

## 【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】	2020年8月27日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村米国好利回り社債投信 Cコース 野村米国好利回り社債投信 Dコース
【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 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、2020年2月26日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

## (3) ファンドの仕組み

## &lt; 更新後 &gt;

委託会社の概況(2020年7月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村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%

## 3 投資リスク

## &lt; 更新後 &gt;

## ■ リスクの定量的比較 (2015年7月末～2020年6月末：月次)

### ICコース

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	18.6	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△12.3	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	0.8	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- \* 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。2015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、2015年7月から2020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。
- \* 2015年7月から2020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。

### IDコース

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	21.7	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△18.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	1.6	5.0	6.8	2.8	1.8	0.8	0.2

- \* 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。2015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、2015年7月から2020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。
- \* 2015年7月から2020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・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）</li> </ul>
<p style="text-align: center;">■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○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、指数額の公表、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、責任を有しません。</li> <li>○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。</li> <li>○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。</li> <li>○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。</li> <li>○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・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額や額段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスも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、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。</li> </ul> <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）についての種別、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関連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。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。</p> <p style="text-align: right;">（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他）</p>

#### 4 手数料等及び税金

##### （５）課税上の取扱い

###### <更新後>

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

###### 個人、法人別の課税について

###### 個人の投資家に対する課税

###### <収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除は適用されません。

###### <換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

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

###### 損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <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。

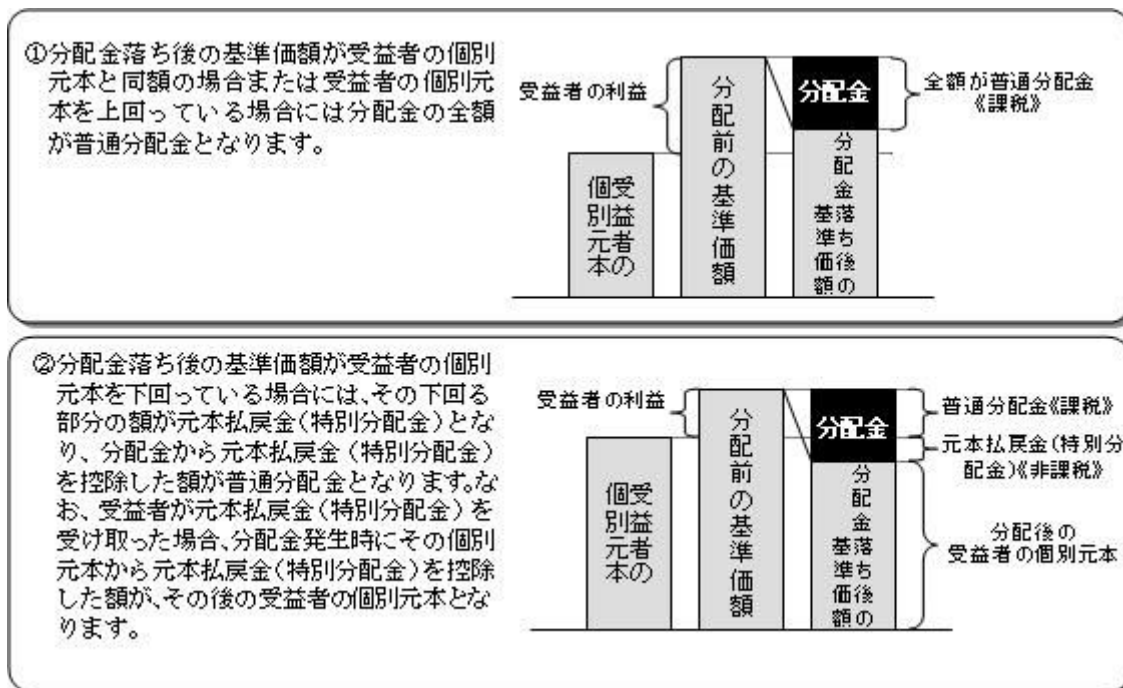
#### 個別元本について

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。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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（2020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2020年6月30日現在の運用状況であります。

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

### (1) 投資状況

#### 野村米国好利回り社債投信 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	1,450,113,636	98.95
現金・預金・その他資産(負債控除後)		15,255,468	1.04
合計(純資産総額)		1,465,369,104	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	7,239,656,113	99.19
現金・預金・その他資産(負債控除後)		58,772,661	0.80
合計(純資産総額)		7,298,428,774	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	46,041,431	0.36
外国証券（優先証券）	アメリカ	10,096,420	0.08
新株予約権証券	アメリカ	770,608	0.00
新株予約権付社債券等	アメリカ	646,440	0.00
社債券	アメリカ	11,808,510,685	93.95
現金・預金・その他資産（負債控除後）		702,246,410	5.58
合計（純資産総額）		12,568,311,994	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	5,108,607.54	336,020,491	2.67

## （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	616,518,701	2.4452	1,507,523,559	2.3521	1,450,113,636	98.95

## 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	98.95
合計	98.95

## 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	3,077,954,217	2.4460	7,528,676,015	2.3521	7,239,656,113	99.19

## 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	99.19
合 計	99.19

## (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	SPRINT CAPITAL CORP	600,000	12,726.24	76,357,493	15,392.27	92,353,651	8.75	2032/3/15	0.73
2	アメリカ	社債券	BAUSCH HEALTH COS INC	800,000	11,253.44	90,027,544	10,843.06	86,744,491	6.125	2025/4/15	0.69
3	アメリカ	社債券	KRAFT HEINZ FOODS CO	750,000	9,980.32	74,852,473	10,532.63	78,994,726	4.375	2046/6/1	0.62
4	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	675,000	11,460.84	77,360,687	11,136.92	75,174,224	5.75	2030/1/15	0.59
5	アメリカ	社債券	LTF MERGER SUB INC	800,000	11,020.88	88,167,090	9,062.49	72,499,970	8.5	2023/6/15	0.57
6	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE HOLDING SA	600,000	12,282.53	73,695,238	11,871.60	71,229,608	10.5	2027/5/15	0.56
7	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	600,000	9,104.03	54,624,180	10,580.98	63,485,903	5.113	2029/5/3	0.50
8	アメリカ	社債券	GLOBAL AIR LEASE CO LTD	838,000	10,429.37	87,398,149	7,568.73	63,425,999	6.5	2024/9/15	0.50
9	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	650,000	10,834.60	70,424,925	9,487.31	61,667,548	5.5	2027/11/15	0.49
10	アメリカ	社債券	VALEANT PHARMACEUTICALS	525,000	12,282.36	64,482,390	11,609.30	60,948,868	9	2025/12/15	0.48
11	アメリカ	社債券	FIRST QUANTUM MINERALS L	600,000	10,853.72	65,122,366	10,047.88	60,287,318	6.5	2024/3/1	0.47
12	アメリカ	社債券	BUFFALO THUNDER DEV 144A	1,052,025	5,494.73	57,806,038	5,494.73	57,806,038	0	2022/12/9	0.45
13	アメリカ	社債券	BOYD GAMING CORP	525,000	11,566.66	60,725,017	10,250.81	53,816,776	6.375	2026/4/1	0.42
14	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	500,000	10,538.30	52,691,539	10,543.92	52,719,606	4.625	2024/7/15	0.41

15	アメリカ	社債券	TESLA INC	475,000	10,382.90	49,318,793	10,644.98	50,563,661	5.3	2025/8/15	0.40
16	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	450,000	10,818.17	48,681,780	10,963.62	49,336,301	4.5	2032/5/1	0.39
17	アメリカ	社債券	GOLDEN NUGGET INC	625,000	10,122.12	63,263,286	7,873.31	49,208,225	6.75	2024/10/15	0.39
18	アメリカ	社債券	ICAHN ENTERPRISES/FIN	450,000	11,020.89	49,594,036	10,906.95	49,081,280	6.25	2026/5/15	0.39
19	アメリカ	社債券	DCP MIDSTREAM OPERATING	475,000	10,960.63	52,063,004	10,324.83	49,042,952	5.125	2029/5/15	0.39
20	アメリカ	社債券	VIPER ENERGY PARTNERS LP	450,000	11,228.77	50,529,467	10,522.85	47,352,861	5.375	2027/11/1	0.37
21	アメリカ	社債券	NAVIENT CORP	450,000	11,555.00	51,997,533	10,161.12	45,725,045	5.875	2024/10/25	0.36
22	アメリカ	社債券	SPRINT CORP	375,000	11,754.43	44,079,128	12,161.09	45,604,120	7.875	2023/9/15	0.36
23	アメリカ	社債券	SBA COMMUNICATIONS CORP	425,000	10,754.98	45,708,695	10,696.37	45,459,586	3.875	2027/2/15	0.36
24	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FINANCE CORP	400,000	12,504.57	50,018,295	11,112.89	44,451,585	7.125	2026/3/15	0.35
25	アメリカ	社債券	LEVEL 3 FINANCING INC	400,000	10,969.06	43,876,253	10,907.54	43,630,175	5.375	2024/1/15	0.34
26	アメリカ	社債券	ICAHN ENTERPRISES/FIN	425,000	11,044.93	46,940,971	10,252.16	43,571,685	4.75	2024/9/15	0.34
27	アメリカ	社債券	KRAFT HEINZ FOODS CO	375,000	11,169.04	41,883,924	11,602.84	43,510,683	4.625	2029/1/30	0.34
28	アメリカ	社債券	CAPITOL INV MERGER SUB 2	400,000	11,209.16	44,836,675	10,806.53	43,226,150	10	2024/8/1	0.34
29	アメリカ	社債券	ARD FINANCE SA	400,000	10,917.29	43,669,177	10,674.98	42,699,948	6.5	2027/6/30	0.33
30	アメリカ	社債券	CONTINENTAL RESOURCES	400,000	9,390.21	37,560,858	10,350.25	41,401,035	4.5	2023/4/15	0.32

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー設備・サービス	0.01
		石油・ガス・消耗燃料	0.02
		化学	0.09
		金属・鉱業	0.00
		建設関連製品	0.01
		自動車部品	0.05
		ホテル・レストラン・レジャー	0.05

	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	0.00
	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	0.04
外国証券（優先証券）		0.08
新株予約権証券		0.00
新株予約権付社債券等		0.00
社債券		93.95
合 計		94.41

### 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	5,108,607.54	366,937,231	336,020,491	2.67
------	------	--------------	-------------	-------------	------

## (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

2020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
第26特定期間	(2019年12月 9日)	1,885	1,897	0.7403	0.7453
第27特定期間	(2020年 6月 8日)	1,501	1,507	0.6928	0.6958
	2019年 6月末日	2,320		0.7569	
	7月末日	2,221		0.7513	
	8月末日	2,101		0.7458	
	9月末日	2,064		0.7546	
	10月末日	2,009		0.7486	
	11月末日	1,914		0.7430	
	12月末日	1,848		0.7509	
	2020年 1月末日	1,771		0.7441	
	2月末日	1,649		0.7323	
	3月末日	1,374		0.6269	

4月末日	1,424		0.6454
5月末日	1,482		0.6723
6月末日	1,465		0.6761

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

2020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
第26特定期間	(2019年12月 9日)	8,390	8,417	0.9379	0.9409
第27特定期間	(2020年 6月 8日)	7,651	7,676	0.8955	0.8985
	2019年 6月末日	8,760		0.9216	
	7月末日	8,753		0.9277	
	8月末日	8,537		0.9080	
	9月末日	8,766		0.9362	
	10月末日	8,581		0.9419	
	11月末日	8,475		0.9454	
	12月末日	8,491		0.9607	
	2020年 1月末日	8,347		0.9531	
	2月末日	8,222		0.9435	
	3月末日	6,882		0.8016	
	4月末日	6,975		0.8139	
	5月末日	7,306		0.8538	
	6月末日	7,298		0.8605	

