

【表紙】

- 【提出書類】** 有価証券届出書
- 【提出先】** 関東財務局長殿
- 【提出日】** 平成24年10月12日提出
- 【発行者名】** 野村アセットマネジメント株式会社
- 【代表者の役職氏名】** CEO兼執行役会長兼社長 岩崎俊博
- 【本店の所在の場所】** 東京都中央区日本橋一丁目12番1号
- 【事務連絡者氏名】** 松井 秀仁
連絡場所 東京都中央区日本橋一丁目12番1号
- 【電話番号】** 03-3241-9511
- 【届出の対象とした募集
内国投資信託受益証券に
係るファンドの名称】** 野村日本債券インデックス（野村SMA向け）
- 【届出の対象とした募集
内国投資信託受益証券の
金額】** 継続募集額(平成24年10月13日から平成25年10月16日まで)
2兆円を上限とします。
*なお、継続申込期間(以下「申込期間」といいます。)は、上記期間満了
前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。
- 【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

野村日本債券インデックス（野村SMA向け）

（以下「ファンド」といいます。なお、「野村日本債券インデックス SMA」と称する場合があります。）

ファンドは、SMA（セパレトリー・マネージド・アカウント）に係る契約に基づいて、SMA取引口座の資金を運用するためのファンドです。ファンドを購入できる投資者については、後述の「(12)その他 申込みの方法」をご参照ください。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当り1円です。

信用格付

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者である野村アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

2兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込日の基準価額 とします。

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

「基準価額」とは、純資産総額をその時の受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口あたりの価額で表示されます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

(7) 【申込期間】

平成24年10月13日から平成25年10月16日まで

* なお、申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

(9) 【払込期日】

取得申込日から起算して5営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、野村アセットマネジメント株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。)の指定する口座を経由して、野村信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

申込みの方法

受益権の取得申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、SMA(セパレトリー・マネージド・アカウント)に係る契約に基づいて、SMA取引口座の資金を運用するためのファンドです。

ファンドの買付けの申込みを行なう投資家は、販売会社にSMA(セパレトリー・マネージド・アカウント)取引口座を開設した者等に限るものとします。

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

購入、換金の各お申込みの方法ならびに単位、および分配金のお取扱い等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

取得申込みの受付けの中止、既に受付けた取得申込みの受付けの取り消し

金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があります。取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。)等における取引の停止、その他やむを得ない事情等があるときは、取得申込みの受付けを中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付けを取り消す場合があります。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度(「振替制度」と称する場合があります。)とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

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】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドは、SMA（セパレートリー・マネージド・アカウント）に係る契約に基づいて、SMA取引口座の資金を運用するためのファンドです。

わが国の公社債を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

ファンドは、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

< 商品分類 >

社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に**網掛け表示**しております。

(野村日本債券インデックス(野村SMA向け))

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般	年2回	日本		日経225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		T O P I X
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ()	中南米	ファンド・オ ブ・ ファンズ	その他 (NOMURA- BPI総合)
社債		アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ()		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券 (債券一般))				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（債券）とが異なります。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

《社団法人投資信託協会インターネットホームページアドレス》 <http://www.toushin.or.jp/>

社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。(平成22年7月1日現在)

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われぬファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来からの信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

- (1) 一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- (2) 大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- (3) 中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

債券

- (1)一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- (2)公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3)社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (4)その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (5)格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- (1)資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- (2)資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

- (1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)にのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するも

のをいう。

- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

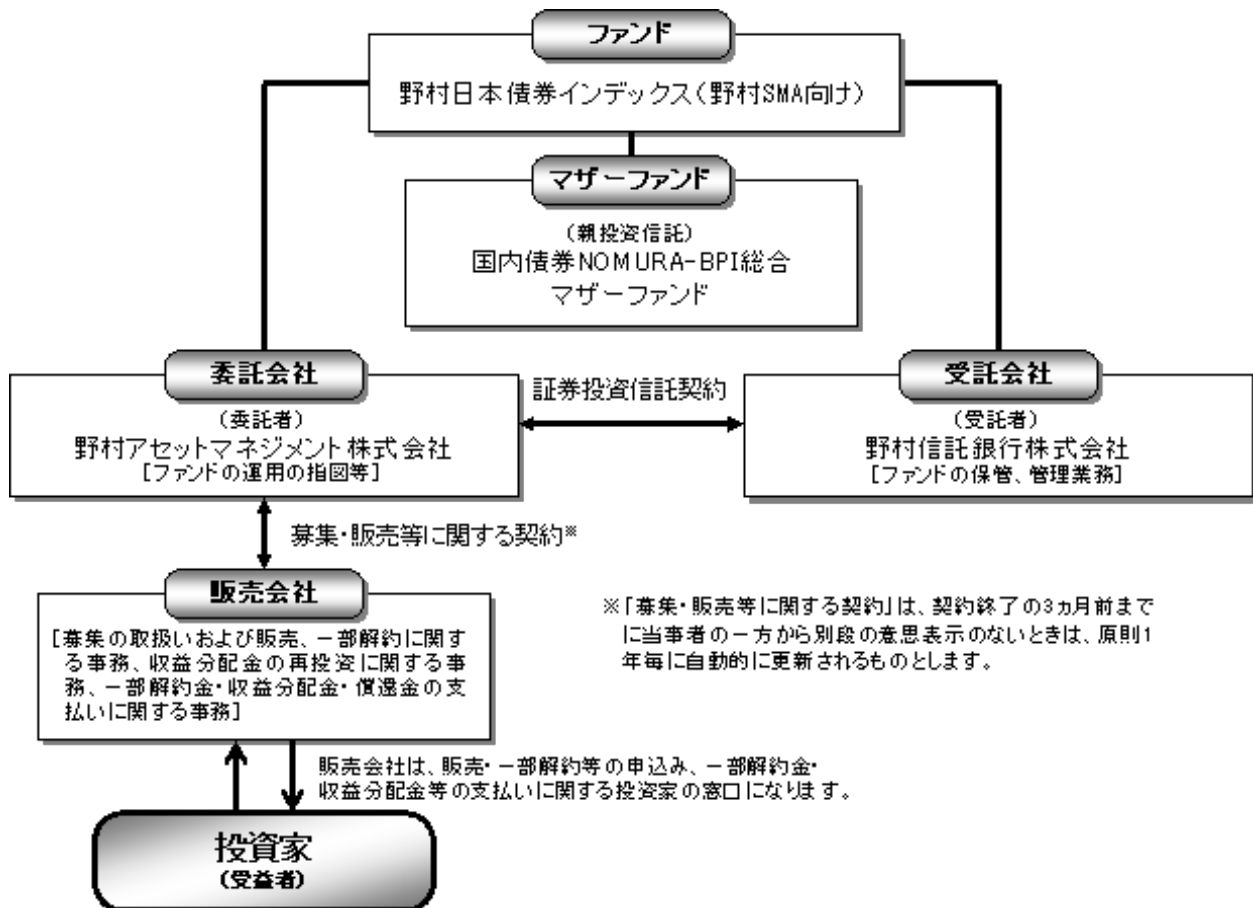
[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

(2)【ファンドの沿革】

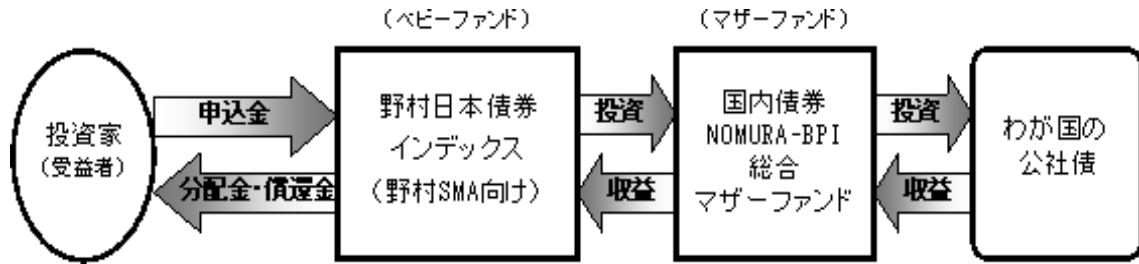
平 信託
成 契約
22 締
年 結、
7 ファ
月 ンド
30 の設
日 定
日、
運用
開始

(3)【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

ファンドは「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を親投資信託（マザーファンド）とするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



マザーファンドの運用の方針等については、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）マザーファンドの概要」をご参照ください。
分配金は税引き後無手数料で再投資されます。なお、お客様と販売会社とのご契約によっては、再投資が行なわれない場合があります。
ファンドは、マザーファンドのほかに、公社債等に直接投資する場合があります。

委託会社の概況

委託会社

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

平成24年8月末現在、17,180百万円

・会社の沿革

昭和34年(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

平成9年(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

平成12年(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

平成15年(2003年)6月27日

委員会等設置会社へ移行

・大株主の状況(平成24年8月末現在)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

NOMURA-BPI総合とは

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

ファンドは、わが国の公社債を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、親投資信託である「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、直接公社債等に投資する場合があります。

デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定します。

投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「(5) 投資制限 および 」に定めるものに限ります。）に係る権利
 - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託者は、信託金を、主として、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。）
5. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
6. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
7. 転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債 の新株予約権に限ります。）の行使により取得した株券
転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。
8. コマーシャル・ペーパー
9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
11. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信

託の受益証券に表示されるべきもの

12. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

13. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

14. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第7号の証券または証書および第9号の証券または証書のうち第7号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第1号から第6号までの証券および第9号の証券または証書のうち第1号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託者は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

（参考）マザーファンドの概要

「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

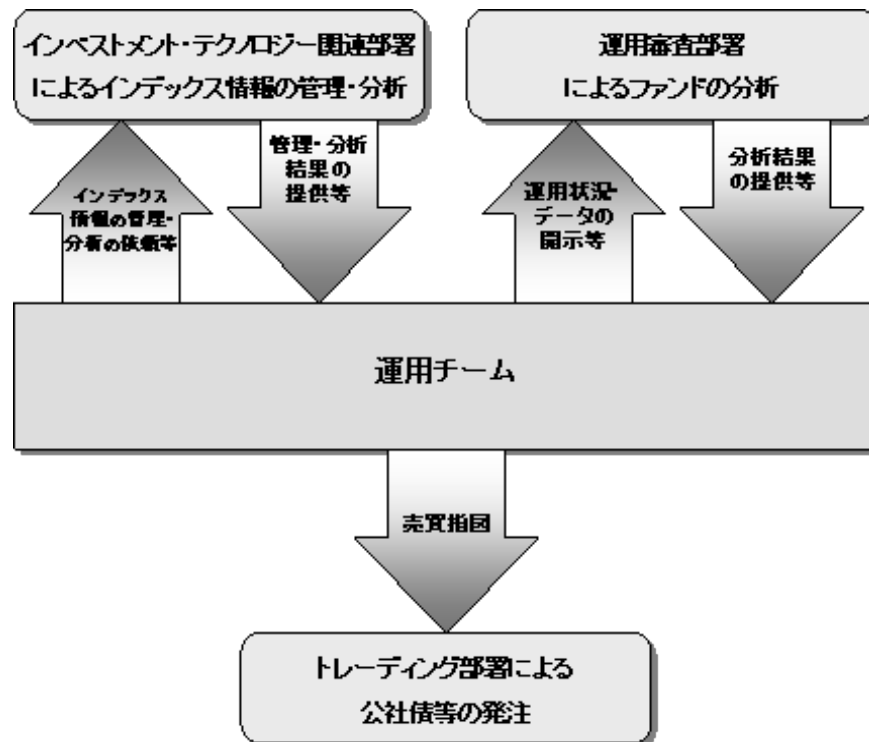
外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

