## (3) 投資顧問会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC. (ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク)	45,376,777.75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。

\* 2019年3月末現在

## 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2019年8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

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村米国好利回り社債投信 Cコースの2018年12月11日から2019年6月10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。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村米国好利回り社債投信 Cコースの2019年6月10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。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2019年8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

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村米国好利回り社債投信 Dコースの2018年12月11日から2019年6月10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。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村米国好利回り社債投信 Dコースの2019年6月10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。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

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	櫻井 雄一郎
--------------------	-------	--------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村 健二郎
--------------------	-------	--------

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

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2019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。

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記は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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。