## 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
第26特定期間	2019年 6月11日～2019年12月 9日	0.0300円
第27特定期間	2019年12月10日～2020年 6月 8日	0.0200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
第26特定期間	2019年 6月11日～2019年12月 9日	0.0180円
第27特定期間	2019年12月10日～2020年 6月 8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%
第26特定期間	2019年 6月11日～2019年12月 9日	2.4%
第27特定期間	2019年12月10日～2020年 6月 8日	3.7%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

## 野村米国好利回り社債投信 Dコース

	計算期間	収益率
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%
第26特定期間	2019年 6月11日～2019年12月 9日	3.8%
第27特定期間	2019年12月10日～2020年 6月 8日	2.6%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

## （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
第26特定期間	2019年 6月11日～2019年12月 9日	84,033,144	639,618,012	2,546,477,239
第27特定期間	2019年12月10日～2020年 6月 8日	125,059,665	504,184,027	2,167,352,877

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
第26特定期間	2019年 6月11日～2019年12月 9日	37,759,093	637,282,799	8,946,182,669
第27特定期間	2019年12月10日～2020年 6月 8日	53,828,048	455,837,568	8,544,173,149

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 (2020年6月30日現在)

### ■ 基準価額・純資産の推移 (日次)



### ■ 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

**Cコース**

2020年6月	30 円
2020年5月	30 円
2020年4月	30 円
2020年3月	30 円
2020年2月	30 円
直近1年間累計	500 円
設定来累計	7,868 円

**Dコース**

2020年6月	30 円
2020年5月	30 円
2020年4月	30 円
2020年3月	30 円
2020年2月	30 円
直近1年間累計	360 円
設定来累計	6,044 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	SPRINT CAPITAL CORP	社債券	0.7	0.7
2	BAUSCH HEALTH COS INC	社債券	0.7	0.7
3	KRAFT HEINZ FOODS CO	社債券	0.6	0.6
4	CSC HOLDINGS LLC	社債券	0.6	0.6
5	LTF MERGER SUB INC	社債券	0.6	0.6
6	ALTICE FRANCE HOLDING SA	社債券	0.6	0.6
7	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	社債券	0.5	0.5
8	GLOBAL AIR LEASE CO LTD	社債券	0.5	0.5
9	TRANSDIGM INC	社債券	0.5	0.5
10	VALEANT PHARMACEUTICALS	社債券	0.5	0.5

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	0.4	0.4
外国証券（優先証券）	0.1	0.1
新株予約権証券	0.0	0.0
新株予約権付社債券等	0.0	0.0
社債券	93.0	93.2

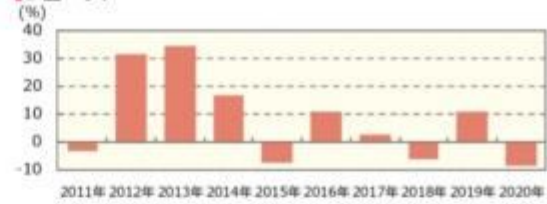
## ■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

### IC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。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

### ID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(2019年12月10日から2020年6月8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 (2019年12月 9日現在)	当期 (2020年 6月 8日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	20,041,463	14,640,494
親投資信託受益証券	1,890,363,960	1,509,786,472
派生商品評価勘定	1,722,123	-
未収入金	30,800,000	30,355,440
流動資産合計	1,942,927,546	1,554,782,406
資産合計		
	1,942,927,546	1,554,782,406
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,391,247	21,057,033
未払金	453,360	23,289,372
未払収益分配金	12,732,386	6,502,058
未払解約金	21,283,319	299,713
未払受託者報酬	90,097	67,708
未払委託者報酬	2,793,049	2,098,885
未払利息	7	21
その他未払費用	3,595	2,700
流動負債合計	57,747,060	53,317,490
負債合計		
	57,747,060	53,317,490
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,546,477,239	2,167,352,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	661,296,753	665,887,961
(分配準備積立金)	56,992,456	47,901,901
元本等合計	1,885,180,486	1,501,464,916
純資産合計		
	1,885,180,486	1,501,464,916
負債純資産合計		
	1,942,927,546	1,554,782,406

## (2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	93,742,048	21,277,488
為替差損益	24,931,377	24,072,490
営業収益合計	68,810,671	45,349,978
<b>営業費用</b>		
支払利息	5,529	3,096
受託者報酬	573,200	439,355
委託者報酬	17,769,039	13,619,919
その他費用	33,669	17,518
営業費用合計	18,381,437	14,079,888
営業利益又は営業損失( )	50,429,234	59,429,866
経常利益又は経常損失( )	50,429,234	59,429,866
当期純利益又は当期純損失( )	50,429,234	59,429,866
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( )	1,845,975	170,829
期首剰余金又は期首欠損金( )	768,659,926	661,296,753
剰余金増加額又は欠損金減少額	162,999,814	135,163,362
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	162,999,814	135,163,362
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,039,867	34,854,492
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,039,867	34,854,492
分配金	83,180,033	45,641,041
期末剰余金又は期末欠損金( )	661,296,753	665,887,961

## (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、2019年12月10日から2020年 6月 8日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

前期 2019年12月 9日現在	当期 2020年 6月 8日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 2,546,477,239口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 2,167,352,877口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額  元本の欠損 661,296,753円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額  元本の欠損 665,887,961円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7403円 (10,000口当たり純資産額) (7,403円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.6928円 (10,000口当たり純資産額) (6,928円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日																																																																																																						
<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>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</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 44,756,384円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2019年 6月11日から2019年 7月 8日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>9,403,767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>1,158,041,253円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>47,728,013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>1,215,173,033円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,963,040,100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>4,101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>14,815,200円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2019年 7月 9日から2019年 8月 8日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>8,572,519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>1,146,360,292円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>50,096,766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>1,205,029,577円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,953,172,404口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	9,403,767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	1,158,041,253円	分配準備積立金額	D	47,728,013円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,215,173,033円	当ファンドの期末残存口数	F	2,963,040,100口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,101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	14,815,200円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,572,519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	1,146,360,292円	分配準備積立金額	D	50,096,766円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,205,029,577円	当ファンドの期末残存口数	F	2,953,172,404口	<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>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</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 39,555,487円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2019年12月10日から2020年 1月 8日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>8,660,868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>921,104,688円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>53,359,610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>983,125,166円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,462,079,121口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>3,993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>12,310,395円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2020年 1月 9日から2020年 2月10日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>6,699,917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>863,992,549円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>53,799,431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>924,491,897円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,327,575,817口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,660,868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	921,104,688円	分配準備積立金額	D	53,359,610円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	983,125,166円	当ファンドの期末残存口数	F	2,462,079,121口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,993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	12,310,395円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	6,699,917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	863,992,549円	分配準備積立金額	D	53,799,431円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	924,491,897円	当ファンドの期末残存口数	F	2,327,575,817口
項目																																																																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	9,403,767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	1,158,041,253円																																																																																																					
分配準備積立金額	D	47,728,013円																																																																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,215,173,033円																																																																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,963,040,100口																																																																																																					
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,101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	14,815,200円																																																																																																					
項目																																																																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	8,572,519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	1,146,360,292円																																																																																																					
分配準備積立金額	D	50,096,766円																																																																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,205,029,577円																																																																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,953,172,404口																																																																																																					
項目																																																																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	8,660,868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	921,104,688円																																																																																																					
分配準備積立金額	D	53,359,610円																																																																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	983,125,166円																																																																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,462,079,121口																																																																																																					
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,993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	12,310,395円																																																																																																					
項目																																																																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	6,699,917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	863,992,549円																																																																																																					
分配準備積立金額	D	53,799,431円																																																																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	924,491,897円																																																																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,327,575,817口																																																																																																					

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,080円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	14,765,862円

2019年 8月 9日から2019年 9月 9日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,881,181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	1,074,777,386円
分配準備積立金額	D	49,784,083円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,134,442,650円
当ファンドの期末残存口数	F	2,790,138,559口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,065円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	13,950,692円

2019年 9月10日から2019年10月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,167,637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	1,040,703,303円
分配準備積立金額	D	52,729,316円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,102,600,256円
当ファンドの期末残存口数	F	2,722,748,929口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,049円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	13,613,744円

2019年10月 9日から2019年11月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,483,140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	1,008,963,263円
分配準備積立金額	D	55,105,517円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,071,551,920円
当ファンドの期末残存口数	F	2,660,429,970口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,027円
10,000口当たり分配金額	H	50円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	13,302,149円

2019年11月 9日から2019年12月 9日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,505,232円

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,971円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	6,982,727円

2020年 2月11日から2020年 3月 9日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,363,894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	823,672,845円
分配準備積立金額	D	50,994,726円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	880,031,465円
当ファンドの期末残存口数	F	2,218,886,328口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,966円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	6,656,658円

2020年 3月10日から2020年 4月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,901,699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	812,096,990円
分配準備積立金額	D	48,966,822円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	866,965,511円
当ファンドの期末残存口数	F	2,187,601,384口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,963円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	6,562,804円

2020年 4月 9日から2020年 5月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,553,869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	820,571,913円
分配準備積立金額	D	48,228,860円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	876,354,642円
当ファンドの期末残存口数	F	2,208,799,789口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,967円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	6,626,399円

2020年 5月 9日から2020年 6月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	6,402,990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	958,356,782円	収益調整金額	C	805,415,980円
分配準備積立金額	D	54,580,178円	分配準備積立金額	D	48,000,969円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,020,442,192円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	859,819,939円
当ファンドの期末残存口数	F	2,546,477,239口	当ファンドの期末残存口数	F	2,167,352,877口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,007円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,967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	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	12,732,386円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	6,502,058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 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8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なっております。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</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 2019年12月 9日現在	当期 2020年 6月 8日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</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 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8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 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日
期首元本額 3,102,062,107円	期首元本額 2,546,477,239円
期中追加設定元本額 84,033,144円	期中追加設定元本額 125,059,665円
期中一部解約元本額 639,618,012円	期中一部解約元本額 504,184,027円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,038,195	145,114,798
合計	3,038,195	145,114,798

## 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(2019年12月 9日現在)				当期(2020年 6月 8日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	1,834,142,829	-	1,852,811,953	18,669,124	1,461,775,997	-	1,482,833,030	21,057,033
米ドル	1,834,142,829	-	1,852,811,953	18,669,124	1,461,775,997	-	1,482,833,030	21,057,033
合計	1,834,142,829	-	1,852,811,953	18,669,124	1,461,775,997	-	1,482,833,030	21,057,033

## (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(2020年6月8日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年6月8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	617,247,127	1,509,786,472	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：100.6%	617,247,127	1,509,786,472 100.0%	
合計				1,509,786,472	

(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 (2019年12月 9日現在)	当期 (2020年 6月 8日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,445,298	73,281,715
親投資信託受益証券	8,315,385,165	7,579,150,107
未収入金	38,700,000	37,600,000
流動資産合計	8,439,530,463	7,690,031,822
資産合計	8,439,530,463	7,690,031,822
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	26,838,548	25,632,519
未払解約金	9,310,025	2,569,480
未払受託者報酬	394,676	335,151
未払委託者報酬	12,234,883	10,389,713
未払利息	31	105
その他未払費用	15,776	13,395
流動負債合計	48,793,939	38,940,363
負債合計	48,793,939	38,940,363
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,946,182,669	8,544,173,149
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	555,446,145	893,081,690
(分配準備積立金)	1,668,237,696	1,631,686,424
元本等合計	8,390,736,524	7,651,091,459
純資産合計	8,390,736,524	7,651,091,459
負債純資産合計	8,439,530,463	7,690,031,822