(3) 【運用体制】

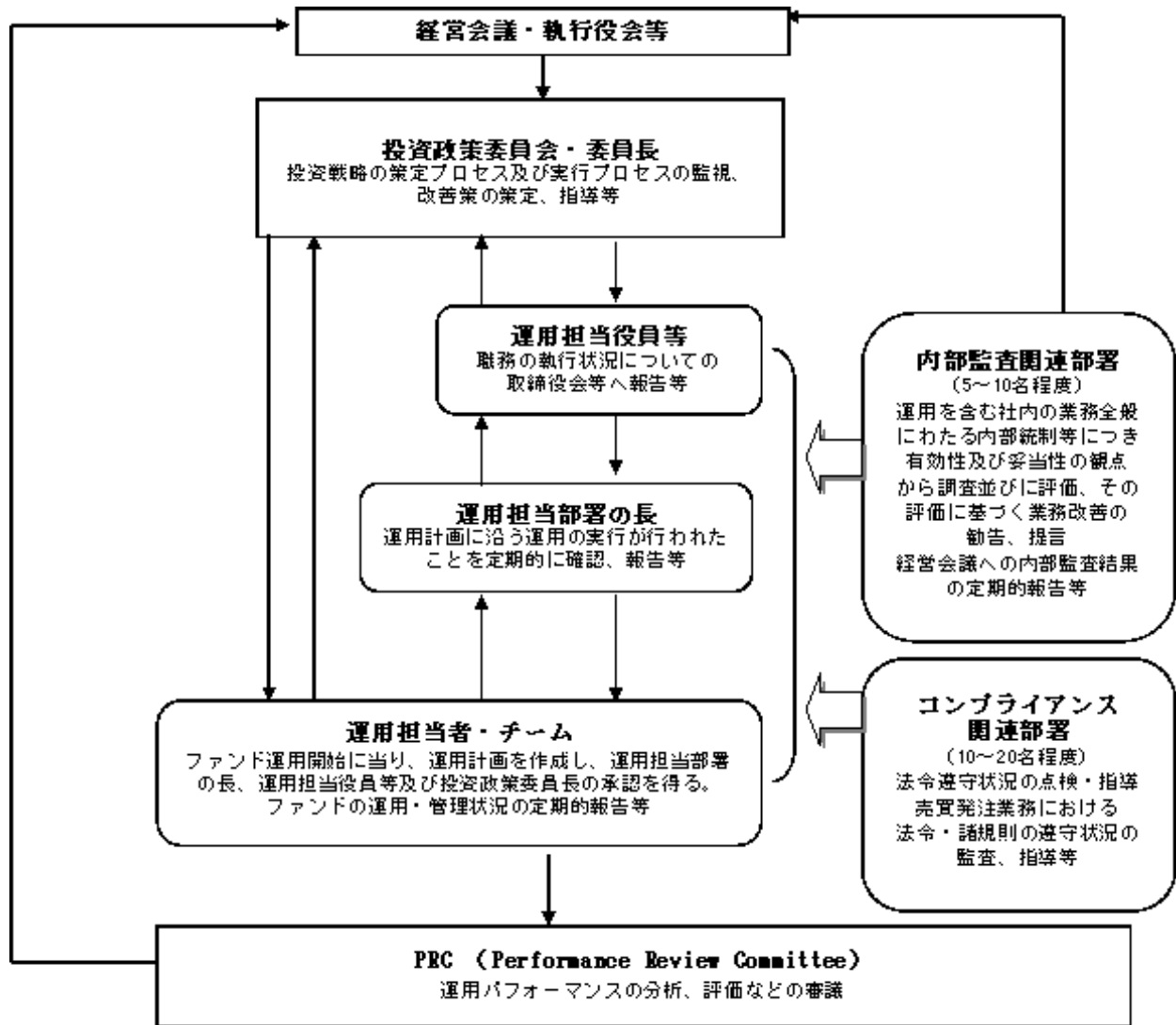
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

当社では、ファンドの運用に関する社内規程として、運用担当者に関する規程並びにスワップ取引、信用リスク管理、資金の借入、外国為替の予約取引等、信用取引等に関して各々、取扱い基準を設けております。

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



委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、SAS70(受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準)に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

ファンドの運用体制等は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

収益分配金額は、上記 の範囲内で基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

利子・配当等収益とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品賃料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当す

る金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

ファンドの決算日

原則として毎年7月20日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

分配金のお支払い

分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

なお、お客様と販売会社とのご契約によっては、再投資が行なわれない場合があります。

(5)【投資制限】

株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

株式への直接投資は行ないません。株式への投資は、転換社債を転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への投資は行ないません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資する株式の範囲(約款第19条)

()委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

()上記()の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

()委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

()委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利に係るこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換す

る取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ()上記()においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ()スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ()委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第24条)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ()上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ()委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

公社債の借入れ(約款第25条)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ()上記()の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ()信託財産の一部解約等の事由により、上記()の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ()上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

資金の借入れ(約款第31条)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ()一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ()収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ()借入金の利息は信託財産中より支弁します。

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。

ファンドの基準価額と対象インデックスは、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。

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

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

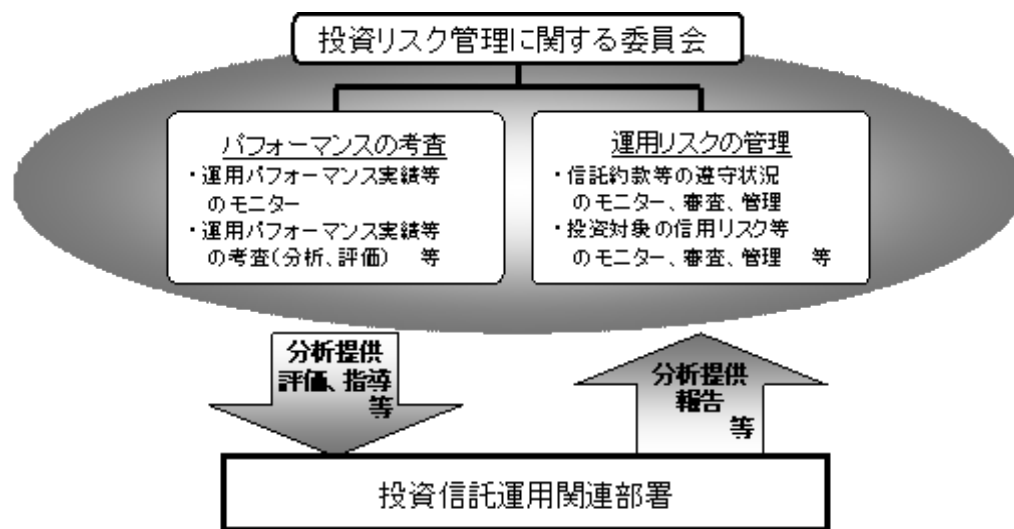
パフォーマンスの考査

投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査(分析、評価)の結果の報告、審議を行います。

運用リスクの管理

投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行うことにより、適切な管理を行います。

リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.2415%（税抜年0.23%）を乗じて得た額とし、その分配については次の通り(税抜)とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.15%	年0.05%	年0.03%

上記の信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。

(4)【その他の手数料等】

ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用はファンドから支払われません。

ファンドに係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときにファンドから支払われます。

これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10.147%（国税（所得税及び復興特別所得税）7.147%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告によ

り、申告分離課税もしくは総合課税(配当控除は適用されません。)のいずれかを選択することもできます。上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%(国税15.315%および地方税5%)となる予定です。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)については、申告分離課税により10%(所得税7%および地方税3%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行なわれます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)については、申告分離課税により10.147%(国税7.147%および地方税3%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10.147%の税率により源泉徴収が行なわれます。なお、上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%(国税15.315%および地方税5%)となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

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

法人の投資家に対する課税

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額については、7%(所得税7%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額については、7.147%(国税7.147%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7.147%の税率は平成26年1月1日以後、15.315%(国税15.315%)となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、益金不算入制度は適用されません。

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、販売会社の買取りによるご換金の場合は、税金の取扱いが異なる場合があります。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。

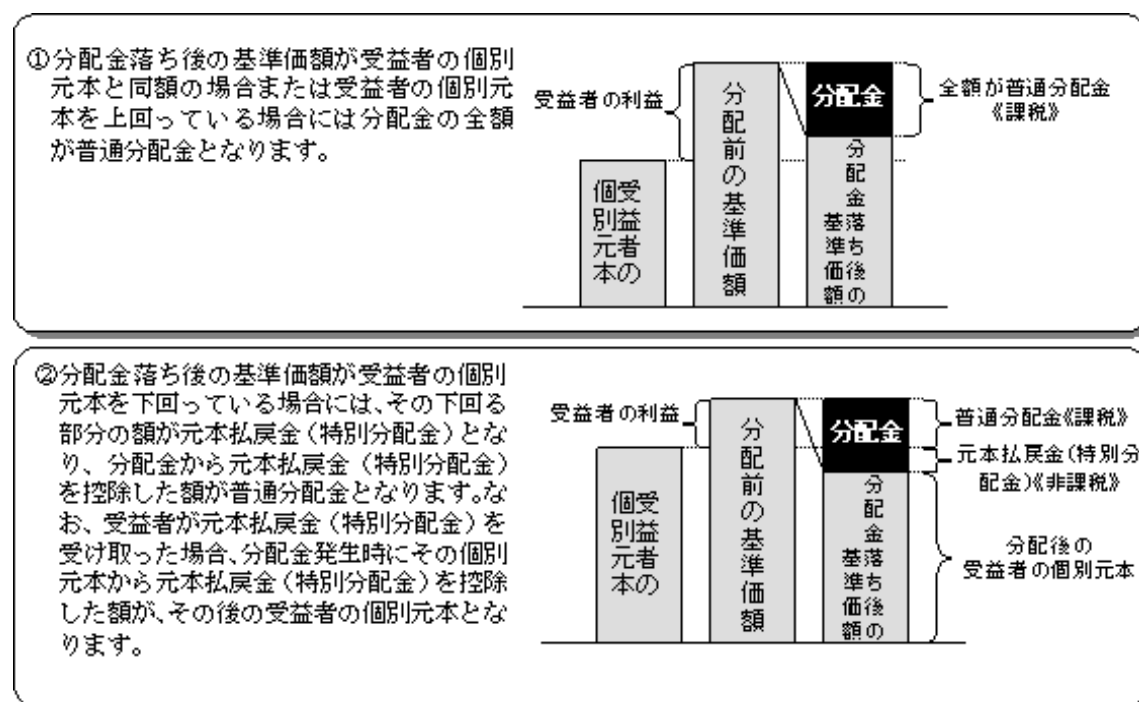
個別元本について

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。

（ご参考）

お客様に直接ご負担いただく費用・税金

時期	項目	費用	税金
換金時 (解約請求制)	信託財産留保額	0.1%	

基準価額に0.1%を乗じて得た額とします。

時期	項目	費用	税金
分配時	所得税および地方税		普通分配金 × 10% ¹
換金時 (解約請求制)	所得税および地方税		換金時の差益(譲渡益) ² に対して10% ¹

償還時	所得税および地方税	償還時の差益(譲渡益) ² に対して10% ¹
-----	-----------	---

1 個人の投資家の場合の税率です。法人の投資家の場合には税率等が異なります。詳しくは前述の「法人の投資家に対する課税」をご覧ください。

平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は10.147%、平成26年1月1日以後は20.315%となる予定です。

2 詳しくは前述の「換金（解約）時および償還時の課税について」をご覧ください。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は平成24年8月31日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	7,335,013,262	99.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		684,390	0.00
合計(純資産総額)		7,335,697,652	100.00

<ご参考>

「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	169,837,925,350	75.59
地方債証券	日本	16,033,305,076	7.13
特殊債券	日本	20,551,171,755	9.14
社債券	日本	15,318,134,000	6.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,940,077,509	1.30
合計(純資産総額)		224,680,613,690	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	6,237,256,176	1.1796	7,357,467,386	1.1760	7,335,013,262	99.99

<ご参考>

「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」

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	日本	国債証券	国庫債券 利付(2年)第316回	3,500,000,000	100.00	3,500,105,000	100.00	3,500,280,000	0.1	2014/5/15	1.55
2	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第102回	3,400,000,000	99.90	3,396,838,000	100.57	3,419,550,000	0.3	2016/12/20	1.52
3	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第90回	2,700,000,000	100.38	2,710,314,000	100.57	2,715,390,000	0.3	2015/6/20	1.20
4	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第312回	2,450,000,000	102.83	2,519,531,000	104.82	2,568,139,000	1.2	2020/12/20	1.14
5	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第311回	2,450,000,000	99.80	2,445,149,000	101.76	2,493,316,000	0.8	2020/9/20	1.10
6	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第306回	2,300,000,000	105.18	2,419,352,000	106.61	2,452,168,000	1.4	2020/3/20	1.09
7	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第305回	2,300,000,000	104.35	2,400,050,000	105.92	2,436,321,000	1.3	2019/12/20	1.08
8	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第295回	2,000,000,000	106.08	2,121,700,000	106.92	2,138,440,000	1.5	2018/6/20	0.95
9	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第309回	2,000,000,000	102.46	2,049,360,000	104.26	2,085,300,000	1.1	2020/6/20	0.92
10	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第284回	1,900,000,000	106.42	2,022,113,000	106.56	2,024,754,000	1.7	2016/12/20	0.90
11	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第89回	2,000,000,000	100.70	2,014,020,000	100.84	2,016,980,000	0.4	2015/6/20	0.89
12	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第320回	1,900,000,000	100.13	1,902,508,000	102.39	1,945,486,000	1	2021/12/20	0.86
13	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第81回	1,900,000,000	101.34	1,925,574,000	101.08	1,920,577,000	0.8	2014/3/20	0.85
14	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第88回	1,900,000,000	100.98	1,918,715,000	101.02	1,919,494,000	0.5	2015/3/20	0.85
15	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第86回	1,800,000,000	101.12	1,820,286,000	101.03	1,818,540,000	0.6	2014/9/20	0.80
16	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第289回	1,700,000,000	106.21	1,805,607,000	106.58	1,811,945,000	1.5	2017/12/20	0.80
17	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第319回	1,750,000,000	101.06	1,768,574,000	103.26	1,807,120,000	1.1	2021/12/20	0.80
18	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第324回	1,800,000,000	100.06	1,801,258,000	100.04	1,800,810,000	0.8	2022/6/20	0.80
19	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第313回	1,700,000,000	103.48	1,759,160,000	105.51	1,793,755,000	1.3	2021/3/20	0.79
20	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第96回	1,700,000,000	100.97	1,716,643,000	101.35	1,723,069,000	0.5	2016/3/20	0.76
21	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第97回	1,700,000,000	100.52	1,708,840,000	101.01	1,717,306,000	0.4	2016/6/20	0.76
22	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第287回	1,550,000,000	107.92	1,672,884,000	108.06	1,675,054,000	1.9	2017/6/20	0.74
23	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第288回	1,550,000,000	107.29	1,663,035,000	107.38	1,664,421,000	1.7	2017/9/20	0.74

24	日本	国債証券	国庫債券	利付(20年)第33回	1,410,000,000	115.48	1,628,282,100	114.74	1,617,834,000	3.8	2016/9/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券	利付(5年)第99回	1,600,000,000	100.44	1,607,040,000	101.02	1,616,400,000	0.4	2016/9/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券	利付(5年)第101回	1,600,000,000	100.37	1,605,920,000	101.00	1,616,016,000	0.4	2016/12/20	0.71
27	日本	国債証券	国庫債券	利付(5年)第82回	1,500,000,000	101.54	1,523,130,000	101.23	1,518,555,000	0.9	2014/3/20	0.67
28	日本	国債証券	国庫債券	利付(2年)第311回	1,500,000,000	100.16	1,502,400,000	100.13	1,502,010,000	0.2	2013/12/15	0.66
29	日本	国債証券	国庫債券	利付(10年)第283回	1,400,000,000	106.60	1,492,428,000	106.67	1,493,436,000	1.8	2016/9/20	0.66
30	日本	国債証券	国庫債券	利付(5年)第95回	1,400,000,000	101.37	1,419,194,000	101.70	1,423,926,000	0.6	2016/3/20	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
投資信託受益証券		99.99
合計		99.99

<ご参考>

「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		75.59
地方債証券		7.13
特殊債券		9.14
社債券		6.81
合計		98.69

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成24年8月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2011年7月20日)	2,618	2,619	1.0068	1.0073
第2期 (2012年7月20日)	6,485	6,488	1.0363	1.0368
2011年8月末日	3,045		1.0097	
9月末日	3,462		1.0133	
10月末日	3,454		1.0113	
11月末日	3,930		1.0107	
12月末日	3,946		1.0169	
2012年1月末日	3,953		1.0186	
2月末日	3,955		1.0196	
3月末日	3,734		1.0200	
4月末日	3,760		1.0252	
5月末日	4,330		1.0306	
6月末日	6,053		1.0302	
7月末日	6,570		1.0335	
8月末日	7,335		1.0320	

【分配の推移】

期	1口当たりの分配金
第1期	0.0005 円
第2期	0.0005 円

【収益率の推移】

期	収益率
第1期	0.7 %
第2期	3.0 %

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

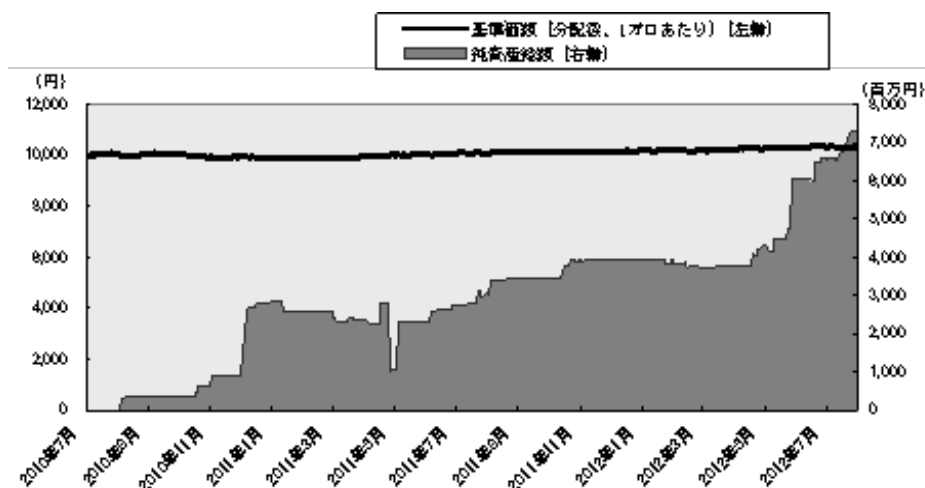
(4) 【設定及び解約の実績】

期	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期	5,346,759,699	2,745,896,611	2,600,863,088
第2期	4,761,596,941	1,104,334,608	6,258,125,421

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

< 参考情報 > 運用実績（2012年8月31日現在）

[基準価額・純資産の推移]（日次：設定来）



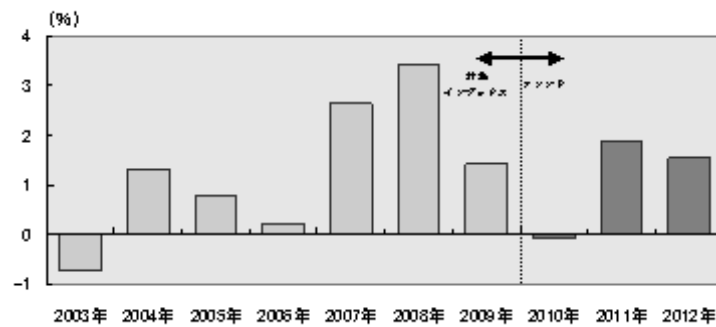
[分配の推移]（1万口あたり、課税前）

2012年7月	5 円
2011年7月	5 円
--	--
--	--
--	--
設定来累計	10 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 (%)
1	国庫債券 利付(2年)第316回	国債証券	1.5
2	国庫債券 利付(5年)第102回	国債証券	1.5
3	国庫債券 利付(5年)第90回	国債証券	1.2
4	国庫債券 利付(10年)第312回	国債証券	1.1
5	国庫債券 利付(10年)第311回	国債証券	1.1
6	国庫債券 利付(10年)第306回	国債証券	1.1
7	国庫債券 利付(10年)第305回	国債証券	1.1
8	国庫債券 利付(10年)第295回	国債証券	0.9
9	国庫債券 利付(10年)第309回	国債証券	0.9
10	国庫債券 利付(10年)第284回	国債証券	0.9

[年間収益率の推移] (暦年ベース)



- ・ ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ 2003年から2009年は対象インデックスの年間収益率。
- ・ 2010年は設定日（2010年7月30日）から年末までのファンドの収益率。
- ・ 2012年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 対象インデックスの情報はあくまで参考情報であり、運用実績ではありません。
 ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

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

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

販売の単位は、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

受益権の販売価額は、取得申込日の基準価額とします。

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

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

<申込手数料>

ありません。

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

2【換金(解約)手続等】

受益者は、委託者に1口単位で一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とし

ます。

換金価額は、換金のお申込み日の基準価額から信託財産留保額 を差し引いた価額となります。

信託財産留保額は、基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

換金時の税金につきましては「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資家との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、クローズド期間の有無に関係なく、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

換金のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値) 第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2)【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします(平成22年7月30日設定)。

(4)【計算期間】

原則として、毎年7月21日から翌年7月20日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

(a)ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくははやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b)信託期間の終了

- ()委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- ()上記()の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ()上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ()上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。
- ()委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ()委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更等()」の書面決議が否決となる場合を除き、その委託者と受託者との間において存続します。

(c)運用報告書

委託者は、ファンドの決算時および償還時に運用報告書を作成し、知れている受益者に対して交付します。

(d)信託約款の変更等

- ()委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併

合」をいいます。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ()委託者は、上記()の事項(上記()の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- ()上記()の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ()上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であつて、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ()書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ()上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ()上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e)公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nomura-am.co.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(f)受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- ()受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。
- ()委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求の内容および買取請求の手續に関する事項は、前述の「(b)信託期間の終了」()または「(d)信託約款の変更等」()に規定する書面に付記します。

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示請求を行うことはできません。

- 1.他の受益者の氏名または名称および住所
- 2.他の受益者が有する受益権の内容

(i) 関係法人との契約の更新に関する手續

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則1年毎に自動的に更新されるものとします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

収益分配金は、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

なお、お客様と販売会社とのご契約によっては、再投資が行なわれない場合があります。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を1口単位で換金できます。

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

換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者にお支払いします。

第3【ファンドの経理状況】

野村日本債券インデックス（野村SMA向け）

- (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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成23年7月21日から平成24年7月20日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成23年 7月20日現在	第2期 平成24年 7月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,892,089	5,537,242
親投資信託受益証券	2,617,204,500	6,484,567,203
未収入金	2,481,532	3,331,300
未収利息	7	14
流動資産合計	2,622,578,128	6,493,435,759
資産合計	2,622,578,128	6,493,435,759
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,300,431	3,129,062
未払受託者報酬	355,983	663,859
未払委託者報酬	2,373,143	4,425,697
その他未払費用	23,675	44,193
流動負債合計	4,053,232	8,262,811
負債合計	4,053,232	8,262,811
純資産の部		
元本等		
元本	2,600,863,088	6,258,125,421
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,661,808	227,047,527
（分配準備積立金）	15,216,364	116,105,182
元本等合計	2,618,524,896	6,485,172,948
純資産合計	2,618,524,896	6,485,172,948
負債純資産合計	2,622,578,128	6,493,435,759

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自平成22年 7月30日 至平成23年 7月20日	第2期 自平成23年 7月21日 至平成24年 7月20日
営業収益		
受取利息	2,003	5,980
有価証券売買等損益	16,538,206	130,340,654
営業収益合計	16,540,209	130,346,634
営業費用		
受託者報酬	475,711	1,212,049
委託者報酬	3,171,216	8,080,230
その他費用	31,634	80,678
営業費用合計	3,678,561	9,372,957
営業利益	12,861,648	120,973,677
経常利益	12,861,648	120,973,677
当期純利益	12,861,648	120,973,677
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	3,655,147	13,434,115
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	17,661,808
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,166,967	116,776,469
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,166,967	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	116,776,469
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,721,523	11,801,250
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	11,801,250
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,721,523	-
分配金	1,300,431	3,129,062
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,661,808	227,047,527

(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	(1 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	(1 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	当ファンドの計算期間は、平成23年7月21日から平成24年7月20日までとなっております。

(追加情報)

第2期 自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「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号平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 平成23年7月20日現在	第2期 平成24年7月20日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 2,600,863,088 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 6,258,125,421 口
2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0068 円 (10,000口当たり純資産額 10,068 円)	2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0363 円 (10,000口当たり純資産額 10,363 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成22年7月30日 至 平成23年7月20日	第2期 自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日																																																												
1 分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額22,672,167円(10,000口当たり87円)のうち、1,300,431円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額230,176,589円(10,000口当たり367円)のうち、3,129,062円(10,000口当たり5円)を分配金額としております。																																																												
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: center;">B</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">15,335,133円</td> <td></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 style="text-align: right;">1,181,662円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: right;">6,155,372円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: right;">円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: right;">E = A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">22,672,167円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: right;">F</td> <td style="text-align: right;">2,600,863,088口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: right;">G = E / F × 10,000</td> <td style="text-align: right;">87円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td style="text-align: right;">H</td> <td style="text-align: right;">5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金額</td> <td style="text-align: right;">I = F × H / 10,000</td> <td style="text-align: right;">1,300,431円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	B	費用控除後の配当等収益額	15,335,133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	1,181,662円		収益調整金額	6,155,372円		分配準備積立金額	円		当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	22,672,167円	当ファンドの期末残存口数	F	2,600,863,088口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	87円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金額	I = F × H / 10,000	1,300,431円	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: center;">B</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: right;">50,136,896円</td> <td></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 style="text-align: right;">57,402,666円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: right;">110,942,345円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: right;">11,694,682円</td> <td></td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: right;">E = A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">230,176,589円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: right;">F</td> <td style="text-align: right;">6,258,125,421口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: right;">G = E / F × 10,000</td> <td style="text-align: right;">367円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td style="text-align: right;">H</td> <td style="text-align: right;">5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金額</td> <td style="text-align: right;">I = F × H / 10,000</td> <td style="text-align: right;">3,129,062円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	B	費用控除後の配当等収益額	50,136,896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	57,402,666円		収益調整金額	110,942,345円		分配準備積立金額	11,694,682円		当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	230,176,589円	当ファンドの期末残存口数	F	6,258,125,421口	10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	367円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金額	I = F × H / 10,000	3,129,062円
項目	A	B																																																											
費用控除後の配当等収益額	15,335,133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	1,181,662円																																																												
収益調整金額	6,155,372円																																																												
分配準備積立金額	円																																																												
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	22,672,167円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,600,863,088口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	87円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金額	I = F × H / 10,000	1,300,431円																																																											
項目	A	B																																																											
費用控除後の配当等収益額	50,136,896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	57,402,666円																																																												
収益調整金額	110,942,345円																																																												
分配準備積立金額	11,694,682円																																																												
当ファンドの分配対象収益額	E = A+B+C+D	230,176,589円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	6,258,125,421口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G = E / F × 10,000	367円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金額	I = F × H / 10,000	3,129,062円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成22年7月30日 至 平成23年7月20日	第2期 自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日
1 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1 金融商品に対する取組方針 同左