## (2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日
営業収益		
有価証券売買等損益	400,652,751	150,935,058
営業収益合計	400,652,751	150,935,058
営業費用		
支払利息	21,198	14,489
受託者報酬	2,337,116	2,118,322
委託者報酬	72,450,524	65,668,116
その他費用	93,424	84,670
営業費用合計	74,902,262	67,885,597
営業利益又は営業損失( )	325,750,489	218,820,655
経常利益又は経常損失( )	325,750,489	218,820,655
当期純利益又は当期純損失( )	325,750,489	218,820,655
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( )	3,562,331	271,877
期首剰余金又は期首欠損金( )	755,084,754	555,446,145
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,140,287	42,926,329
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	47,140,287	42,926,329
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,636,066	6,132,530
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,636,066	6,132,530
分配金	167,053,770	155,880,566
期末剰余金又は期末欠損金( )	555,446,145	893,081,690

## (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、2019年12月10日から2020年 6月 8日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

前期 2019年12月 9日現在	当期 2020年 6月 8日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 8,946,182,669口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 8,544,173,149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 555,446,145円	元本の欠損 893,081,690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 (10,000口当たり純資産額)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)
0.9379円 (9,379円)	0.8955円 (8,955円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日																																																																																																																																				
<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>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</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 44,756,384円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2019年 6月11日から2019年 7月 8日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>38,585,670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>311,934,219円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,710,798,324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>2,061,318,213円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>9,478,662,594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>2,174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>28,435,987円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2019年 7月 9日から2019年 8月 8日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>33,812,264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>311,016,388円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,712,438,261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>2,057,266,913円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>9,434,676,586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>2,180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>28,304,029円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2019年 8月 9日から2019年 9月 9日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>43,163,505円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	38,585,670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	311,934,219円	分配準備積立金額	D	1,710,798,324円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,061,318,213円	当ファンドの期末残存口数	F	9,478,662,594口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,174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	28,435,987円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	33,812,264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	311,016,388円	分配準備積立金額	D	1,712,438,261円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,057,266,913円	当ファンドの期末残存口数	F	9,434,676,586口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,180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	28,304,029円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	43,163,505円	<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>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</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 39,555,487円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2019年12月10日から2020年 1月 8日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>38,140,386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>298,267,816円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,644,122,398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>1,980,530,600円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>8,825,545,653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>2,244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>26,476,636円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2020年 1月 9日から2020年 2月10日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>42,283,758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>297,907,409円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,639,232,468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>1,979,423,635円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>8,749,060,622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>2,262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>26,247,181円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2020年 2月11日から2020年 3月 9日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>27,037,278円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	38,140,386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	298,267,816円	分配準備積立金額	D	1,644,122,398円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,980,530,600円	当ファンドの期末残存口数	F	8,825,545,653口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,244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	26,476,636円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	42,283,758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	297,907,409円	分配準備積立金額	D	1,639,232,468円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,979,423,635円	当ファンドの期末残存口数	F	8,749,060,622口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,262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	26,247,181円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	27,037,278円
項目																																																																																																																																					
費用控除後の配当等収益額	A	38,585,670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	311,934,219円																																																																																																																																			
分配準備積立金額	D	1,710,798,324円																																																																																																																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,061,318,213円																																																																																																																																			
当ファンドの期末残存口数	F	9,478,662,594口																																																																																																																																			
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,174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	28,435,987円																																																																																																																																			
項目																																																																																																																																					
費用控除後の配当等収益額	A	33,812,264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	311,016,388円																																																																																																																																			
分配準備積立金額	D	1,712,438,261円																																																																																																																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,057,266,913円																																																																																																																																			
当ファンドの期末残存口数	F	9,434,676,586口																																																																																																																																			
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,180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	28,304,029円																																																																																																																																			
項目																																																																																																																																					
費用控除後の配当等収益額	A	43,163,505円																																																																																																																																			
項目																																																																																																																																					
費用控除後の配当等収益額	A	38,140,386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	298,267,816円																																																																																																																																			
分配準備積立金額	D	1,644,122,398円																																																																																																																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,980,530,600円																																																																																																																																			
当ファンドの期末残存口数	F	8,825,545,653口																																																																																																																																			
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,244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	26,476,636円																																																																																																																																			
項目																																																																																																																																					
費用控除後の配当等収益額	A	42,283,758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	297,907,409円																																																																																																																																			
分配準備積立金額	D	1,639,232,468円																																																																																																																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,979,423,635円																																																																																																																																			
当ファンドの期末残存口数	F	8,749,060,622口																																																																																																																																			
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,262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	26,247,181円																																																																																																																																			
項目																																																																																																																																					
費用控除後の配当等収益額	A	27,037,278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	310,297,960円
分配準備積立金額	D	1,710,037,077円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,063,498,542円
当ファンドの期末残存口数	F	9,394,505,416口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,196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	28,183,516円

2019年 9月10日から2019年10月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,296,504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	308,979,218円
分配準備積立金額	D	1,714,044,662円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,063,320,384円
当ファンドの期末残存口数	F	9,337,749,351口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,209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	28,013,248円

2019年10月 9日から2019年11月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,307,317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	301,401,790円
分配準備積立金額	D	1,680,525,774円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,022,234,881円
当ファンドの期末残存口数	F	9,092,814,301口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,223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	27,278,442円

2019年11月 9日から2019年12月 9日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	32,933,386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	300,684,743円
分配準備積立金額	D	1,662,142,858円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,995,760,987円
当ファンドの期末残存口数	F	8,946,182,669口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,230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	296,545,197円
分配準備積立金額	D	1,644,389,470円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,967,971,945円
当ファンドの期末残存口数	F	8,694,189,877口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,263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	26,082,569円

2020年 3月10日から2020年 4月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	29,376,702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	293,751,229円
分配準備積立金額	D	1,623,275,135円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,946,403,066円
当ファンドの期末残存口数	F	8,582,820,947口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,267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	25,748,462円

2020年 4月 9日から2020年 5月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,164,325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	294,438,095円
分配準備積立金額	D	1,622,116,452円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,952,718,872円
当ファンドの期末残存口数	F	8,564,399,752口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,280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	25,693,199円

2020年 5月 9日から2020年 6月 8日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	32,098,783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	297,278,335円
分配準備積立金額	D	1,625,220,160円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,954,597,278円
当ファンドの期末残存口数	F	8,544,173,149口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,287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	$I=F \times H/10,000$	26,838,548円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	25,632,519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 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8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なっております。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</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 2019年12月 9日現在	当期 2020年 6月 8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 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8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 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8日
期首元本額 9,545,706,375円	期首元本額 8,946,182,669円
期中追加設定元本額 37,759,093円	期中追加設定元本額 53,828,048円
期中一部解約元本額 637,282,799円	期中一部解約元本額 455,837,568円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年 6月11日 至 2019年12月 9日	当期 自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8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	13,364,490	729,098,126
合計	13,364,490	729,098,126

## 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(2020年6月8日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年6月8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	3,098,589,578	7,579,150,107	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:99.1%	3,098,589,578	7,579,150,107 100.0%	
合計				7,579,150,107	

(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)

(2020年 6月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	88,523,798
コール・ローン	130,336,964
株式	49,103,302
新株予約権証券	977,902
社債券	12,459,492,102
貸付債権	373,994,348
派生商品評価勘定	1,800
未収入金	271,335,809
未収利息	187,481,362
前払費用	8,685,334
流動資産合計	13,569,932,721
資産合計	
13,569,932,721	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	149,000
未払金	340,944,816
未払解約金	86,100,000

(2020年 6月 8日現在)

未払利息	187
流動負債合計	427,194,003
負債合計	427,194,003
純資産の部	
元本等	
元本	5,373,119,312
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,769,619,406
元本等合計	13,142,738,718
純資産合計	13,142,738,718
負債純資産合計	13,569,932,721

## 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	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。
------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 6月 8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	2.4460円
(10,000口当たり純資産額)	(24,460円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年12月10日 至 2020年 6月 8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、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

2020年 6月 8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

2020年 6月 8日現在	
期首	2019年12月10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	5,820,464,534円
同期中における追加設定元本額	138,039,873円
同期中における一部解約元本額	585,385,095円
期末元本額	5,373,119,312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	244,446,794円
野村米国好利回り社債投信 Bコース	517,448,597円
野村米国好利回り社債投信 Cコース	617,247,127円
野村米国好利回り社債投信 Dコース	3,098,589,578円
ノムラ・グローバル・オールスターズ	850,840,948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）	44,546,268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(2020年6月8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	MOOD MEDIA CORP COMMON STOCK	35,000	0.65	22,750.00	
		MOOD MEDIA CORP RESTRICTED COMMON STOCK	28,571	0.65	18,571.15	

	NINE POINT ENERGY HOLDINGS COMMON	2,707	1.00	2,707.00	
	RUE21 CLASS A COM	11	14.00	154.00	
	SUNEDISON INC COM	382	17.00	6,494.00	
	VISTRA ENERGY CORP RIGHTS	3,853	0.85	3,275.05	
	WARREN RESOURCES INC	3,649	0.00	0.00	
	HERCULES OFFSHORE ESCROW COM	11,943	0.00	0.00	
	NINE POINT ENERGY HOLDINGS-PFD	46	100.00	4,600.00	
	PARKER DRILLING CO-POST BANK	968	6.80	6,582.40	
	WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	695	2.10	1,459.50	
	JONES ENERGY II INC	2,489	13.95	34,721.55	
	HEXION HOLDINGS CORP -B	15,473	7.75	119,915.75	
	NEENAH ENTERPRISES INC	107,778	0.00	0.00	
	CORNERSTONE BUILDING BRANDS INC	3,022	6.59	19,914.98	
	UC HOLDINGS INC	6,825	10.00	68,250.00	
	GATEWAY CASINOS ENTERTAINMENT LTD	140,813	0.44	62,588.56	
	BLUESTEM GROUP INC	11,344	0.65	7,373.60	
	DIRECTBUY HOLDINGS INC	2,772	0.00	0.00	
	AVAYA HOLDINGS CORP	1	14.06	14.06	
	VISTRA ENERGY CORP	3,313	20.87	69,142.31	
	小計 銘柄数：21			448,513.91	
				(49,103,302)	
	組入時価比率：0.4%			100.0%	
合計				49,103,302	
				(49,103,302)	

(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(2020年6月8日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	米ドル	APPVION CORP WRT US03835B1180	341.00	0.00	
		APPVION CORP WRT US03835B1263	341.00	0.00	
		IHEARTMEDIA INC-CLASS A CW39	755.00	7,455.62	