<p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
--	--

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成23年7月20日現在	第2期 平成24年7月20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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成22年7月30日 至 平成23年7月20日	第2期 自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日

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

(その他の注記)

1 元本の移動

第1期 自 平成22年7月30日 至 平成23年7月20日		第2期 自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日	
期首元本額	円	期首元本額	2,600,863,088 円
期中追加設定元本額	5,346,759,699 円	期中追加設定元本額	4,761,596,941 円
期中一部解約元本額	2,745,896,611 円	期中一部解約元本額	1,104,334,608 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成22年7月30日 至 平成23年7月20日	第2期 自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20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	16,702,152	123,044,730
合計	16,702,152	123,044,730

3 デリバティブ取引関係

第1期(平成23年7月20日現在)

該当事項はございません。

第2期(平成24年7月20日現在)

該当事項はございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年7月20日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券

(平成24年7月20日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド		6,484,567,203	
親投資信託受益証券計	銘柄数：1		6,484,567,203	
	組入時価比率：100.0%		100.0%	
合計			6,484,567,203	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はございません。

[次へ](#)

参考

当ファンドは「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
尚、同親投資信託の状況は次の通りです。

- 1 「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」の状況
以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成24年7月20日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,052,607,264
国債証券		170,268,188,080
地方債証券		16,323,092,104
特殊債券		20,506,163,034
社債券		15,329,669,000
未収利息		720,902,428
前払費用		11,126,376
流動資産合計		226,211,748,286
負債の部		
流動負債		
未払解約金		255,958,292
流動負債合計		255,958,292
負債合計		
		255,958,292
純資産の部		
元本等		
元本		191,413,611,637
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		34,542,178,357
元本等合計		225,955,789,994
純資産合計		
		225,955,789,994
負債純資産合計		
		226,211,748,286

(2) 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	(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
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。

(追加情報)

自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「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号平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成24年7月20日現在	
1 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1805 円
(10,000口当たり純資産額)	11,805 円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成23年7月21日 至 平成24年7月20日	
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年7月20日現在	
1 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(その他の注記)

平成24年7月20日現在

1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年7月21日
期首元本額	208,520,678,458 円
期首より平成24年7月20日までの期中追加設定元本額	36,232,583,553 円
期首より平成24年7月20日までの期中一部解約元本額	53,339,650,374 円
期末元本額	191,413,611,637 円
期末元本額の内訳*	
野村国内債券インデックスファンド	316,990,858 円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	21,599,435,657 円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	36,531,142,405 円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,210,605,999 円
野村資産設計ファンド2015	1,028,378,268 円
野村資産設計ファンド2020	301,530,883 円
野村資産設計ファンド2025	209,411,450 円
野村資産設計ファンド2030	126,988,617 円
野村資産設計ファンド2035	63,762,119 円
野村資産設計ファンド2040	184,141,580 円
野村日本債券インデックスファンド	4,313,244,079 円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	1,389,724,455 円
のむらップ・ファンド(保守型)	2,084,013,203 円
のむらップ・ファンド(普通型)	650,879,445 円
のむらップ・ファンド(積極型)	205,281,139 円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	5,493,068,364 円
野村資産設計ファンド2045	3,211,834 円
野村円債投資インデックスファンド	1,319,114,844 円
野村インデックスファンド・国内債券	133,205,107 円
マイ・ロード	1,522,696,079 円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	7,791,657,953 円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	454,420,115 円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	20,019,587,169 円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,279,069,657 円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	56,260,439 円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	46,830,410 円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	10,959,571 円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	9,215,398,181 円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	485,288,900 円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	2,769,081,014 円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,867,071,259 円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	173,106,344 円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	450,514,953 円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	941,418,158 円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,127,033,560 円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,158,888,086 円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	6,863,127,686 円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,203,560,969 円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,170,679,201 円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	30,705,742,674 円
マイバランスDC30	2,822,866,245 円
マイバランスDC50	1,594,474,081 円
マイバランスDC70	394,593,222 円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	4,125,155,405 円

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

[次へ](#)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年7月20日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券

(平成24年7月20日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(2年)第311回	1,500,000,000	1,502,085,000	
	国庫債券 利付(2年)第314回	500,000,000	500,000,000	
	国庫債券 利付(2年)第316回	3,500,000,000	3,500,000,000	
	国庫債券 利付(5年)第75回	600,000,000	606,942,000	
	国庫債券 利付(5年)第76回	600,000,000	607,638,000	
	国庫債券 利付(5年)第77回	900,000,000	909,369,000	
	国庫債券 利付(5年)第78回	400,000,000	404,496,000	
	国庫債券 利付(5年)第79回	700,000,000	705,901,000	
	国庫債券 利付(5年)第80回	800,000,000	807,872,000	
	国庫債券 利付(5年)第81回	1,900,000,000	1,921,964,000	
	国庫債券 利付(5年)第82回	1,500,000,000	1,519,815,000	
	国庫債券 利付(5年)第83回	700,000,000	710,654,000	
	国庫債券 利付(5年)第84回	1,300,000,000	1,314,833,000	
	国庫債券 利付(5年)第85回	1,000,000,000	1,012,920,000	
	国庫債券 利付(5年)第86回	1,800,000,000	1,819,386,000	
	国庫債券 利付(5年)第88回	1,900,000,000	1,920,121,000	
	国庫債券 利付(5年)第89回	2,000,000,000	2,017,380,000	
	国庫債券 利付(5年)第90回	2,700,000,000	2,715,633,000	
	国庫債券 利付(5年)第91回	900,000,000	908,496,000	
	国庫債券 利付(5年)第92回	100,000,000	100,629,000	
	国庫債券 利付(5年)第93回	100,000,000	101,358,000	
	国庫債券 利付(5年)第95回	1,400,000,000	1,425,480,000	
	国庫債券 利付(5年)第96回	1,700,000,000	1,724,752,000	
	国庫債券 利付(5年)第97回	1,700,000,000	1,719,176,000	
	国庫債券 利付(5年)第98回	800,000,000	805,752,000	
	国庫債券 利付(5年)第99回	1,600,000,000	1,617,856,000	
	国庫債券 利付(5年)第101回	1,600,000,000	1,617,856,000	
	国庫債券 利付(5年)第102回	3,400,000,000	3,423,052,000	
	国庫債券 利付(5年)第103回	1,000,000,000	1,006,460,000	
	国庫債券 利付(5年)第104回	1,000,000,000	1,001,840,000	
	国庫債券 利付(5年)第105回	800,000,000	800,776,000	
	国庫債券 利付(40年)第1回	460,000,000	521,635,400	
	国庫債券 利付(40年)第2回	200,000,000	215,054,000	
	国庫債券 利付(40年)第3回	140,000,000	150,042,200	
	国庫債券 利付(40年)第4回	510,000,000	544,093,500	
	国庫債券 利付(10年)第254回	790,000,000	801,881,600	
	国庫債券 利付(10年)第255回	560,000,000	569,072,000	
	国庫債券 利付(10年)第256回	500,000,000	509,140,000	
	国庫債券 利付(10年)第257回	320,000,000	325,398,400	
	国庫債券 利付(10年)第258回	1,330,000,000	1,356,360,600	
	国庫債券 利付(10年)第259回	1,120,000,000	1,145,894,400	
	国庫債券 利付(10年)第260回	1,050,000,000	1,079,967,000	
	国庫債券 利付(10年)第261回	1,000,000,000	1,032,350,000	
	国庫債券 利付(10年)第262回	880,000,000	910,140,000	

国庫債券 利付(10年)第263回	900,000,000	929,079,000	
国庫債券 利付(10年)第264回	710,000,000	731,406,500	
国庫債券 利付(10年)第265回	1,280,000,000	1,323,046,400	
国庫債券 利付(10年)第266回	520,000,000	536,239,600	
国庫債券 利付(10年)第267回	550,000,000	565,851,000	
国庫債券 利付(10年)第269回	630,000,000	650,015,100	
国庫債券 利付(10年)第270回	670,000,000	693,302,600	
国庫債券 利付(10年)第271回	850,000,000	877,098,000	
国庫債券 利付(10年)第272回	320,000,000	333,097,600	
国庫債券 利付(10年)第273回	690,000,000	720,415,200	
国庫債券 利付(10年)第276回	100,000,000	105,094,000	
国庫債券 利付(10年)第277回	750,000,000	790,965,000	
国庫債券 利付(10年)第278回	550,000,000	584,045,000	
国庫債券 利付(10年)第279回	920,000,000	983,645,600	
国庫債券 利付(10年)第280回	350,000,000	374,370,500	
国庫債券 利付(10年)第281回	500,000,000	536,760,000	
国庫債券 利付(10年)第282回	1,500,000,000	1,598,070,000	
国庫債券 利付(10年)第283回	1,400,000,000	1,497,328,000	
国庫債券 利付(10年)第284回	1,900,000,000	2,029,846,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(10年)第285回	720,000,000	771,408,000	
	国庫債券 利付(10年)第286回	400,000,000	431,724,000	
	国庫債券 利付(10年)第287回	1,550,000,000	1,680,479,000	
	国庫債券 利付(10年)第288回	850,000,000	915,331,000	
	国庫債券 利付(10年)第289回	1,200,000,000	1,282,428,000	
	国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,331,262,500	
	国庫債券 利付(10年)第291回	1,200,000,000	1,271,316,000	
	国庫債券 利付(10年)第292回	400,000,000	432,700,000	
	国庫債券 利付(10年)第293回	450,000,000	490,455,000	
	国庫債券 利付(10年)第295回	2,000,000,000	2,144,880,000	
	国庫債券 利付(10年)第296回	1,100,000,000	1,181,246,000	
	国庫債券 利付(10年)第297回	700,000,000	748,412,000	
	国庫債券 利付(10年)第298回	1,300,000,000	1,381,289,000	
	国庫債券 利付(10年)第299回	700,000,000	744,457,000	
	国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,076,530,000	
	国庫債券 利付(10年)第301回	1,200,000,000	1,293,060,000	
	国庫債券 利付(10年)第302回	200,000,000	214,162,000	
	国庫債券 利付(10年)第303回	200,000,000	214,216,000	
	国庫債券 利付(10年)第304回	700,000,000	744,877,000	
	国庫債券 利付(10年)第305回	2,600,000,000	2,766,348,000	
	国庫債券 利付(10年)第306回	2,300,000,000	2,463,507,000	
	国庫債券 利付(10年)第308回	500,000,000	531,635,000	
	国庫債券 利付(10年)第309回	2,000,000,000	2,095,240,000	
	国庫債券 利付(10年)第310回	800,000,000	830,704,000	
	国庫債券 利付(10年)第311回	2,450,000,000	2,504,659,500	
	国庫債券 利付(10年)第312回	2,450,000,000	2,580,046,000	
	国庫債券 利付(10年)第313回	1,900,000,000	2,013,563,000	
	国庫債券 利付(10年)第314回	1,300,000,000	1,355,705,000	
	国庫債券 利付(10年)第315回	700,000,000	734,888,000	
	国庫債券 利付(10年)第316回	800,000,000	833,112,000	
	国庫債券 利付(10年)第317回	500,000,000	519,895,000	
	国庫債券 利付(10年)第318回	1,000,000,000	1,030,700,000	
	国庫債券 利付(10年)第319回	1,750,000,000	1,816,587,500	
	国庫債券 利付(10年)第320回	1,900,000,000	1,954,625,000	
	国庫債券 利付(10年)第321回	1,300,000,000	1,334,060,000	
	国庫債券 利付(10年)第322回	600,000,000	610,296,000	
	国庫債券 利付(10年)第323回	600,000,000	608,856,000	
	国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	121,044,000	
	国庫債券 利付(30年)第2回	100,000,000	114,672,000	
	国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	181,054,400	
	国庫債券 利付(30年)第4回	120,000,000	147,109,200	
	国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	166,881,000	
	国庫債券 利付(30年)第6回	130,000,000	148,866,900	
	国庫債券 利付(30年)第7回	155,000,000	174,745,450	
	国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	103,864,000	
	国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	62,951,200	
	国庫債券 利付(30年)第10回	150,000,000	137,079,000	
	国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	163,016,000	
	国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	239,659,200	