		IPAYMENT HOLDINGS INC WARRANT 12/29/2022	836,360.00	0.00
		VISTRA ENERGY CORP - CW24	1,823.00	1,476.63
	小計	銘柄数 : 5	839,620.00	8,932.25 (977,902)
		組入時価比率 : 0.0%		0.0%
	合計			977,902 (977,902)
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	125,000.00	128,138.12
		1011778 BC / NEW RED FIN	100,000.00	103,908.00
		1839688 ALBERTA ULC	181,719.00	590.58
		ACRISURE LLC / FIN INC	75,000.00	80,431.12
		ACRISURE LLC / FIN INC	275,000.00	271,731.62
		ACRISURE LLC / FIN INC	75,000.00	80,800.50
		ADAMS HOMES INC	75,000.00	68,953.12
		ADIANT US LLC	75,000.00	83,578.12
		AERCAP IRELAND CAP/GLOBA	150,000.00	154,372.66
		AG ISSUER LLC	125,000.00	122,187.50
		AHERN RENTALS INC	275,000.00	137,872.62
		AIR CANADA	275,000.00	273,934.37
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	50,000.00	51,905.75
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	275,000.00	284,939.87
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	45,000.00	49,069.80
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	100,000.00	102,650.00
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	100,000.00	103,169.00
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	100,000.00	105,375.00
		ALCOA INC	50,000.00	52,497.80
		ALCOA INC	350,000.00	361,190.13
		ALGECO SCOTSMAN GLOB FIN	200,000.00	197,023.00
		ALLEGHENY TECHNOLOGIES	225,000.00	194,484.37
		ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR	150,000.00	133,523.25
		ALLIANCE DATA SYSTEMS CO	125,000.00	116,015.62
		ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	300,000.00	320,485.50
		ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	250,000.00	274,945.00
		ALPHA 2 BV	200,000.00	202,729.00
		ALPHA 3 BV / US BIDCO	200,000.00	202,060.00

ALTICE FINANCING SA	200,000.00	205,940.00	
ALTICE FRANCE HOLDING SA	600,000.00	686,625.00	
ALTICE FRANCE HOLDING SA	200,000.00	201,375.00	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	211,338.00	
ALTOS ESCROW DEBT	1,675,000.00	0.00	
ALTOS ESCROW DEBT	4,010,000.00	0.00	
AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	75,000.00	23,062.50	
AMC ENTERTAINMENT INC	250,000.00	79,375.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP	150,000.00	116,391.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	100,000.00	107,061.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	25,000.00	26,937.37	
AMERIGAS PART/FIN CORP	175,000.00	188,633.37	
ANIXTER INC	200,000.00	207,225.00	
ANIXTER INC	75,000.00	79,023.37	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	100,000.00	81,065.50	
ANTERO RESOURCES FINANCE	125,000.00	94,340.62	
APPVION ESCROW	350,000.00	1,750.00	
ARAMARK SERVICES INC	325,000.00	349,171.87	
ARAMARK SERVICES INC	100,000.00	104,011.50	
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	125,000.00	125,988.12	
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	125,000.00	122,187.50	
ARCONIC CORP	150,000.00	161,124.75	
ARCONIC INC	25,000.00	25,785.21	
ARD FINANCE SA	400,000.00	414,676.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	250,000.00	254,595.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	203,676.00	
ARGOS MERGER SUB INC	275,000.00	275,515.62	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	27,000.00	26,409.37	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	27,000.00	26,540.46	
ASCEND LEARNING LLC	75,000.00	75,648.37	
ASCEND LEARNING LLC	50,000.00	50,432.25	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	171,000.00	155,287.66	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	100,000.00	71,136.00	
ASGN INCORPORATED	100,000.00	96,499.00	
ASHTON WOODS USA/FINANCE	125,000.00	118,580.62	

ASHTON WOODS USA/FINANCE	75,000.00	71,437.50	
ASP AMC MERGER SUB	125,000.00	89,205.62	
ASSUREDPARTNERS INC	200,000.00	201,623.00	
AVANTOR INC	125,000.00	135,794.37	
AVENTINE ENERGY ESCROW	2,850,000.00	0.00	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	50,000.00	46,036.49	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	100,000.00	87,844.32	
AZEK CO LLC/THE	75,000.00	80,765.62	
BAFFINLAND IRON CORP/LP	350,000.00	340,310.25	
BANK OF AMERICA CORP	25,000.00	25,674.93	
BANK OF AMERICA CORP	350,000.00	364,285.00	
BANK OF AMERICA CORP	75,000.00	82,789.32	
BANK OF AMERICA CORP	75,000.00	74,707.16	
BARCLAYS BANK PLC	200,000.00	216,499.12	
BASIC ENERGY SERVICES	50,000.00	21,007.50	
BAUSCH HEALTH AMERICAS	175,000.00	197,280.12	
BAUSCH HEALTH COS INC	8,000.00	8,006.24	
BAUSCH HEALTH COS INC	800,000.00	827,524.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	50,000.00	54,130.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	125,000.00	136,436.25	
BAUSCH HEALTH COS INC	125,000.00	126,002.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	200,000.00	210,375.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	111,418.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	125,000.00	128,747.50	
BCD ACQUISITION INC	175,000.00	172,920.12	
BEACON ESCROW CORP	50,000.00	47,334.75	
BEACON ROOFING SUPPLY IN	50,000.00	49,672.00	
BEAZER HOMES USA	100,000.00	104,135.50	
BEAZER HOMES USA	100,000.00	105,715.50	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	125,000.00	131,901.87	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	50,000.00	53,657.75	
BERRY PLASTICS CORP	50,000.00	50,218.25	
BILL BARRETT CORP	25,000.00	6,787.12	
BMC EAST LLC	125,000.00	127,955.62	
BOMBARDIER INC	125,000.00	111,951.87	



BOMBARDIER INC	225,000.00	182,953.12	
BOMBARDIER INC	225,000.00	176,038.87	
BOMBARDIER INC	250,000.00	186,413.75	
BOYD GAMING CORP	75,000.00	83,749.12	
BOYD GAMING CORP	525,000.00	536,652.37	
BOYD GAMING CORP	100,000.00	101,606.00	
BOYD GAMING CORP	175,000.00	166,597.37	
BRAND ENERGY & INFRASTRU	200,000.00	196,373.00	
BROOKFIELD RESID PROPERT	200,000.00	177,188.00	
BRUIN E&P PARTNERS LLC	350,000.00	12,906.25	
BUFFALO THUNDER DEV 144A	466,533.84	23.32	
BUFFALO THUNDER DEV 144A	1,052,025.00	515,492.25	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	158,000.00	173,718.63	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	50,000.00	51,367.25	
BWAY HOLDING CO	425,000.00	415,698.87	
CALLON PETROLEUM CO	125,000.00	45,234.37	
CALLON PETROLEUM CO	75,000.00	28,017.00	
CALPINE CORP	325,000.00	328,043.62	
CALPINE CORP	225,000.00	234,091.12	
CALPINE CORP	275,000.00	280,406.50	
CAMELOT FINANCE SA	175,000.00	178,909.50	
CAPITOL INV MERGER SUB 2	400,000.00	401,208.00	
CARDTRONICS INC / USA	150,000.00	143,796.75	
CARGO AIRCRAFT MANAGEMEN	75,000.00	76,500.00	
CARLSON TRAVEL INC	200,000.00	100,729.00	
CARRIZO OIL & GAS INC	62,000.00	24,916.87	
CARVANA CO	100,000.00	103,311.50	
CASTLE US HOLDING CORP	250,000.00	233,086.25	
CCM MERGER INC	200,000.00	190,625.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	52,759.75	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	25,000.00	27,292.25	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	350,000.00	371,591.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	375,000.00	394,395.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	450,000.00	473,184.00	
CCO HOLDINGS LLC	450,000.00	474,666.75	

CDK GLOBAL INC	125,000.00	135,765.62	
CDK GLOBAL INC	25,000.00	26,531.00	
CDW LLC/CDW FINANCE	125,000.00	130,500.62	
CEDAR FAIR LP	50,000.00	49,459.50	
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	175,000.00	184,478.87	
CEMEX SAB DE CV	200,000.00	190,690.00	
CENOVUS ENERGY INC	75,000.00	71,922.81	
CENTENE CORP	250,000.00	259,973.75	
CENTENE CORP	125,000.00	132,851.87	
CENTENE CORP	75,000.00	80,176.12	
CENTENE CORP	275,000.00	303,263.12	
CENTENE ESCROW I CORP	325,000.00	345,185.75	
CENTRAL GARDEN & PET CO	125,000.00	128,580.62	
CENTURY COMMUNITIES	200,000.00	209,669.00	
CENTURYLINK INC	100,000.00	104,722.50	
CENTURYLINK INC	25,000.00	27,502.62	
CENTURYLINK INC	225,000.00	232,875.00	
CENTURYLINK INC	75,000.00	75,945.75	
CF INDUSTRIES INC	200,000.00	222,300.00	
CHARLES RIVER LABORATORI	100,000.00	104,790.50	
CHARLES RIVER LABORATORI	75,000.00	75,689.25	
CHENIERE CORP CHRISTI HD	125,000.00	141,159.73	
CHENIERE ENERGY PARTNERS	125,000.00	129,136.25	
CHENIERE ENERGY PARTNERS	125,000.00	127,396.25	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	75,000.00	4,500.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	137,000.00	3,425.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	50,000.00	1,750.00	
CHOBANI LLC/FINANCE CORP	200,000.00	204,183.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	100,000.00	86,864.50	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	50,000.00	53,030.75	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	96,000.00	71,339.04	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	125,000.00	128,187.50	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	150,000.00	156,606.00	
CHURCHILL DOWNS INC	100,000.00	103,881.50	
CHURCHILL DOWNS INC	175,000.00	180,655.12	

CINEMARK USA INC	325,000.00	309,079.87	
CITGO HOLDING INC	225,000.00	228,093.75	
CITGO PETROLEUM CORP	200,000.00	205,000.00	
CITIGROUP INC	225,000.00	200,109.37	
CITIGROUP INC	25,000.00	23,574.75	
CITIGROUP INC	100,000.00	92,978.50	
CITIGROUP INC	100,000.00	108,333.50	
CLARIOS GLOBAL LP	50,000.00	54,321.24	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	85,000.00	86,670.67	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	175,000.00	185,325.00	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	150,000.00	160,515.75	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	125,000.00	130,132.50	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	225,000.00	241,418.25	
CLEAVER-BROOKS INC	75,000.00	63,648.37	
CLEVELAND-CLIFFS INC	50,000.00	50,086.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	150,000.00	123,253.50	
CLEVELAND-CLIFFS INC	25,000.00	15,857.37	
CLIFFS NATURAL RESOURCES	72,000.00	64,575.00	
CLOUD CRANE LLC	175,000.00	175,455.87	
CLOUD PEAK ENRGY	300,000.00	3,300.00	
CLOUD PEAK ENRGY RES	59,000.00	0.00	
COEUR MINING INC	100,000.00	100,364.50	
COMMERCIAL METALS CO	125,000.00	128,268.12	
COMMSCOPE FINANCE LLC	125,000.00	129,856.87	
COMMSCOPE TECH FINANCE L	275,000.00	283,421.87	
COMPASS MINERALS INTERNA	200,000.00	201,729.00	
COMPASS MINERALS INTERNA	100,000.00	109,419.00	
COMPRESSCO PARTNERS/FINA	100,000.00	41,500.00	
CONNECT FINCO SARL/CONNE	200,000.00	199,688.00	
CONSOL ENERGY INC	200,000.00	199,125.00	
CONSOLIDATED ENERGY FIN	150,000.00	128,221.50	
CONTINENTAL RESOURCES	400,000.00	382,008.00	
CONTINENTAL RESOURCES	175,000.00	163,734.37	
CONTINENTAL RESOURCES	125,000.00	98,750.00	
COOKE OMEGA/ALPHA VESSEL	175,000.00	177,365.12	

COOPER-STANDARD AUTOMOTI	150,000.00	97,716.00	
CRC ESCROW ISSUER LLC	125,000.00	116,640.62	
CREDIT ACCEPTANC	75,000.00	72,187.50	
CREDIT ACCEPTANC	150,000.00	148,781.25	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	75,000.00	72,233.62	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	325,000.00	301,650.37	
CRESTWOOD MIDSTREAM PART	125,000.00	124,664.37	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	200,000.00	200,123.00	
CSC HOLDINGS LLC	250,000.00	281,611.25	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	223,219.00	
CSC HOLDINGS LLC	675,000.00	730,478.25	
CSTN MERGER SUB INC	100,000.00	87,614.50	
CUSHMAN & WAKEFIELD US	75,000.00	81,328.12	
DAE FUNDING LLC	25,000.00	25,277.75	
DAE FUNDING LLC	75,000.00	64,921.12	
DANA INC	75,000.00	74,062.50	
DAVITA INC	275,000.00	279,296.87	
DCP MIDSTREAM OPERATING	150,000.00	151,592.24	
DCP MIDSTREAM OPERATING	475,000.00	470,758.25	
DEALER TIRE LLC/DT ISSR	75,000.00	66,281.25	
DELEK LOGISTICS PARTNERS	275,000.00	267,752.37	
DELL INT LLC / EMC CORP	50,000.00	57,526.67	
DELL INT LLC / EMC CORP	75,000.00	87,046.22	
DELL INT LLC / EMC CORP	75,000.00	89,417.35	
DELL INT LLC/EMC CORP	25,000.00	27,074.49	
DELPHI JERSEY HOLDINGS	50,000.00	52,656.25	
DELTA AIR LINES INC	125,000.00	110,096.20	
DELTA AIR LINES INC	150,000.00	161,066.82	
DENBURY RESOURCES INC	75,000.00	10,498.20	
DIAMOND OFFSHORE DRILL	100,000.00	14,429.50	
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON	250,000.00	218,241.25	
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON	250,000.00	179,797.50	
DIEBOLD INC	200,000.00	165,728.99	
DIGICEL GROUP LTD	401,000.00	264,660.00	
DIGICEL LIMITED	200,000.00	95,381.00	

DISH DBS CORP	25,000.00	26,319.37	
DISH DBS CORP	50,000.00	52,495.75	
DISH DBS CORP	250,000.00	262,851.25	
DIVERSIFIED HEALTHCARE T	250,000.00	272,718.75	
DONNELLEY FINANCIAL SOL	75,000.00	74,148.37	
DOWNSTREAM DEVELOPMENT	100,000.00	85,364.50	
EDGEWELL PERSONAL CARE	150,000.00	157,218.75	
EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000.00	207,396.00	
ELDORADA RESORTS INC	275,000.00	288,311.37	
ELDORADO RESORTS INC	75,000.00	76,398.37	
EMBARQ CORP	325,000.00	354,971.50	
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	50,000.00	51,562.50	
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	125,000.00	124,039.37	
ENERGIZER GAMMA ACQ INC	125,000.00	132,945.62	
ENERGIZER HOLDINGS INC	150,000.00	166,097.25	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	325,000.00	266,368.37	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	75,000.00	48,322.12	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	25,000.00	16,294.87	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	25,000.00	15,956.25	
ENPRO INDUSTRIES INC	100,000.00	100,444.00	
ENTEGRIS INC	150,000.00	156,364.50	
ENTERPRISE DEVELOP AUTH	150,000.00	152,046.75	
ENTERPRISE MERGER SUB IN	100,000.00	42,856.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	543,000.00	855.22	
EQT CORP	75,000.00	68,859.37	
EQT CORP	150,000.00	161,625.00	
ESH HOSPITALITY INC	175,000.00	178,955.87	
EVEREST ACQ LLC/FINANCE	287,000.00	477.85	
EVERI PAYMENTS INC	117,000.00	115,378.96	
EW SCRIPPS CO	100,000.00	96,364.50	
EXELA INTERMED/EXELA FIN	125,000.00	27,812.50	
EXTERRAN NRG SOLUTIONS/F	325,000.00	293,684.62	
F-BRASILE SPA/F-BRASILE	200,000.00	152,000.00	
FAIRSTONE FINANCIAL INC	125,000.00	126,315.00	
FELCOR LODGING LP	175,000.00	170,387.87	

FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	50,000.00	15,180.50	
FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	100,000.00	82,364.50	
FINANCIAL & RISK US HOLD	175,000.00	188,967.62	
FIRST QUANTUM MINERALS L	600,000.00	571,563.00	
FIRSTCASH INC	100,000.00	101,635.50	
FLEX ACQUISITION CO INC	75,000.00	76,522.68	
FLEX ACQUISITION CO INC	125,000.00	126,613.12	
FLY LEASING LTD	200,000.00	156,729.00	
FONTAINEBLEAU LAS VEGAS	11,815,760.01	30,720.97	
FORD MOTOR COMPANY	200,000.00	216,375.00	
FORD MOTOR COMPANY	200,000.00	223,083.00	
FORD MOTOR COMPANY	75,000.00	89,953.12	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	203,375.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	198,540.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	192,024.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	600,000.00	587,625.00	
FORESTAR GROUP INC	200,000.00	210,729.00	
FORESTAR GROUP INC	75,000.00	74,800.87	
FORTRESS TRANS & INFRAST	25,000.00	23,180.62	
FORTRESS TRANS & INFRAST	200,000.00	168,728.99	
FOUR FINANCE SA	200,000.00	143,415.06	
FOXTROT ESCROW ISSUER	148,000.00	141,223.82	
FREEPORT-MCMORAN C & G	150,000.00	154,612.50	
FREEPORT-MCMORAN INC	225,000.00	231,211.12	
FREEPORT-MCMORAN INC	25,000.00	26,172.25	
FREEPORT-MCMORAN INC	200,000.00	202,812.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	350,000.00	355,579.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	25,000.00	25,572.62	
FRONT RANGE BIDCO INC	225,000.00	224,824.50	
FRONTIER COMMUNICATIONS	575,000.00	214,052.37	
FRONTIER COMMUNICATIONS	150,000.00	149,222.25	
FRONTIER COMMUNICATIONS	100,000.00	103,044.50	
FTS INTERNATIONAL INC	150,000.00	52,500.00	
GAP INC/THE	75,000.00	83,038.12	
GAP INC/THE	75,000.00	80,765.62	

GAP INC/THE	50,000.00	55,093.75	
GATEWAY CASINOS & ENTERT	200,000.00	180,729.00	
GENESIS ENERGY LP/FIN	75,000.00	72,843.00	
GENWORTH HOLDINGS INC	50,000.00	47,890.75	
GENWORTH HOLDINGS INC	350,000.00	303,843.75	
GEO GROUP INC/THE	100,000.00	82,315.50	
GLOBAL AIR LEASE CO LTD	688,000.00	393,880.00	
GLP CAPITAL LP / FIN II	75,000.00	77,048.62	
GMAC	175,000.00	220,492.26	
GO DADDY OPCO/FINCO	200,000.00	211,213.00	
GOLDEN ENTERTAINMENT INC	150,000.00	138,444.75	
GOLDEN NUGGET INC	625,000.00	513,678.12	
GOLDEN NUGGET INC	450,000.00	316,401.75	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	150,000.00	147,138.63	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	125,000.00	113,300.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	325,000.00	353,234.37	
GRAHAM HOLDINGS CO	125,000.00	128,570.00	
GRANITE HOLDINGS US ACQU	300,000.00	289,255.50	
GRAY ESCROW INC	75,000.00	83,236.12	
GRAY TELEVISION INC	100,000.00	105,481.50	
GRIFFON CORPORATION	200,000.00	203,060.00	
GRINDING MED/MC GRINDING	175,000.00	179,920.12	
GULFPORT ENERGY CORP	25,000.00	15,453.12	
GULFPORT ENERGY CORP	200,000.00	108,039.00	
H&E EQUIPMENT SERVICES	250,000.00	251,901.25	
HARLAND CLARKE HOLDINGS	225,000.00	179,384.62	
HARLAND ESCROW CORP	125,000.00	125,078.12	
HAT HOLDINGS I LLC/HAT	175,000.00	179,721.50	
HCA INC	150,000.00	173,234.25	
HCA INC	150,000.00	170,250.00	
HCA INC	50,000.00	57,255.75	
HCA INC	50,000.00	56,532.75	
HCA INC	250,000.00	291,202.50	
HELLAS II	5,050,000.00	0.00	
HERBALIFE/HLF FINANCING	125,000.00	135,453.12	

HERTZ CORP	100,000.00	33,672.00	
HERTZ CORP	150,000.00	51,253.50	
HESS MIDSTREAM	150,000.00	149,592.00	
HESS MIDSTREAM PARTNERS	175,000.00	174,289.50	
HEXION INC	50,000.00	47,001.50	
HILLMAN GROUP INC	370,000.00	334,474.45	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	75,000.00	79,903.12	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	325,000.00	331,155.50	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	75,000.00	79,265.62	
HOLLY NRG PRTNR/FIN CORP	100,000.00	98,734.50	
HOSPITALITY PROP TRUST	150,000.00	141,289.09	
HOWMET AEROSPACE INC	100,000.00	111,017.32	
HUB INTERNATIONAL LTD	225,000.00	240,109.87	
HUDBAY MINERALS INC	75,000.00	74,523.37	
HUDBAY MINERALS INC	150,000.00	149,640.75	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	250,000.00	273,390.00	
HUNT COS INC	175,000.00	158,883.37	
HUSKY III HOLDING LTD	100,000.00	96,312.50	
IAMGOLD CORP	200,000.00	207,981.00	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	425,000.00	417,696.37	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	100,000.00	103,761.50	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	450,000.00	465,115.50	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	52,867.00	57,220.06	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	175,000.00	177,112.25	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	125,000.00	124,551.25	
ILFC E-CAPITAL TRUST I	470,000.00	228,770.15	
INCEPTION MRGR/RACKSPACE	150,000.00	157,263.75	
INDIGO NATURAL RES LLC	250,000.00	243,601.25	
INEOS GROUP HOLDINGS SA	200,000.00	204,581.00	
INN OF THE MOUNTAIN GODS	96,416.00	77,614.88	
INSTALLED BUILDING PRODU	75,000.00	76,397.25	
INTELSAT JACKSON HLDG	225,000.00	129,913.87	
INTELSAT JACKSON HLDG	300,000.00	182,218.50	
INTELSAT LUXEMBOURG SA	225,000.00	11,812.50	
IRB HOLDING CORP	75,000.00	80,518.12	



IRB HOLDING CORP	125,000.00	125,445.00	
IRIS MERGER SUB 2019 INC	300,000.00	300,562.49	
IRON MOUNTAIN INC	25,000.00	25,140.37	
IRON MOUNTAIN INC	175,000.00	177,149.00	
JACOBS ENTERTAINMENT INC	325,000.00	258,834.87	
JAGGED PEAK ENERGY LLC	125,000.00	124,120.62	
JAGUAR HL / PPDI	50,000.00	51,593.75	
JAGUAR HL / PPDI	75,000.00	78,000.37	
JBS USA LLC/JBS USA FINA	50,000.00	51,343.25	
JBS USA LLC/JBS USA FINA	50,000.00	51,500.00	
JBS USA/FOOD/FINANCE	175,000.00	194,530.00	
JBS USA/FOOD/FINANCE	175,000.00	187,545.75	
JC PENNEY CORP INC	125,000.00	4,375.00	
JC PENNEY CORPORATION IN	100,000.00	2,020.00	
JEFFERIES FIN LLC / JFIN	200,000.00	183,500.00	
JELD-WEN INC	75,000.00	79,875.00	
JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	92,079.00	
JPMORGAN CHASE & CO	275,000.00	299,680.23	
JPMORGAN CHASE & CO	125,000.00	128,384.02	
JPMORGAN CHASE & CO	150,000.00	154,931.35	
JPMORGAN CHASE & CO	75,000.00	67,721.84	
K HOVNIANIAN ENTERPRISES	79,000.00	38,710.00	
K HOVNIANIAN ENTERPRISES	79,000.00	13,430.00	
KAISER ALUMINUM CORP	125,000.00	130,390.62	
KAISER ALUMINUM CORP	175,000.00	170,920.75	
KB HOME	25,000.00	27,653.62	
KB HOME	75,000.00	84,267.00	
KEHE DISTRIBUTORS LLC/FI	75,000.00	79,511.62	
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	150,000.00	153,765.75	
KRAFT HEINZ FOODS CO	575,000.00	630,984.76	
KRAFT HEINZ FOODS CO	50,000.00	52,300.46	
KRAFT HEINZ FOODS CO	75,000.00	80,963.82	
KRAFT HEINZ FOODS CO	125,000.00	122,577.18	
KRAFT HEINZ FOODS CO	75,000.00	89,329.42	
KRAFT HEINZ FOODS CO	750,000.00	749,079.15	