国庫債券 利付(30年)第13回	190,000,000	203,415,900	
国庫債券 利付(30年)第14回	180,000,000	205,806,600	
国庫債券 利付(30年)第15回	150,000,000	174,301,500	
国庫債券 利付(30年)第16回	215,000,000	249,718,200	
国庫債券 利付(30年)第17回	200,000,000	228,654,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	280,000,000	314,944,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	200,000,000	224,786,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	290,000,000	337,235,200	
国庫債券 利付(30年)第21回	270,000,000	303,477,300	
国庫債券 利付(30年)第22回	200,000,000	232,482,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	340,000,000	394,961,000	
国庫債券 利付(30年)第24回	300,000,000	348,867,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	490,000,000	550,206,300	
国庫債券 利付(30年)第26回	450,000,000	514,102,500	
国庫債券 利付(30年)第27回	650,000,000	755,612,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	600,000,000	698,214,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	700,000,000	800,310,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	600,000,000	672,822,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	500,000,000	549,510,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	870,000,000	975,531,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	1,140,000,000	1,200,545,400	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(30年)第34回	800,000,000	878,760,000	
	国庫債券 利付(30年)第35回	1,200,000,000	1,261,572,000	
	国庫債券 利付(30年)第36回	300,000,000	315,255,000	
	国庫債券 利付(20年)第23回	200,000,000	212,500,000	
	国庫債券 利付(20年)第24回	550,000,000	591,794,500	
	国庫債券 利付(20年)第25回	13,000,000	13,859,040	
	国庫債券 利付(20年)第26回	100,000,000	109,490,000	
	国庫債券 利付(20年)第27回	60,000,000	66,342,000	
	国庫債券 利付(20年)第28回	29,000,000	32,762,460	
	国庫債券 利付(20年)第29回	310,000,000	350,055,100	
	国庫債券 利付(20年)第30回	10,000,000	11,136,300	
	国庫債券 利付(20年)第31回	110,000,000	123,629,000	
	国庫債券 利付(20年)第32回	41,000,000	46,378,790	
	国庫債券 利付(20年)第33回	1,410,000,000	1,625,053,200	
	国庫債券 利付(20年)第34回	190,000,000	219,522,200	
	国庫債券 利付(20年)第35回	228,000,000	261,317,640	
	国庫債券 利付(20年)第36回	380,000,000	434,663,000	
	国庫債券 利付(20年)第37回	320,000,000	367,667,200	
	国庫債券 利付(20年)第38回	170,000,000	193,439,600	
	国庫債券 利付(20年)第39回	511,000,000	578,763,710	
	国庫債券 利付(20年)第40回	525,000,000	589,564,500	
	国庫債券 利付(20年)第41回	255,000,000	274,158,150	
	国庫債券 利付(20年)第42回	283,000,000	325,042,480	
	国庫債券 利付(20年)第43回	400,000,000	470,904,000	
	国庫債券 利付(20年)第44回	150,000,000	173,202,000	
	国庫債券 利付(20年)第45回	242,000,000	277,636,920	
	国庫債券 利付(20年)第46回	90,000,000	101,994,300	
	国庫債券 利付(20年)第47回	130,000,000	147,618,900	
	国庫債券 利付(20年)第48回	200,000,000	232,192,000	
	国庫債券 利付(20年)第49回	200,000,000	225,626,000	
	国庫債券 利付(20年)第50回	183,000,000	203,252,610	
	国庫債券 利付(20年)第51回	310,000,000	346,704,000	
	国庫債券 利付(20年)第52回	100,000,000	112,830,000	
	国庫債券 利付(20年)第53回	250,000,000	282,387,500	
	国庫債券 利付(20年)第54回	250,000,000	284,607,500	
	国庫債券 利付(20年)第55回	231,000,000	258,750,030	
	国庫債券 利付(20年)第56回	120,000,000	134,451,600	
	国庫債券 利付(20年)第57回	210,000,000	233,236,500	
	国庫債券 利付(20年)第58回	180,000,000	199,917,000	
	国庫債券 利付(20年)第59回	230,000,000	250,851,800	
	国庫債券 利付(20年)第60回	380,000,000	403,066,000	
	国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	305,589,000	
	国庫債券 利付(20年)第62回	340,000,000	338,300,000	
	国庫債券 利付(20年)第63回	400,000,000	439,684,000	
	国庫債券 利付(20年)第64回	300,000,000	332,613,000	
	国庫債券 利付(20年)第65回	255,000,000	282,550,200	
	国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	328,953,000	
	国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	343,061,500	
	国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	330,637,700	

国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	632,217,600	
国庫債券 利付(20年)第70回	340,000,000	395,270,400	
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	227,960,000	
国庫債券 利付(20年)第72回	570,000,000	642,846,000	
国庫債券 利付(20年)第73回	350,000,000	390,572,000	
国庫債券 利付(20年)第74回	320,000,000	360,844,800	
国庫債券 利付(20年)第75回	500,000,000	563,360,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	430,000,000	474,268,500	
国庫債券 利付(20年)第77回	320,000,000	356,745,600	
国庫債券 利付(20年)第78回	310,000,000	341,502,200	
国庫債券 利付(20年)第79回	360,000,000	400,921,200	
国庫債券 利付(20年)第80回	320,000,000	360,236,800	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	400,464,000	
国庫債券 利付(20年)第82回	420,000,000	472,348,800	
国庫債券 利付(20年)第83回	370,000,000	415,661,700	
国庫債券 利付(20年)第84回	390,000,000	433,290,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	200,000,000	224,408,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	450,000,000	516,249,000	
国庫債券 利付(20年)第87回	490,000,000	555,635,500	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	532,679,200	
国庫債券 利付(20年)第90回	510,000,000	577,661,700	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	286,400,000	
	国庫債券 利付(20年)第92回	650,000,000	726,771,500	
	国庫債券 利付(20年)第93回	100,000,000	110,383,000	
	国庫債券 利付(20年)第95回	500,000,000	571,350,000	
	国庫債券 利付(20年)第97回	450,000,000	507,388,500	
	国庫債券 利付(20年)第98回	500,000,000	556,645,000	
	国庫債券 利付(20年)第99回	800,000,000	889,576,000	
	国庫債券 利付(20年)第100回	520,000,000	585,057,200	
	国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	288,395,000	
	国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	576,675,000	
	国庫債券 利付(20年)第104回	100,000,000	111,057,000	
	国庫債券 利付(20年)第105回	300,000,000	332,937,000	
	国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	449,572,000	
	国庫債券 利付(20年)第107回	600,000,000	664,908,000	
	国庫債券 利付(20年)第108回	700,000,000	755,265,000	
	国庫債券 利付(20年)第109回	700,000,000	753,886,000	
	国庫債券 利付(20年)第110回	700,000,000	774,543,000	
	国庫債券 利付(20年)第111回	500,000,000	560,430,000	
	国庫債券 利付(20年)第112回	700,000,000	773,864,000	
	国庫債券 利付(20年)第113回	700,000,000	772,597,000	
	国庫債券 利付(20年)第114回	600,000,000	661,098,000	
	国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	558,720,000	
	国庫債券 利付(20年)第116回	300,000,000	334,920,000	
	国庫債券 利付(20年)第117回	300,000,000	330,192,000	
	国庫債券 利付(20年)第118回	200,000,000	216,714,000	
	国庫債券 利付(20年)第119回	300,000,000	315,597,000	
	国庫債券 利付(20年)第120回	300,000,000	306,177,000	
	国庫債券 利付(20年)第121回	900,000,000	959,589,000	
	国庫債券 利付(20年)第122回	800,000,000	840,240,000	
	国庫債券 利付(20年)第123回	700,000,000	767,221,000	
	国庫債券 利付(20年)第124回	600,000,000	648,414,000	
	国庫債券 利付(20年)第125回	600,000,000	667,050,000	
	国庫債券 利付(20年)第126回	400,000,000	431,668,000	
	国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	531,475,000	
	国庫債券 利付(20年)第128回	400,000,000	424,816,000	
	国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	522,860,000	
	国庫債券 利付(20年)第130回	500,000,000	522,320,000	
	国庫債券 利付(20年)第132回	900,000,000	923,580,000	
	国庫債券 利付(20年)第133回	700,000,000	729,918,000	
	国庫債券 利付(20年)第134回	400,000,000	416,632,000	
	国庫債券 利付(20年)第136回	100,000,000	100,753,000	
	国庫債券 利付(20年)第137回	400,000,000	409,748,000	
国債証券計	銘柄数：245	160,751,000,000	170,268,188,080	
	組入時価比率：75.4%		76.6%	
地方債証券	東京都 公募第601回	121,400,000	123,471,084	
	東京都 公募第609回	100,000,000	102,277,000	
	東京都 公募第611回	400,000,000	412,848,000	
	東京都 公募第618回	100,000,000	103,117,000	

東京都 公募第622回	300,000,000	309,837,000	
東京都 公募第644回	60,000,000	64,332,000	
東京都 公募第660回	100,000,000	107,411,000	
東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	112,421,000	
東京都 公募第10回	200,000,000	216,248,000	
東京都 公募第1回	300,000,000	319,083,000	
東京都 公募第7回	100,000,000	112,126,000	
北海道 公募平成16年度第6回	100,000,000	103,079,000	
北海道 公募平成18年度第6回	100,000,000	107,491,000	
北海道 公募平成19年度第4回	100,000,000	108,103,000	
北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	107,473,000	
北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	106,791,000	
神奈川県 公募第127回	100,000,000	103,314,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	114,475,000	
神奈川県 公募第7回	200,000,000	224,184,000	
神奈川県 公募第30回	100,000,000	101,120,000	
大阪府 公募第262回	100,000,000	101,783,000	
大阪府 公募第285回	150,000,000	156,486,000	
大阪府 公募第291回	100,000,000	106,873,000	
大阪府 公募第303回	300,000,000	323,724,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	212,788,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	104,509,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債証券	大阪府 公募第41回	100,000,000	101,147,000	
	京都府 公募平成18年度第1回	160,000,000	170,524,800	
	兵庫県 公募平成16年度第13回	100,000,000	102,792,000	
	兵庫県 公募平成21年度第13回	100,000,000	106,764,000	
	兵庫県 公募第2回	100,000,000	112,980,000	
	兵庫県 公募第9回	100,000,000	110,231,000	
	静岡県 公募平成16年度第1回	110,000,000	113,049,200	
	静岡県 公募平成19年度第4回	200,000,000	217,042,000	
	静岡県 公募平成21年度第7回	100,000,000	107,678,000	
	静岡県 公募(20年)第11回	100,000,000	104,124,000	
	愛知県 公募平成19年度第3回	111,000,000	120,125,310	
	愛知県 公募平成20年度第8回	100,000,000	108,464,000	
	愛知県 公募平成21年度第3回	114,000,000	123,566,880	
	愛知県 公募平成21年度第17回	100,000,000	106,704,000	
	愛知県 公募平成22年度第3回	100,000,000	106,328,000	
	広島県 公募平成22年度第6回	200,000,000	210,270,000	
	埼玉県 公募平成19年度第7回	200,000,000	215,010,000	
	埼玉県 公募平成21年度第5回	100,000,000	106,751,000	
	埼玉県 公募平成22年度第2回	200,000,000	212,738,000	
	福岡県 公募平成18年度第1回	200,000,000	215,674,000	
	福岡県 公募平成19年度第6回	100,000,000	107,475,000	
	福岡県 公募平成20年度第3回	100,000,000	107,407,000	
	千葉県 公募平成20年度第6回	100,000,000	107,909,000	
	千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	192,200,400	
	千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	109,764,000	
	新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	161,518,500	
	共同発行市場地方債 公募第13回	300,700,000	307,790,506	
	共同発行市場地方債 公募第17回	100,000,000	103,430,000	
	共同発行市場地方債 公募第20回	100,000,000	103,126,000	
	共同発行市場地方債 公募第22回	100,000,000	103,089,000	
	共同発行市場地方債 公募第26回	300,000,000	309,690,000	
	共同発行市場地方債 公募第27回	100,000,000	103,326,000	
	共同発行市場地方債 公募第28回	129,500,000	133,923,720	
	共同発行市場地方債 公募第31回	200,000,000	208,690,000	
	共同発行市場地方債 公募第32回	100,000,000	104,798,000	
	共同発行市場地方債 公募第34回	100,000,000	104,318,000	
	共同発行市場地方債 公募第35回	100,000,000	105,139,000	
	共同発行市場地方債 公募第56回	400,000,000	430,576,000	
	共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	108,211,000	
	共同発行市場地方債 公募第64回	100,000,000	108,582,000	
	共同発行市場地方債 公募第82回	300,000,000	320,334,000	
	共同発行市場地方債 公募第84回	500,000,000	532,325,000	
	共同発行市場地方債 公募第85回	300,000,000	320,823,000	
	共同発行市場地方債 公募第88回	100,000,000	104,757,000	
	共同発行市場地方債 公募第93回	300,000,000	315,525,000	
	熊本県 公募平成18年度第2回	173,000,000	184,642,900	
	静岡市 公募平成17年度第1回	100,000,000	104,728,000	
	大阪市 公募平成17年度第4回	100,000,000	103,567,000	
	大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	107,281,000	

大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	105,792,000	
大阪市 公募（20年）第5回	100,000,000	113,696,000	
大阪市 公募（20年）第6回	100,000,000	109,854,000	
名古屋市 公募第460回	100,000,000	107,577,000	
名古屋市 公募第464回	100,000,000	107,674,000	
名古屋市 公募第12回ゆ号	200,000,000	204,148,000	
名古屋市 公募第12回ひ号	100,000,000	103,406,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	203,600,200	
神戸市 公募平成17年度13回	100,000,000	105,018,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	108,356,000	
横浜市 公募公債平成17年度1回	200,000,000	206,052,000	
横浜市 公募公債平成17年度2回	205,000,000	212,037,650	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	212,642,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	105,314,000	
札幌市 公募平成19年度第3回	100,000,000	107,675,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	103,831,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	107,429,000	
北九州市 公募平成18年度第2回	170,000,000	181,680,700	
福岡市 公募平成15年度第6回	175,000,000	178,137,750	
福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	106,876,000	
広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	105,982,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債証券	さいたま市 公募第3回	100,000,000	104,491,000	
	鹿児島県 公募平成18年度第1回	178,200,000	190,980,504	
	山梨県 公募平成19年度第1回	200,000,000	216,496,000	
	岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	106,474,000	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	110,841,000	
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	109,716,000	
	東京都住宅供給公社債券 第4回	300,000,000	319,776,000	
	東京都住宅供給公社債券 第5回	200,000,000	215,266,000	
地方債証券計	銘柄数：104	15,377,800,000	16,323,092,104	
	組入時価比率：7.2%		7.3%	
特殊債券	日本政策投資銀行債券 政府保証第18回	100,000,000	108,348,000	
	日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	100,000,000	106,690,000	
	日本政策投資銀行債券 財投機関債第9回	100,000,000	101,562,000	
	日本政策投資銀行債券 財投機関債第29回	200,000,000	213,794,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第319回	101,000,000	101,835,270	
	道路債券 政府保証第322回	100,000,000	101,838,000	
	道路債券 政府保証第332回	100,000,000	102,964,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第336回	500,000,000	515,855,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第338回	200,000,000	207,274,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第344回	200,000,000	216,646,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第345回	101,000,000	104,223,920	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第346回	300,000,000	311,670,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第3回	100,000,000	104,739,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第4回	100,000,000	110,192,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第6回	200,000,000	209,546,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第8回	200,000,000	227,208,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第23回	200,000,000	224,404,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第33回	200,000,000	219,980,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第38回	100,000,000	108,560,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証債第1回	115,000,000	120,321,050	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3回	200,000,000	209,512,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回	100,000,000	105,218,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回	100,000,000	110,684,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回	100,000,000	110,683,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第14回	180,000,000	192,285,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第42回	100,000,000	108,108,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第58回	136,000,000	147,048,640	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第60回	139,000,000	151,216,710	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第67回	200,000,000	215,632,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	218,696,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第98回	300,000,000	318,228,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第100回	400,000,000	427,168,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	218,226,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	211,508,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	105,634,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	116,610,000	
公営企業債券 政府保証第836回	115,000,000	117,137,850	
公営企業債券 政府保証第839回	404,000,000	414,095,960	
公営企業債券 政府保証第846回	134,000,000	138,078,960	
公営企業債券 政府保証第847回	200,000,000	206,336,000	
公営企業債券 政府保証第852回	200,000,000	206,768,000	
公営企業債券 政府保証第855回	100,000,000	103,638,000	
公営企業債券 政府保証第856回	355,000,000	370,627,100	
公営企業債券 政府保証第857回	200,000,000	209,752,000	
公営企業債券 政府保証第858回	200,000,000	209,290,000	
公営企業債券 政府保証第864回	135,000,000	144,185,400	
公営企業債券 政府保証第886回	103,000,000	112,011,470	
公営企業債券 政府保証15年第1回	300,000,000	324,903,000	
地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	108,026,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第 5回	200,000,000	210,744,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4 回	100,000,000	108,336,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6 回	300,000,000	330,423,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	107,385,000	
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	104,281,000	

	公営企業債券 20年第2回財投機関債	100,000,000	105,238,000	
	公営企業債券 第24回財投機関債	100,000,000	107,433,000	
	首都高速道路債券 政府保証第189回	100,000,000	101,817,000	
	首都高速道路債券 政府保証第193回	100,000,000	102,953,000	
	首都高速道路債券 政府保証第198回	101,000,000	104,407,740	
	阪神高速道路債券 政府保証第146回	101,000,000	104,318,860	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊債券	中小企業債券 政府保証第186回	100,000,000	103,628,000	
	国際協力銀行債券 第21回財投機関債	100,000,000	104,241,000	
	国際協力銀行債券 第27回財投機関債	200,000,000	213,700,000	
	都市再生債券 財投機関債第21回	200,000,000	215,054,000	
	本州四国連絡橋債券 政府保証第23回	100,000,000	102,082,000	
	本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	111,916,000	
	東京交通債券 第342回	200,000,000	228,270,000	
	東京交通債券 第347回	157,000,000	173,364,110	
	関西国際空港債券 財投機関債第3回	200,000,000	207,244,000	
	住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	200,000,000	216,536,000	
	住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	104,411,000	
	住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	105,830,000	
	国民生活債券 政府保証第17回	200,000,000	210,548,000	
	商工債券 利付第709回い号	100,000,000	101,890,000	
	農林債券 利付第700回い号	100,000,000	101,363,000	
	農林債券 利付第704回い号	100,000,000	101,594,000	
	農林債券 利付第706回い号	100,000,000	101,846,000	
	農林債券 利付第708回い号	100,000,000	101,659,000	
	農林債券 利付第715回い号	400,000,000	404,308,000	
	農林債券 利付第719回い号	100,000,000	101,223,000	
	農林債券 利付第729回い号	100,000,000	101,750,000	
	しんきん中金債券 利付第227回	100,000,000	101,470,000	
	しんきん中金債券 利付第234回	300,000,000	305,088,000	
	しんきん中金債券 利付第240回	100,000,000	101,570,000	
	しんきん中金債券 利付第243回	100,000,000	101,205,000	
	しんきん中金債券 利付第245回	100,000,000	101,279,000	
	しんきん中金債券 利付第246回	100,000,000	101,175,000	
	商工債券 利付(10年)第5回	500,000,000	538,270,000	
	韓国ガス公社 第6回円貨債券(支配権変更プットオプション条項付)	100,000,000	100,200,000	
	国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	107,271,000	
	東日本高速道路債券 政府保証第2回	120,000,000	125,512,800	
	中日本高速道路債券 政府保証第2回	100,000,000	104,598,000	
	中日本高速道路債券 政府保証第13回	138,000,000	147,796,620	
	中日本高速道路債券 財投機関債第3回	100,000,000	107,972,000	
	西日本高速道路債券 政府保証第1回	215,000,000	225,427,500	
	西日本高速道路債券 政府保証第2回	176,000,000	188,108,800	
	西日本高速道路債券 政府保証第3回	151,000,000	161,544,330	
	西日本高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	107,099,000	
	緑資源債券 財投機関債第3回	200,000,000	206,028,000	
	緑資源債券 財投機関債第4回	100,000,000	104,096,000	
	貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	26,746,000	28,031,680	
	貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	113,832,000	118,435,366	
	貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	203,480,000	212,811,592	
	貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	95,433,000	98,273,086	
	貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	105,984,000	110,993,863	

	貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	112,370,000	120,979,789	
	貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	37,409,000	40,073,268	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	114,898,000	120,359,101	
	貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	58,083,000	61,109,124	
	貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	115,686,000	120,379,381	
	貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	237,808,000	247,403,552	
	貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	214,230,000	227,385,864	
	貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	212,992,000	228,659,691	
	貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	123,604,000	130,528,296	
	貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	63,034,000	67,080,152	
	貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	70,835,000	75,988,246	
	貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	232,791,000	245,745,819	
	貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	193,071,000	202,272,763	
	貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	184,876,000	189,520,085	
	貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	132,648,000	139,608,040	
	貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	279,882,000	294,595,396	
	貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	144,900,000	156,009,483	
	貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	188,288,000	199,566,451	
	貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	182,162,000	185,890,856	
特殊債券計	銘柄数：124	19,422,042,000	20,506,163,034	
	組入時価比率：9.1%		9.2%	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク 第12回円貨社債	100,000,000	100,342,000	
	GEキャピタルコーポレーション 第12回円貨社債	100,000,000	102,407,000	
	JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー 第7回円貨社債	100,000,000	101,742,000	
	エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	100,000,000	98,284,000	
	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク 第7回円貨社債	100,000,000	100,965,000	
	シティグループ・インク 第22回円貨社債	100,000,000	102,042,000	
	バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション 第6回円貨社債	200,000,000	199,312,000	
	クレディ・スイス・グループAG保証第2回クレディ・スイス円貨	100,000,000	101,956,000	
	パークレイズ・バンク・ピーエルシー 第4回円貨社債	100,000,000	99,900,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行 第6回円貨社債(2011)	100,000,000	101,020,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポレーション 第5回円貨社債	200,000,000	202,704,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行 第5回円貨社債	100,000,000	101,269,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク 第4回円貨社債	100,000,000	101,176,000	
	キリンホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,695,000	
	キリンホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,381,000	
	キッコーマン 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,776,000	
	ニチレイ 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,849,000	
	日本たばこ産業 第5回	100,000,000	101,635,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人 第1回特定投資法人債	100,000,000	102,292,000	
	セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,452,000	
	住友化学 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,982,000	
	三菱化学 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,951,000	
	三井化学 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,160,000	
	JXホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,311,000	
	新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,210,000	
	新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,260,000	

	ジェイ エフ イー ホールディングス 第16回（JFEス保証）	100,000,000	102,340,000	
	豊田自動織機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,426,000	
	東芝 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,201,000	
	日本電気 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,934,000	
	パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,550,000	
	パナソニック 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,312,000	
	ソニー 第26回	100,000,000	106,979,000	
	デンソー 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,246,000	
	日本生命2010基金特定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	100,413,000	
	日産自動車 第47回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,026,000	
	伊藤忠商事 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,036,000	
	丸紅 第72回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,253,000	
	三井物産 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,532,000	
	三井物産 第58回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,989,000	
	住友商事 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,057,000	
	三菱商事 第53回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,775,000	
	三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	108,474,000	
	三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	107,438,000	
	クレディセゾン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,849,000	
	みずほコーポレート銀行 第2回劣後特約付	100,000,000	103,177,000	
	みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,829,000	
	みずほコーポレート銀行 第14回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,548,000	
	三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,542,000	
	三菱東京UFJ銀行 第106回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,716,000	
	三菱東京UFJ銀行 第116回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,572,000	
	三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,809,000	
	三菱東京UFJ銀行 第11回（劣後特約付）	100,000,000	107,417,000	
	りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,947,000	

広島銀行 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,434,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	104,862,000	
住友信託銀行 第5回劣後特約付	100,000,000	105,981,000	
みずほ信託銀行 第1回劣後特約付	100,000,000	104,232,000	
中央三井信託銀行 第3回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,594,000	
セブン銀行 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,978,000	
三井住友銀行 第48回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,392,000	
三井住友銀行 第52回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,252,000	
三井住友銀行 第8回劣後特約付	100,000,000	103,350,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	104,134,000	
みずほ銀行 第6回劣後特約付	200,000,000	213,088,000	
トヨタファイナンス 第27回社債間限定同等特約付	200,000,000	213,864,000	
オリックス 第144回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,272,000	
三菱UFJリース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,908,000	
野村ホールディングス 第6回	100,000,000	104,181,000	
野村ホールディングス 第15回	100,000,000	102,423,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	103,593,000	
第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	106,814,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	三井住友海上火災保険 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,368,000	
	三井不動産 第23回社債間限定同順位特約付	300,000,000	308,880,000	
	三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	114,000,000	
	三菱地所 第71回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,265,000	
	住友不動産 第73回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,994,000	
	東京急行電鉄 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,283,000	
	京成電鉄 第42回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,449,000	
	東日本旅客鉄道 第2回	100,000,000	112,039,000	
	東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	115,656,000	
	東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,661,000	
	東日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,195,000	
	西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,052,000	
	東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,325,000	
	東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	218,288,000	
	日本郵船 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,179,000	
	日本電信電話 第51回	300,000,000	321,066,000	
	KDDI 第5回2号	100,000,000	113,370,000	
	NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,070,000	
	東京電力 第426回	200,000,000	202,864,000	
	東京電力 第428回	300,000,000	297,561,000	
	東京電力 第459回	100,000,000	87,705,000	
	東京電力 第511回	100,000,000	95,255,000	
	東京電力 第560回	100,000,000	67,291,000	
	東京電力 第565回	300,000,000	226,854,000	
	中部電力 第406回	200,000,000	218,748,000	
	中部電力 第467回	100,000,000	102,499,000	
	中部電力 第482回	200,000,000	217,994,000	
	関西電力 第439回	100,000,000	102,263,000	
	関西電力 第441回	200,000,000	204,616,000	
	関西電力 第448回	200,000,000	213,678,000	
	中国電力 第330回	100,000,000	108,655,000	
	北陸電力 第245回	200,000,000	219,036,000	
	北陸電力 第248回	100,000,000	112,828,000	
	東北電力 第431回	400,000,000	427,136,000	
	九州電力 第389回	200,000,000	211,106,000	
	九州電力 第395回	100,000,000	102,159,000	