KRAFT HEINZ FOODS CO	275,000.00	285,842.64	
KRATON POLYMERS LLC/CAP	125,000.00	130,126.25	
L BRANDS INC	50,000.00	50,000.00	
L BRANDS INC	25,000.00	25,000.00	
L BRANDS INC	50,000.00	46,834.50	
L BRANDS INC	225,000.00	198,450.00	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	225,000.00	215,575.87	
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	75,000.00	64,125.00	
LAMAR MEDIA CORP	50,000.00	52,999.75	
LAREDO PETROLEUM INC	250,000.00	195,235.00	
LENNAR CORP	50,000.00	55,178.00	
LEVEL 3 FINANCING INC	21,000.00	21,101.01	
LEVEL 3 FINANCING INC	400,000.00	407,958.00	
LEVI STRAUSS & CO	50,000.00	51,307.25	
LHMC FINCO SARL	200,000.00	186,867.80	
LIFEPOINT HEALTH INC	75,000.00	73,875.00	
LITHIA MOTORS INC	100,000.00	100,364.50	
LITHIA MOTORS INC	50,000.00	49,250.00	
LIVE NATION ENTERTAINMEN	75,000.00	75,267.00	
LTF MERGER SUB INC	800,000.00	680,916.00	
LUCENT TECHNOLOGIES	75,000.00	77,625.00	
MALLINCKRODT FIN/SB	150,000.00	29,250.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL	200,000.00	224,022.80	
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	75,000.00	81,133.12	
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	25,000.00	26,175.50	
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	225,000.00	208,926.00	
MASONITE INTERNATIONAL C	50,000.00	51,865.50	
MASONITE INTERNATIONAL C	75,000.00	77,001.75	
MATADOR RESOURCES CO	225,000.00	179,290.12	
MATCH GROUP INC	50,000.00	52,696.50	
MATCH GROUP INC	25,000.00	26,202.87	
MATCH GROUP INC	25,000.00	26,839.00	
MATTAMY GROUP CORP	125,000.00	125,753.75	
MATTEL INC	75,000.00	79,697.62	
MATTEL INC	50,000.00	52,334.50	

MATTEL INC	25,000.00	21,857.37	
MATTHEWS INTERNATIONAL C	125,000.00	115,768.12	
MEG ENERGY CORP	105,000.00	103,151.47	
MEG ENERGY CORP	200,000.00	194,998.00	
MELCO RESORTS FINANCE	200,000.00	205,227.24	
MERCER INTL INC	85,000.00	83,609.82	
MERISANT ESCROW	4,750,000.00	0.00	
MERITAGE HOMES CORP	300,000.00	323,593.50	
MERITOR INC	25,000.00	25,593.75	
MGIC INVESTMENT CORP	150,000.00	159,546.75	
MGM GROWTH/MGM FINANCE	125,000.00	128,750.00	
MGM RESORTS INTL	300,000.00	321,526.50	
MGM RESORTS INTL	164,000.00	166,409.98	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	150,000.00	153,625.80	
MIDAS INT HOLDCO II/FIN	200,000.00	170,703.00	
MIDWEST VANADIUM PTY LTD	186,458.05	279.68	
MIRABELA NICKEL LTD SUBO	5,379.74	0.00	
MOHEGAN TRIBAL GAMING AU	250,000.00	195,963.75	
MOOD MEDIA BORROWER LLC	126,626.00	82,306.90	
MOUNTAIN PROVINCE DIAMON	75,000.00	38,601.75	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	175,000.00	172,045.12	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	160,000.00	163,050.40	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	175,000.00	183,491.00	
MTS SYSTEMS CORP	225,000.00	207,238.50	
MURPHY OIL CORP	225,000.00	224,644.50	
MURPHY OIL USA INC	50,000.00	51,615.75	
NABORS INDUSTRIES LTD	400,000.00	257,000.00	
NABORS INDUSTRIES LTD	75,000.00	46,265.62	
NATHAN'S FAMOUS INC	75,000.00	75,937.50	
NATIONSTAR MTG	75,000.00	77,445.37	
NATIONSTAR MTG	50,000.00	55,078.25	
NATIONSTAR MTG HLD INC	50,000.00	49,914.00	
NAVIENT CORP	50,000.00	50,072.00	
NAVIENT CORP	75,000.00	77,295.75	
NAVIENT CORP	200,000.00	207,423.00	

NAVIENT CORP	450,000.00	444,372.75	
NAVIENT CORP	150,000.00	150,963.75	
NAVIENT CORP	150,000.00	149,820.75	
NAVIENT CORP	25,000.00	22,937.50	
NAVISTAR INTL CORP	50,000.00	55,718.75	
NCL CORPORATION LTD	50,000.00	57,718.75	
NCR CORP	175,000.00	178,024.00	
NCR CORP	175,000.00	185,410.75	
NETFLIX INC	150,000.00	176,597.25	
NETFLIX INC	50,000.00	59,584.50	
NETFLIX INC	100,000.00	113,731.00	
NETFLIX INC	350,000.00	387,341.50	
NEW ENTERPRISE STONE & L	275,000.00	278,029.12	
NEW ENTERPRISE STONE & L	100,000.00	97,363.00	
NEWELL BRANDS INC	50,000.00	52,963.75	
NEWELL RUBBERMAID INC	300,000.00	321,006.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	150,000.00	158,250.00	
NEXSTAR ESCROW INC	125,000.00	134,273.75	
NEXTERA ENERGY OPERATING	150,000.00	159,532.50	
NEXTERA ENERGY OPERATING	125,000.00	134,305.62	
NEXTERA ENERGY OPERATING	225,000.00	236,284.87	
NFP CORP	250,000.00	244,528.75	
NFP CORP	100,000.00	98,802.00	
NINE ENERGY SERVICE INC	50,000.00	23,078.25	
NMG FINCO PLC	200,000.00	130,000.00	
NOBLE HOLDING INTL LTD	25,000.00	794.87	
NOBLE HOLDING INTL LTD	75,000.00	2,759.62	
NORTHWEST ACQ/DOMINION	100,000.00	1,150.00	
NOVA CHEMICALS CORP	125,000.00	119,710.62	
NOVELIS CORP	250,000.00	268,801.25	
NOVELIS CORP	275,000.00	279,598.00	
NRG ENERGY INC	50,000.00	53,990.75	
NRG ENERGY INC	150,000.00	161,222.25	
NRG ENERGY INC	175,000.00	197,668.62	
NUSTAR LOGISTICS LP	50,000.00	48,835.75	

NWH ESCROW CORP	125,000.00	45,625.00	
OASIS PETROLEUM INC	75,000.00	15,424.12	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	100,000.00	98,500.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	24,616.87	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	275,000.00	265,375.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	50,000.00	48,375.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	150,000.00	143,556.74	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	24,109.37	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	175,000.00	147,546.86	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	100,000.00	89,562.49	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	75,000.00	57,140.61	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	225,000.00	201,234.37	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	21,609.37	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	75,000.00	58,359.37	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	16,859.37	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	17,000.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	25,000.00	15,852.50	
OCI NV	200,000.00	205,000.00	
OI EUROPEAN GROUP BV	100,000.00	102,114.50	
OLIN CORP	225,000.00	260,859.37	
OLIN CORP	75,000.00	69,623.25	
OLIN CORP	150,000.00	137,597.24	
OPEN TEXT CORP	125,000.00	131,539.37	
OPEN TEXT CORP	125,000.00	125,527.50	
OPEN TEXT HOLDINGS INC	125,000.00	127,480.62	
ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTI	92,000.00	92,006.90	
ORTHO-CLINICAL INC/SA	100,000.00	104,937.50	
ORTHO-CLINICAL INC/SA	125,000.00	131,537.50	
OWENS-BROCKWAY	125,000.00	133,828.12	
OWENS-BROCKWAY	75,000.00	81,478.12	
OXFORD FIN LLC/CO-ISS II	125,000.00	121,376.87	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	125,000.00	147,789.37	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	175,000.00	205,318.75	
PACIFIC GAS & ELECTRIC	75,000.00	86,572.12	
PANTHER BF AGGREGATOR 2	50,000.00	52,717.25	

PAR PHARMACEUTICAL INC	25,000.00	26,578.87	
PARK AEROSPACE HOLDINGS	125,000.00	115,147.42	
PARK INTERMED HOLDINGS	175,000.00	184,953.12	
PARK-OHIO INDUSTRIES INC	225,000.00	194,386.50	
PARKLAND FUEL CORP	50,000.00	51,377.25	
PARKLAND FUEL CORP	100,000.00	103,156.50	
PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	100,000.00	96,000.00	
PATRICK INDUSTRIES INC	175,000.00	181,201.12	
PATTERN ENERGY GROUP INC	100,000.00	101,864.50	
PBF HOLDING CO LLC	25,000.00	28,421.37	
PBF HOLDING CO LLC	125,000.00	113,975.00	
PBF LOGISTICS LP/FINANCE	245,000.00	239,338.05	
PDC ENERGY INC	25,000.00	23,653.62	
PDC ENERGY INC	200,000.00	185,631.00	
PENSKE AUTO GROUP INC	275,000.00	278,606.62	
PETRA DIAMONDS US TREAS	200,000.00	79,000.00	
PETROBAKKEN ENERGY LTD	450,000.00	0.00	
PGT ESCROW ISSUER INC	125,000.00	132,320.00	
PICASSO FINANCE SUB INC	75,000.00	77,437.50	
PILGRIM'S PRIDE CORP	100,000.00	100,749.50	
PILGRIM'S PRIDE CORP	75,000.00	76,513.87	
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	51,009.25	
PLASTIPAK HOLDINGS INC	200,000.00	194,625.00	
POLARIS INTERMEDIATE	225,000.00	214,230.37	
POLYONE CORP	100,000.00	106,587.50	
POST HOLDINGS INC	50,000.00	51,997.25	
POST HOLDINGS INC	125,000.00	133,793.12	
POST HOLDINGS INC	100,000.00	100,988.00	
PRECISION DRILLING CORP	75,000.00	41,517.00	
PRESIDIO HOLDING INC	75,000.00	75,129.00	
PRESIDIO HOLDING INC	100,000.00	100,812.50	
PRESTIGE BRANDS INC	50,000.00	51,240.00	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	75,000.00	78,947.62	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	75,000.00	75,187.50	
PTC INC	75,000.00	76,125.00	