	九州電力 第409回	100,000,000	104,092,000	
	北海道電力 第285回	100,000,000	104,283,000	
	電源開発 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,212,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,843,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,806,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,803,000	
	NTTデ-タ 第24回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,430,000	
社債券計	銘柄数：115	14,800,000,000	15,329,669,000	
	組入時価比率：6.8%		6.9%	
合計			222,427,112,218	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年8月31日現在

資産総額	7,337,598,708	円
負債総額	1,901,056	円
純資産総額(-)	7,335,697,652	円
発行済口数	7,107,940,868	口
1口当たり純資産額(/)	1.0320	円

<ご参考>

「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」

資産総額	229,333,898,637	円
負債総額	4,653,284,947	円
純資産総額(-)	224,680,613,690	円
発行済口数	191,052,579,536	口
1口当たり純資産額(/)	1.1760	円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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】

(1)資本金の額

平成24年8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執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

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。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

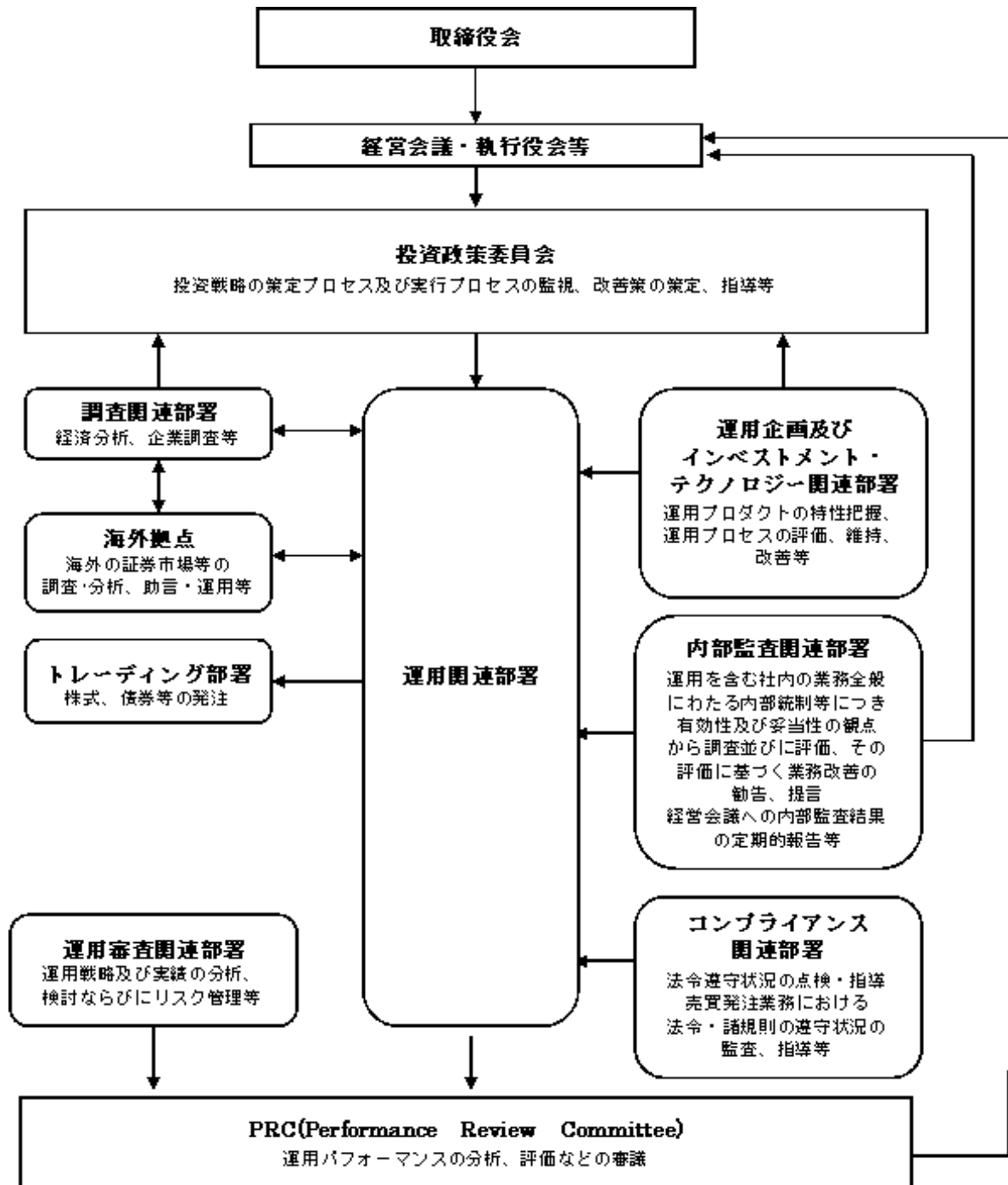
代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行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、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会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会で選定された執行役員が含まれます。

委員会

取締役3名以上(但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者)で構成され、イ)指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ)報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ)監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに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】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は平成24年7月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	753	9,489,695
単位型株式投資信託	41	210,370
追加型公社債投資信託	18	4,586,319
単位型公社債投資信託	1	17,656
合計	813	14,304,040

3 【委託会社等の経理状況】

- 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 . 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(平成23年4月1日から平成24年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度	(平成23年	当事業年度	(平成24年
		3月31日)		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			538		240
金銭の信託			39,575		50,326
有価証券			1,400		1,800
短期貸付金			166		153
前払金			0		-
前払費用			41		37
未収入金			171		217
未収委託者報酬			10,032		8,149
未収収益			3,761		4,200
繰延税金資産			1,736		1,402
その他			12		14
貸倒引当金			6		6
流動資産計			57,430		66,535
固定資産					
有形固定資産			1,823		1,677
建物	2	576		516	
器具備品	2	1,246		1,161	
無形固定資産			10,649		9,754
ソフトウェア		10,647		9,753	
電話加入権		1		1	
その他		0		0	
投資その他の資産			32,430		21,505
投資有価証券		8,648		6,691	
関係会社株式		22,609		14,429	
従業員長期貸付金		235		29	
長期差入保証金		64		57	
長期前払費用		24		23	
繰延税金資産		582		-	
その他		265		273	
貸倒引当金		0		0	
固定資産計			44,903		32,937
資産合計			102,333		99,472

		前事業年度 (平成23年 3月31日)		当事業年度 (平成24年 3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
関係会社短期借入金			8,000		8,500
預り金			87		93
未払金	1		7,645		6,276
未払収益分配金		4		4	
未払償還金		79		50	
未払手数料		4,517		3,610	
その他未払金		3,043		2,610	
未払費用	1		7,373		6,760
未払法人税等			800		856
前受収益			9		6
賞与引当金			2,900		2,816
流動負債計			26,818		25,310
固定負債					
退職給付引当金			4,064		2,437
時効後支払損引当金			481		489
繰延税金負債			-		7
その他			65		-
固定負債計			4,611		2,934
負債合計			31,429		28,244
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			68,279		68,521
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			11,729		11,729
資本準備金		11,729		11,729	
利益剰余金			39,369		39,611
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		38,684		38,926	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		14,077		14,320	
評価・換算差額等			2,624		2,705
その他有価証券評価差額金			2,694		2,693
繰延ヘッジ損益			69		12
純資産合計			70,903		71,227
負債・純資産合計			102,333		99,472

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)		当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			81,230		78,412
運用受託報酬			13,165		17,784
その他営業収益			143		129
営業収益計			94,539		96,325
営業費用					
支払手数料			39,741		40,671
広告宣伝費			1,155		952
公告費			-		0
受益証券発行費			6		5
調査費			20,709		19,308
調査費		1,310		1,108	
委託調査費		19,398		18,200	
委託計算費			917		931
営業雑経費			2,451		2,523
通信費		207		213	
印刷費		1,148		1,085	
協会費		73		76	
諸経費		1,022		1,147	
営業費用計			64,980		64,393
一般管理費					
給料			10,131		9,635
役員報酬	2	322		252	
給料・手当		6,822		6,602	
賞与		2,987		2,780	
交際費			141		140
旅費交通費			484		473
租税公課			231		224
不動産賃借料			1,452		1,309
退職給付費用			1,054		1,039
固定資産減価償却費			4,575		4,354
諸経費			6,106		6,204
一般管理費計			24,176		23,381
営業利益			5,382		8,550

		前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)		当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,771		4,116	
収益分配金		9		9	
受取利息		6		3	
金銭の信託運用益		1,222		377	
為替差益		62		55	
その他		319		360	
営業外収益計			6,391		4,924
営業外費用					
支払利息	1	75		54	
時効後支払損引当金繰入額		13		38	
その他		9		11	
営業外費用計			98		104
経常利益			11,676		13,370
特別利益					
投資有価証券等売却益		419		36	
株式報酬受入益		173		177	
特別利益計			593		214
特別損失					
投資有価証券売却損		149		136	
投資有価証券等評価損		10		1	
固定資産除却損	3	412		82	
システム利用契約解約違約金		20		-	
特別損失計			591		221
税引前当期純利益			11,677		13,363
法人税、住民税及び事業税			3,759		3,625
法人税等調整額			108		1,228
当期純利益			7,810		8,509

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,180	17,180
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	17,180	17,180
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	11,729	11,729
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,729	11,729
資本剰余金合計		
当期首残高	11,729	11,729
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,729	11,729
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	685	685
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	685	685
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	24,606	24,606
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	24,606	24,606
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,872	14,077
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	8,267
当期純利益	7,810	8,509
当期変動額合計	4,204	242
当期末残高	14,077	14,320
利益剰余金合計		
当期首残高	35,164	39,369
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	8,267
当期純利益	7,810	8,509
当期変動額合計	4,204	242
当期末残高	39,369	39,611

株主資本合計		
当期首残高	64,074	68,279
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	8,267
当期純利益	7,810	8,509
当期変動額合計	4,204	242
当期末残高	68,279	68,521
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	3,056	2,694
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	361	0
当期変動額合計	361	0
当期末残高	2,694	2,693
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	175	69
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	245	82
当期変動額合計	245	82
当期末残高	69	12
評価・換算差額等合計		
当期首残高	3,231	2,624
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	607	81
当期変動額合計	607	81
当期末残高	2,624	2,705
純資産合計		
当期首残高	67,306	70,903
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	8,267
当期純利益	7,810	8,509
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	607	81
当期変動額合計	3,597	324
当期末残高	70,903	71,227

[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 ... 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="767 824 1066 954"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。</p>	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								
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>								
6. リース取引の処理方法	リース取引開始日が平成20年4月1日より前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。								

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

[追加情報]

当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用) 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「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 平成21年12月 4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月 4日)を適用しております。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (平成23年 3月31日)	当事業年度末 (平成24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。 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">2,442百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">762</td> </tr> </table>	未払金	2,442百万円	未払費用	762	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。 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">2,320百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,267</td> </tr> </table>	未払金	2,320百万円	未払費用	1,267				
未払金	2,442百万円												
未払費用	762												
未払金	2,320百万円												
未払費用	1,267												
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">437百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,874</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,311</td> </tr> </table>	建物	437百万円	器具備品	1,874	合計	2,311	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">477百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,303</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,780</td> </tr> </table>	建物	477百万円	器具備品	2,303	合計	2,780
建物	437百万円												
器具備品	1,874												
合計	2,311												
建物	477百万円												
器具備品	2,303												
合計	2,780												

損益計算書関係

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,633百万円 支払利息 75	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 3,776百万円 支払利息 54
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損 ソフトウェア 412百万円	3. 固定資産除却損 建物 19百万円 器具備品 9 ソフトウェア 53
合計 412	合計 82

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	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) 配当金支払額

平成22年 5月27日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 3,605百万円

1株当たり配当額 700円

基準日 平成22年 3月31日

効力発生日 平成22年 6月 1日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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) 配当金支払額

平成23年 7 月11日開催の臨時株主総会において、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

配当財産の種類 野村ホールディングス株式会社株式

配当財産の帳簿価額 8,267百万円

1株当たり配当額 1,605円12銭

基準日 平成23年 7 月19日

効力発生日 平成23年 7 月20日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成24年 5 月16日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 3,090百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 600円

基準日 平成24年 3 月31日

効力発生日 平成24年 6 月 1 日

リース取引関係

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)																																																																								
<p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) 該当事項はありません。</p> <p>(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">器具備品</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">417百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">325</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">91</td> </tr> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">未経過リース料期末残高相当額</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">73 百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">リース資産減損勘定期末残高</td> <td style="text-align: right;">- 百万円</td> </tr> </table> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">支払リース料</td> <td style="text-align: right;">103百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">3</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については利息法によっております。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">6百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">4</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">10</td> </tr> </table>	器具備品		取得価額相当額	417百万円	減価償却累計額相当額	325	減損損失累計額相当額	-	期末残高相当額	91	未経過リース料期末残高相当額		1年以内	73 百万円	1年超	22	合計	96	リース資産減損勘定期末残高	- 百万円	支払リース料	103百万円	リース資産減損勘定の取崩額	-	減価償却費相当額	96	支払利息相当額	3	減損損失	-	1年以内	6百万円	1年超	4	合計	10	<p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) (同左)</p> <p>(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">器具備品</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">184百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">163</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">21</td> </tr> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">未経過リース料期末残高相当額</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">22 百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">リース資産減損勘定期末残高</td> <td style="text-align: right;">- 百万円</td> </tr> </table> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">支払リース料</td> <td style="text-align: right;">75百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">70</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">1</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 (同左)</p> <p>利息相当額の算定方法 (同左)</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">15百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">24</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">40</td> </tr> </table>	器具備品		取得価額相当額	184百万円	減価償却累計額相当額	163	減損損失累計額相当額	-	期末残高相当額	21	未経過リース料期末残高相当額		1年以内	22 百万円	1年超	-	合計	22	リース資産減損勘定期末残高	- 百万円	支払リース料	75百万円	リース資産減損勘定の取崩額	-	減価償却費相当額	70	支払利息相当額	1	減損損失	-	1年以内	15百万円	1年超	24	合計	40
器具備品																																																																									
取得価額相当額	417百万円																																																																								
減価償却累計額相当額	325																																																																								
減損損失累計額相当額	-																																																																								
期末残高相当額	91																																																																								
未経過リース料期末残高相当額																																																																									
1年以内	73 百万円																																																																								
1年超	22																																																																								
合計	96																																																																								
リース資産減損勘定期末残高	- 百万円																																																																								
支払リース料	103百万円																																																																								
リース資産減損勘定の取崩額	-																																																																								
減価償却費相当額	96																																																																								
支払利息相当額	3																																																																								
減損損失	-																																																																								
1年以内	6百万円																																																																								
1年超	4																																																																								
合計	10																																																																								
器具備品																																																																									
取得価額相当額	184百万円																																																																								
減価償却累計額相当額	163																																																																								
減損損失累計額相当額	-																																																																								
期末残高相当額	21																																																																								
未経過リース料期末残高相当額																																																																									
1年以内	22 百万円																																																																								
1年超	-																																																																								
合計	22																																																																								
リース資産減損勘定期末残高	- 百万円																																																																								
支払リース料	75百万円																																																																								
リース資産減損勘定の取崩額	-																																																																								
減価償却費相当額	70																																																																								
支払利息相当額	1																																																																								
減損損失	-																																																																								
1年以内	15百万円																																																																								
1年超	24																																																																								
合計	40																																																																								

金融商品関係

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

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

(1) 現金・預金、(3) 短期貸付金、(4)未収委託者報酬

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

(2) 金銭の信託

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

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

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

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券796百万円、関係会社株式19,545百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	537	-	-	-
金銭の信託	39,575	-	-	-
短期貸付金	166	-	-	-
未収委託者報酬	10,032	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	1,400	0	1	-
合計	51,713	0	1	-

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24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	240	240	-
(2)金銭の信託	50,326	50,326	-
(3)短期貸付金	153	153	-
(4)未収委託者報酬	8,149	8,149	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
其他有価証券	7,725	7,725	-
(6)関係会社株式	3,064	89,073	86,009
資産計	69,658	155,667	86,009
(7)関係会社短期借入金	8,500	8,500	-
(8)未払金	6,276	6,276	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	50	50	-
未払手数料	3,610	3,610	-
其他未払金	2,610	2,610	-
(9)未払費用	6,760	6,760	-
(10)未払法人税等	856	856	-
負債計	22,393	22,393	-
(11)デリバティブ取引(*)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	10	10	-
デリバティブ取引計	10	10	-

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

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

(1) 現金・預金、(3) 短期貸付金、(4)未収委託者報酬

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

(2) 金銭の信託

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

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

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

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券766百万円、関係会社株式11,365百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について0百万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	238	-	-	-
金銭の信託	50,326	-	-	-
短期貸付金	153	-	-	-
未収委託者報酬	8,149	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	1,800	1	-	-
合計	60,668	1	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 売買目的有価証券(平成23年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(平成23年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(平成23年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	79,658	76,594
合計	3,064	79,658	76,594

4. その他有価証券(平成23年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	4,930	282	4,647
小計	4,930	282	4,647
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託(1)	2,922	3,003	80
譲渡性預金	1,400	1,400	-
小計	4,322	4,403	80
合計	9,252	4,685	4,566

- (1) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ損失は69百万円（税効果会計適用後）であり、貸借対照表に計上しております。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	67	39	-
投資信託	1,824	380	149
合計	1,891	419	149

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成24年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成24年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成24年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	89,073	86,009
合計	3,064	89,073	86,009

4．その他有価証券(平成24年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	4,624	282	4,341
小計	4,624	282	4,341
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託(1)	1,300	1,431	130
譲渡性預金	1,800	1,800	-
小計	3,100	3,231	130
合計	7,725	3,514	4,210

- (1) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ利益は12百万円（税効果会計適用後）であり、貸借対照表に計上しております。

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	40	1	26
投資信託	1,343	-	110
合計	1,384	1	136

デリバティブ取引関係

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	2,846	-	65	先物為替相場によっている
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	166	-	(*1) -	-
合 計			3,013	-	(*1) 65	-

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	1,308	-	10	先物為替相場によっている
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	153	-	(*1) -	-
合 計			1,462	-	(*1) 10	-

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

退職給付関係

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項(平成23年 3月31日)

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

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

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

(注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
ロ. 割引率	2.1%
ハ. 期待運用収益率	2.5%
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。)
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	(1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。)
ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数	該当はありません。

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項(平成24年 3月31日)

イ. 退職給付債務	13,948百万円
ロ. 年金資産	9,508
ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ)	4,440
ニ. 会計基準変更時差異の未処理額	
ホ. 未認識数理計算上の差異	2,575
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	572
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ)	2,437
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト - チ)	2,437

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

イ. 勤務費用	543百万円
ロ. 利息費用	272
ハ. 期待運用収益	186
ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額	
ホ. 数理計算上の差異の費用処理額	280
ヘ. 過去勤務債務の費用処理額	40
ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ)	869
チ. その他(注)	170
計	1,039

(注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
ロ. 割引率	1.8%
ハ. 期待運用収益率	2.5%
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。)
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	(1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。)
ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数	該当はありません。

税効果会計関係

前事業年度末 (平成23年3月31日)	当事業年度末 (平成24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 1,189	賞与引当金 1,070
退職給付引当金 1,666	退職給付引当金 877
所有株式税務簿価通算差異 884	所有株式税務簿価通算差異 776
投資有価証券評価減 569	投資有価証券評価減 501
ゴルフ会員権評価減 509	ゴルフ会員権評価減 430
減価償却超過額 307	減価償却超過額 243
時効後支払損引当金 197	時効後支払損引当金 176
子会社株式売却損 196	子会社株式売却損 172
未払事業税 206	未払事業税 166
未払確定拠出年金掛金 107	未払確定拠出年金掛金 -
繰延ヘッジ損失 48	繰延ヘッジ損失 -
その他 184	その他 148
繰延税金資産小計 6,069	繰延税金資産小計 4,564
評価性引当金 1,878	評価性引当金 1,650
繰延税金資産計 4,190	繰延税金資産計 2,913
繰延税金負債	繰延税金負債
有価証券評価差額金 1,872	有価証券評価差額金 1,511
繰延ヘッジ利益 -	繰延ヘッジ利益 7
繰延税金負債計 1,872	繰延税金負債計 1,518
繰延税金資産(純額) 2,318	繰延税金資産(純額) 1,394
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 41.0%	法定実効税率 41.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.8%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 13.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 11.3%
住民税等均等割 0.0%	住民税等均等割 0.0%
タックスハイブン税制 5.8%	タックスハイブン税制 4.2%
外国税額控除 0.6%	外国税額控除 0.0%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 -	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 2.4%
その他 0.7%	その他 0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.3%

税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後開始する事業年度より、法人税率が30%から25.5%に引き下げられました。また、「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が同日に公布され、平成24年4月1日から平成27年3月31日までの期間（指定期間）内に開始する事業年度（3年間）は、各課税事業年度の基準法人税額の10%が復興特別法人税として課税されることになりました。これらの改正により、繰延税金資産および繰延税金負債を計算する法定実効税率は平成24年4月1日から平成27年3月31日までに解消すると見込まれる一時差異等については38%、平成27年4月1日以降に解消すると見込まれる一時差異等については36%となっております。

この改正の影響により、繰延税金資産の純額が108百万円減少し、法人税等調整額は322百万円増加しております。

セグメント情報等

前事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

（追加情報）

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

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24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 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借等 役員の兼任	資金の借入(*1)	137,500	関係会社 短期 借入金	8,000
							資金の返済	140,500		
							借入金利息の支払	75	未払費用	3

(イ) 子会社等

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

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	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(*4)	31,596	未払手数料	3,835

親会社の子会社	野村ファン ド・リサー チ・アンド ・テクノロ ジー株式会 社	東京都 中央区	400 (百万円)	投資顧問業	当社投資信託 の運用委託 役員の兼任	投資信託の 運用に係る 投資顧問料 の支払 (*5)	有価証券届出書(内国投資信託受益証券)		
							2,657	未払費用	939

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(*2) 増資の引受けにつきましては、当社が平成22年12月23日及び12月28日に1株1米ドルで引受けております。

(*3) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

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

(*5) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

	(百万円)	
	(株)野村総合研究所	野村土地建物(株)
流動資産合計	167,970	7,506
固定資産合計	205,568	76,404
流動負債合計	79,436	7,926
固定負債合計	80,690	9,832
純資産合計	213,412	66,152
売上高	312,345	2,546
税引前当期純利益	36,149	3,289
当期純利益	21,100	2,944

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	90,500	関係会社 短期 借入金	8,500
							資金の返済	90,000		
							借入金利息の支払	54	未払費用	2
							金銭信託の移管(*2)	9,258	-	-
							株式交換(*3)	8,267	-	-

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有) 直接 21.6%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*4)	5,887	未払費用	478

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の 子会社	野村証券株式会社	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(*5)	33,134	未払 手数料	2,987
親会社の 子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託 役員の兼任	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*6)	2,126	未払費用	787

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(* 1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(* 2) 譲渡代金は、平成24年1月17日における時価評価金額としています。

(* 3) 当社が保有する野村土地建物株式会社株式と引き換えに野村ホールディングス株式会社株式を取得

いたしました。交換は、第三者算定機関の算定による交換比率に基づいております。

(* 4) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

(* 5) 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。

(* 6) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

	(百万円)
(株)野村総合研究所	
流動資産合計	166,580
固定資産合計	229,654
流動負債合計	72,440
固定負債合計	74,932
純資産合計	248,861
売上高	320,289
税引前当期純利益	62,962
当期純利益	41,340

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,765円90銭	1株当たり純資産額	13,828円81銭
1株当たり当期純利益	1,516円39銭	1株当たり当期純利益	1,652円20銭
<p>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。</p> <p>1株当たり当期純利益の算定上の基礎</p> <p>損益計算書上の当期純利益 7,810百万円</p> <p>普通株式に係る当期純利益 7,810百万円</p> <p>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。</p> <p>普通株式の期中平均株式数 5,150,693株</p>		<p>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。</p> <p>1株当たり当期純利益の算定上の基礎</p> <p>損益計算書上の当期純利益 8,509百万円</p> <p>普通株式に係る当期純利益 8,509百万円</p> <p>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。</p> <p>普通株式の期中平均株式数 5,150,693株</p>	

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、

通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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】

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	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。

* 平成24年7月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
野村証券株式会社	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。

* 平成24年7月末現在

2【関係業務の概要】

(1)受託者

ファンドの受託会社(受託者)として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行いません。

(2)販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

3【資本関係】(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1)目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。
- (2)目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。
- (3)届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6)目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7)目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8)目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

独立監査人の監査報告書

平成24年6月29日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成24年9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

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 内田 満 雄
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村日本債券インデックス（野村SMA向け）の平成23年7月21日から平成24年7月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村日本債券インデックス（野村SMA向け）の平成24年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)