PTC INC	50,000.00	50,937.50	
QORVO INC	100,000.00	107,197.00	
QORVO INC	175,000.00	181,863.50	
RADIAN GROUP INC	175,000.00	176,075.37	
RADIAN GROUP INC	25,000.00	26,609.37	
RADIAN GROUP INC	50,000.00	49,277.25	
REVLON ESCROW CORP	50,000.00	8,307.25	
ROCKIES EXPRESS PIPELINE	175,000.00	167,015.62	
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	200,000.00	198,694.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	200,000.00	203,750.00	
RP CROWN PARENT LLC	175,000.00	174,762.87	
RRI ENERGY ESCROW	50,000.00	0.00	
SANCHEZ ENERGY CORP	342,000.00	1,516.77	
SANCHEZ ENERGY CORP	325,000.00	1,625.00	
SANJEL CORP	200,000.00	0.00	
SANJEL CORP	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	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SANJEL CORP ZCPN	7,500.00	0.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	425,000.00	440,406.25	
SCHWEITZER-MAUDUIT INTL	100,000.00	100,926.00	
SCIENCE APPLICATIONS INT	75,000.00	76,816.50	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	125,000.00	119,898.75	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	75,000.00	71,103.75	
SCOTTS MIRACLE-GRO CO	125,000.00	128,824.37	
SCRIPPS ESCROW INC	50,000.00	49,959.50	
SEALED AIR CORP	150,000.00	153,733.50	
SELECT MEDICAL CORP	150,000.00	160,624.50	
SERVICE PROPERTIES TRUST	100,000.00	107,100.63	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,000.00	23,356.38	
SEVEN GENERATIONS ENERGY	200,000.00	186,623.00	

SEVENTY SEVEN ESCROW	175,000.00	0.00
SHEA HOMES LP/FNDG CP	75,000.00	72,129.37
SHELF DRILL HOLD LTD	175,000.00	81,704.87
SINCLAIR TELEVISION GROU	75,000.00	75,483.00
SINCLAIR TELEVISION GROU	175,000.00	167,748.00
SINCLAIR TELEVISION GROU	75,000.00	73,626.75
SIRIUS XM RADIO INC	125,000.00	130,221.25
SIRIUS XM RADIO INC	100,000.00	106,731.50
SIRIUS XM RADIO INC	200,000.00	216,838.00
SLM CORP	400,000.00	402,246.00
SM ENERGY CO	150,000.00	78,810.75
SOLERA LLC / SOLERA FINA	200,000.00	211,021.00
SONIC AUTOMOTIVE INC	175,000.00	175,623.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	63,000.00	59,322.69
SPECTRUM BRANDS INC	50,000.00	50,197.00
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	300,000.00	320,392.50
SPRINGLEAF FINANCE CORP	175,000.00	187,887.87
SPRINGLEAF FINANCE CORP	25,000.00	27,109.12
SPRINGLEAF FINANCE CORP	75,000.00	82,734.37
SPRINGLEAF FINANCE CORP	400,000.00	417,438.00
SPRINGLEAF FINANCE CORP	325,000.00	331,168.50
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	48,084.50
SPRINT CAPITAL CORP	600,000.00	884,889.00
SPRINT COMMUNICATIONS	175,000.00	195,740.12
SPRINT COMMUNICATIONS	25,000.00	27,006.87
SPRINT CORP	475,000.00	551,049.87
SPRINT CORP	75,000.00	92,197.87
SPX FLOW INC	100,000.00	101,364.50
SPX FLOW INC	100,000.00	101,356.00
SS&C TECHNOLOGIES INC	350,000.00	376,055.71
STANDARD INDUSTRIES INC	11,000.00	11,144.26
STANDARD INDUSTRIES INC	75,000.00	79,552.87
STANDARD INDUSTRIES INC	50,000.00	53,393.25
STAPLES INC	75,000.00	68,074.50
STAPLES INC	375,000.00	286,475.62



STAR MERGER SUB INC	75,000.00	81,128.62	
STAR MERGER SUB INC	275,000.00	312,761.62	
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	300,000.00	303,565.50	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	50,000.00	49,682.25	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	50,000.00	51,178.00	
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	225,000.00	113,994.00	
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	75,000.00	33,648.37	
SUMMIT MIDSTREAM PARTNER	100,000.00	9,544.73	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	225,000.00	227,131.87	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	25,000.00	25,589.00	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	175,000.00	182,801.50	
T-MOBILE USA INC	75,000.00	75,757.87	
T-MOBILE USA INC	150,000.00	155,070.75	
T-MOBILE USA INC	125,000.00	128,670.62	
T-MOBILE USA INC	50,000.00	51,815.25	
T-MOBILE USA INC	225,000.00	245,005.87	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	75,000.00	60,532.12	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	150,000.00	159,537.00	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	75,000.00	76,082.62	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	25,000.00	26,124.37	
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	75,000.00	73,687.87	
TARGA RESOURCES PARTNERS	175,000.00	173,268.37	
TARGA RESOURCES PARTNERS	75,000.00	75,608.62	
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	53,500.00	
TARGA RESOURCES PARTNERS	225,000.00	225,091.12	
TARGA RESOURCES PARTNERS	100,000.00	103,342.00	
TASEKO MINES LTD	75,000.00	54,263.62	
TAYLOR MORRISON	200,000.00	205,188.00	
TAYLOR MORRISON	75,000.00	76,851.75	
TAYLOR MORRISON COMM	100,000.00	104,568.00	
TECK RESOURCES LIMITED	75,000.00	75,449.51	
TECK RESOURCES LIMITED	50,000.00	48,908.90	
TEGNA INC	275,000.00	274,015.50	
TELECOM ITALIA CAPITAL	250,000.00	274,476.25	
TELECOM ITALIA CAPITAL	25,000.00	29,592.75	

TELESAT CANADA/TELESAT L	75,000.00	75,609.37	
TELESAT CANADA/TELESAT L	175,000.00	176,016.75	
TEMPO ACQUISITION LLC/FI	275,000.00	285,481.62	
TENET HEALTHCARE CORP	200,000.00	212,321.00	
TENET HEALTHCARE CORP	500,000.00	508,702.50	
TENET HEALTHCARE CORP	75,000.00	76,929.75	
TENET HEALTHCARE CORP	275,000.00	283,921.00	
TENET HEALTHCARE CORP	25,000.00	26,434.12	
TENET HEALTHCARE CORP	275,000.00	283,508.50	
TENET HEALTHCARE CORP	75,000.00	75,609.37	
TENNANT CO	100,000.00	101,614.50	
TENNECO INC	225,000.00	159,130.12	
TENNECO INC	25,000.00	17,828.87	
TERRAFORM POWER OPERATIN	75,000.00	78,046.12	
TERRAFORM POWER OPERATIN	125,000.00	131,538.75	
TESLA INC	475,000.00	484,932.25	
TEXAS COMPETITIVE ESCROW	225,000.00	618.75	
TITAN INTERNATIONAL INC	125,000.00	68,580.62	
TMS INTERNATIONAL CORP	100,000.00	75,364.50	
TOPBUILD ESCROW CORP	275,000.00	287,666.50	
TOPS HOLDING II ESCROW	307,000.00	0.00	
TOWNSQUARE MEDIA INC	250,000.00	205,911.25	
TPC GROUP INC	300,000.00	281,844.00	
TRANSDIGM INC	200,000.00	211,444.00	
TRANSDIGM INC	175,000.00	175,841.75	
TRANSDIGM INC	200,000.00	210,338.00	
TRANSDIGM INC	650,000.00	617,786.00	
TRANSDIGM UK HOLDINGS	200,000.00	199,712.00	
TRANSMONTAIGE PARTNERS	100,000.00	98,144.00	
TRANSOCEAN GUARDIAN LTD	20,875.00	20,040.00	
TRANSOCEAN INC	100,000.00	60,000.00	
TRANSOCEAN INC	25,000.00	15,875.00	
TRANSOCEAN INC	125,000.00	80,546.87	
TRANSOCEAN PONTUS LTD	62,625.00	62,325.65	
TRANSOCEAN POSEIDON	50,000.00	48,000.00	

TRANSOCEAN SENTRY LTD	75,000.00	72,561.00	
TRI POINTE GROUP INC	75,000.00	77,062.50	
TRI POINTE HOLDINGS INC	250,000.00	258,411.25	
TRIANGLE USA PETROLEUM	125,000.00	0.00	
TRIDENT MERGER SUB INC	75,000.00	68,523.37	
TRIDENT TPI HOLDINGS INC	225,000.00	231,585.75	
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	150,000.00	147,000.75	
TRIUMPH GROUP INC	50,000.00	45,349.00	
TRIUMPH GROUP INC	100,000.00	78,864.50	
TRONOX FINANCE PLC	200,000.00	192,729.00	
TWIN RIVER WORLDWIDE HLD	50,000.00	48,934.50	
UBER TECHNOLOGIES INC	75,000.00	78,233.62	
UBER TECHNOLOGIES INC	175,000.00	182,213.50	
UNITED AIRLINES HOLDINGS	25,000.00	20,828.12	
UNITED AIRLINES HOLDINGS	125,000.00	100,377.50	
UNITED CONTINENTAL HLDGS	50,000.00	44,078.25	
UNITED RENTALS NORTH AM	75,000.00	79,729.12	
UNITED RENTALS NORTH AM	25,000.00	27,420.37	
UNITED RENTALS NORTH AM	50,000.00	51,353.00	
UNITED RENTALS NORTH AM	100,000.00	100,219.00	
UNITED STATES STEEL CORP	100,000.00	73,919.50	
UNITI GROUP/CSL CAPITAL	125,000.00	120,076.87	
UNITI GRP/UNITI HLD/CSL	175,000.00	187,330.50	
UNIVAR SOLUTIONS USA INC	100,000.00	103,169.00	
UNIVISION COMMUNICATIONS	175,000.00	172,046.87	
UNIVISION COMMUNICATIONS	75,000.00	83,250.00	
UNIVISION COMMUNICATIONS	150,000.00	150,000.00	
UPC HOLDING BV	200,000.00	196,838.00	
USA COM PART/USA COM FIN	175,000.00	177,815.75	
USA COM PART/USA COM FIN	125,000.00	124,572.50	
USI INC	100,000.00	102,811.50	
VALEANT PHARMACEUTICALS	525,000.00	585,703.12	
VECTOR GROUP LTD	50,000.00	50,343.25	
VECTOR GROUP LTD	175,000.00	178,905.12	
VERITAS US INC/BERMUDA L	200,000.00	181,771.00	

VERSCEND HOLDING CORP	150,000.00	166,035.75	
VICI PROPERTIES / NOTE	50,000.00	49,507.25	
VICI PROPERTIES / NOTE	75,000.00	76,019.62	
VICI PROPERTIES / NOTE	50,000.00	49,075.50	
VICI PROPERTIES / NOTE	50,000.00	51,147.00	
VICI PROPERTIES / NOTE	50,000.00	50,426.00	
VIKING CRUISES LTD	100,000.00	69,364.50	
VIKING CRUISES LTD	175,000.00	204,255.62	
VIKING CRUISES LTD	250,000.00	191,828.74	
VINE OIL & GAS LP / FIN	225,000.00	153,832.50	
VIPER ENERGY PARTNERS LP	450,000.00	448,560.00	
VIRGIN AUSTRALIA HOLDING	50,000.00	10,437.50	
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000.00	209,081.00	
VISTAJET MALTA/XO MGMT	125,000.00	99,700.62	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	375,000.00	400,477.50	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	100,000.00	104,295.87	
VODAFONE GROUP PLC	330,000.00	391,100.19	
WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	250,000.00	247,213.75	
WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	175,000.00	173,887.87	
WERNER FINCO LP/INC	300,000.00	256,093.50	
WESCO DISTRIBUTION INC	175,000.00	187,635.00	
WESCO DISTRIBUTION INC	150,000.00	161,062.50	
WEST STREET MERGER SUB	125,000.00	127,264.37	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	175,000.00	170,953.12	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	100,000.00	95,562.50	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	50,000.00	41,000.00	
WHITING PETROLEUM CORP	75,000.00	12,986.62	
WILLIAMS SCOTSMAN INTL	175,000.00	180,487.12	
WMG ACQUISITION CORP	75,000.00	76,023.37	
WMG ACQUISITION CORP	100,000.00	104,116.00	
WPX ENERGY INC	200,000.00	201,581.00	
WPX ENERGY INC	75,000.00	73,814.25	
WPX ENERGY INC	100,000.00	101,187.50	
WPX ENERGY INC	50,000.00	46,797.00	
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	200,000.00	194,339.00	

	WYNN MACAU LTD	200,000.00	206,521.00	
	WYNN RESORTS FINANCE LLC	75,000.00	73,629.00	
	XPLORNET COMMUNICATIONS	123,038.00	126,392.63	
	XPO LOGISTICS INC	81,000.00	81,382.72	
	XPO LOGISTICS INC	85,000.00	87,346.42	
	XPO LOGISTICS INC	175,000.00	190,693.12	
	ZIGGO BOND CO BV	350,000.00	373,840.25	
	CITIGROUP INC 6.8750% Series K	206,725.00	225,320.32	
小計	銘柄数：806	154,387,047.64	113,806,102.51	
			(12,459,492,102)	
	組入時価比率：94.8%		100.0%	
合計			12,459,492,102	
			(12,459,492,102)	
合計			12,460,470,004	
			(12,460,470,004)	

(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	2020年 6月 8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	74,292,400	-	74,439,600	147,200
米ドル	74,292,400	-	74,439,600	147,200
合計	74,292,400	-	74,439,600	147,200

(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(2020年6月8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							
ASURION REPLACE B6 TRM	94,366.59	100.18	94,536.44	97.73	92,219.75	2,316.69	
ASURION(LONESTAR) B4 IRL	202,529.99	100.33	203,198.33	98.41	199,302.06	3,896.27	
BIG RIVER STEEL TL	48,627.79	98.87	48,078.29	91.00	44,251.28	3,827.01	
BOSTON GENERATING TRM 2L	1,357,664.13	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
BURGER KING CORP TL B4#1	111,704.98	100.00	111,704.98	96.65	107,962.86	3,742.12	
CALIFORNIA RESOURCES TRM	50,000.00	57.78	28,892.85	4.63	2,312.50	26,580.35	
CENGAGE LERNNG ACQS B TL	124,033.52	92.66	114,929.45	82.92	102,844.50	12,084.95	
CLEAR CHANNEL OUTD B#1	74,437.50	100.42	74,750.14	96.17	71,584.08	3,166.06	
CLEAR CHANNEL OUTD B#2	187.50	100.41	188.28	96.17	180.31	7.97	
CONSOLIDATED INITIAL TRM	171,937.50	96.00	165,060.00	85.50	147,006.56	18,053.44	
DIAMOND SPORTS B TRM	74,625.00	99.62	74,341.42	87.50	65,296.87	9,044.55	
GATEWAY CASINOS INI TRM	147,375.00	98.79	145,591.76	77.50	114,215.62	31,376.14	
GLOBAL AVIATION 2ND LIEN	276,371.44	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
HARD ROCK NORTHIN DD TRM	11,824.32	96.99	11,469.59	95.00	11,233.10	236.49	
LIFE TIME FITNESS #1 B	384,924.40	100.21	385,766.61	91.38	351,724.67	34,041.94	
LIFE TIME FITNESS #12 B	992.07	100.21	994.24	91.38	906.50	87.74	
LIFE TIME FITNESS #13 B	992.07	100.21	994.24	91.38	906.50	87.74	
LIFEPOINT TRM B	125,000.00	100.25	125,312.50	96.96	121,197.87	4,114.63	
MAUSER PACKAGING TL	241,400.47	97.92	236,391.43	92.75	223,898.93	12,492.50	
MAUSER PACKAGING TL 12	622.17	97.92	609.25	92.75	577.06	32.19	
MRO HOLDINGS INI TL02	20,358.63	98.75	20,104.14	67.50	13,742.07	6,362.07	
MRO HOLDINGS INI TL03	10,001.16	98.75	9,876.14	67.50	6,750.78	3,125.36	
MRO HOLDINGS INITIAL TRM	68,890.21	98.75	68,029.08	67.50	46,500.89	21,528.19	
NAVISTAR B TRM	195,258.47	96.55	188,536.29	97.25	189,888.86	1,352.57	
NUMERICABLE \$ TLB13 IRL	219,375.00	99.45	218,168.43	97.19	213,205.07	4,963.36	
PANTHER BF AGGRE 2ND TLB	248,750.00	100.43	249,819.62	98.08	243,982.20	5,837.42	
PARKER DRILLING 2ND	17,518.67	99.01	17,345.25	97.00	16,993.10	352.15	
PRAIRIE ECI ACQUIOR TRM	71,131.49	95.91	68,222.21	91.96	65,411.30	2,810.91	
PRISO ACQUISI TL B	151,436.78	97.00	146,893.68	93.63	141,782.68	5,111.00	
RHP HOTEL PROP B TRM NEW	76,416.64	100.37	76,699.38	93.41	71,377.87	5,321.51	
SINCLAIR TELEVI TRM B-2b	74,625.00	100.15	74,736.93	97.25	72,572.81	2,164.12	
SPECTACLE GARY HLDNGS TL	163,175.68	96.78	157,925.68	95.00	155,016.89	2,908.79	
STAPLES 2019 RFNIG B1 TL	148,500.00	99.31	147,475.35	92.17	136,867.54	10,607.81	
UNITED SITE INI TRM 1L	97,500.00	99.83	97,334.25	93.63	91,284.37	6,049.88	
ZAYO INITIAL DOLLAR TL	300,000.00	99.75	299,250.00	97.70	293,100.00	6,150.00	
小計			3,663,226.23		3,416,097.45	247,128.78	
銘柄数 : 35			(401,050,007)		(373,994,348)	( 27,055,659)	

組入時価比率：2.8%					100.0%		
貸付債権計		401,050,007		373,994,348	27,055,659		
		(401,050,007)		(373,994,348)	(27,055,659)		
					100.0%		
合計		401,050,007		373,994,348	27,055,659		
		(401,050,007)		(373,994,348)	(27,055,659)		

(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

2020年6月30日現在

資産総額	2,909,557,298円
負債総額	1,444,188,194円
純資産総額( - )	1,465,369,104円
発行済口数	2,167,522,656口
1口当たり純資産額( / )	0.6761円

#### 野村米国好利回り社債投信 Dコース

2020年6月30日現在

資産総額	7,335,286,521円
負債総額	36,857,747円
純資産総額( - )	7,298,428,774円
発行済口数	8,481,992,832口
1口当たり純資産額( / )	0.8605円

#### (参考)野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

2020年6月30日現在

資産総額	12,616,548,413円
負債総額	48,236,419円
純資産総額( - )	12,568,311,994円
発行済口数	5,343,545,001口
1口当たり純資産額( / )	2.3521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

2020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2020年6月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,011	30,063,056
単位型株式投資信託	182	833,280
追加型公社債投資信託	14	5,668,377
単位型公社債投資信託	461	1,626,797
合計	1,668	38,191,510

### 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(2019年4月1日から2020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。

#### (1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		1,562	2,626
金銭の信託		45,493	41,524
有価証券		19,900	24,399
前払費用		27	106
未収入金		500	522
未収委託者報酬		25,246	23,936
未収運用受託報酬		5,933	4,336
その他		269	71
貸倒引当金		15	14
流動資産計		98,917	97,509
固定資産			
有形固定資産		714	645

建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	
投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		0	
投資損失引当金		707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	

その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

## (2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			119,196		115,736
運用受託報酬			21,440		17,170
その他営業収益			355		340
営業収益計			140,992		133,247
営業費用					
支払手数料			42,675		39,435
広告宣伝費			1,210		1,006
公告費			0		-
調査費			30,082		26,833
調査費		5,998		5,696	
委託調査費		24,083		21,136	
委託計算費			1,311		1,342
営業雑経費			5,435		5,823
通信費		92		75	
印刷費		970		958	
協会費		86		92	
諸経費		4,286		4,696	
営業費用計			80,715		74,440
一般管理費					
給料			11,113		11,418
役員報酬		379		109	
給料・手当		7,067		7,173	
賞与		3,666		4,134	
交際費			107		86
旅費交通費			514		391
租税公課			1,048		1,029
不動産賃借料			1,223		1,227
退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348
諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
經常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(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 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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 準備金	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		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	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									

当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(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	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

## [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。  <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <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>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
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  従業員からの退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。  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  確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。  退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</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>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まいります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。  なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</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 2020年3月31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 2020年3月31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せん。

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。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(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。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020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 1,434百万円	未払費用 1,296百万円

<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">736百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">3,106</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,842</td> </tr> </table>	建物	736百万円	器具備品	3,106	合計	3,842	<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">761百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,347</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,109</td> </tr> </table>	建物	761百万円	器具備品	2,347	合計	3,109
建物	736百万円												
器具備品	3,106												
合計	3,842												
建物	761百万円												
器具備品	2,347												
合計	3,109												

### 損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)																		
<p>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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">6,531百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">1</td> </tr> </table> <p>2. 固定資産除却損</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">3百万円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">307</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">310</td> </tr> </table> <p>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。</p>	受取配当金	6,531百万円	支払利息	1	器具備品	3百万円	ソフトウェア	307	合計	310	<p>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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">4,931百万円</td> </tr> </table> <p>2. 固定資産除却損</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">7百万円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: right;">59</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">67</td> </tr> </table>	受取配当金	4,931百万円	器具備品	7百万円	ソフトウェア	59	合計	67
受取配当金	6,531百万円																		
支払利息	1																		
器具備品	3百万円																		
ソフトウェア	307																		
合計	310																		
受取配当金	4,931百万円																		
器具備品	7百万円																		
ソフトウェア	59																		
合計	67																		

### 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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

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

##### (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

2020年5月19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	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

#### 金融商品関係

前事業年度(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、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	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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

2020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	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

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

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパー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1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）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。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上してありました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

#### 有価証券関係

前事業年度（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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

- 1．売買目的有価証券(2020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(2020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(2020年3月31日)  
該当事項はありません。
- 4．その他有価証券(2020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	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

- 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020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 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	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

確定給付型企業年金制度の割引率	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。

## 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

## (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	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413

## (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	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289
(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	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
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	0.6%
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、202百万円でした。	

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020年3月31日)	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.4%
タックスヘイブン税制	2.6%	タックスヘイブン税制	2.6%
外国税額控除	0.6%	外国税額控除	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	1.3%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	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 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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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 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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売上の取扱 ならびに投資 信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払(*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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(\*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、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. 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88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	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	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。

\* 2020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。

\* 2020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)	49,725,399.28 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。

\* 2020年3月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2020年7月31日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村米国好利回り社債投信Cコースの2019年12月10日から2020年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村米国好利回り社債投信Cコースの2020年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
  - ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
  - ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
  - ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
  - ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- 監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記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

2020年7月31日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村米国好利回り社債投信Dコースの2019年12月10日から2020年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村米国好利回り社債投信Dコースの2020年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
  - ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
  - ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
  - ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
  - ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- 監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記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**

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中**EY新日本有限責任監査法人**

東京事務所

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。



## 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。