【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】	2021年12月16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兼代表取締役社長 小池　広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目２番１号
【事務連絡者氏名】	松井　秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	野村円債投資インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

野村円債投資インデックスファンド
（以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「円債こづち」とします。）

（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】

①取得申込日の基準価額に1.1%（税抜1.0%）以内※で販売会社が独自に定める率を乗じて得た金額とします。

※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

（６）【申込単位】

1万口以上1万口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位

（７）【申込期間】

2021年12月17日から2022年12月19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】

販売会社の定める期日まで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】

該当事項はありません。

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】

◆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＞

一般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。

(野村円債投資インデックスファンド)

《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	特殊型
	内外	不動産投信	
		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 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　）	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 （　）	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファミリーファンド ファンド･オブ･ファンズ	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 (NOMURA-BPI総合)
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、下記一般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。
《一般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/

◆一般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。（2013年2月21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ないファンドをいう。
(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すべてのものをいう。

(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すべてのものをいう。

(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若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すべてのものをいう。

［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、為替のヘッジを行な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。

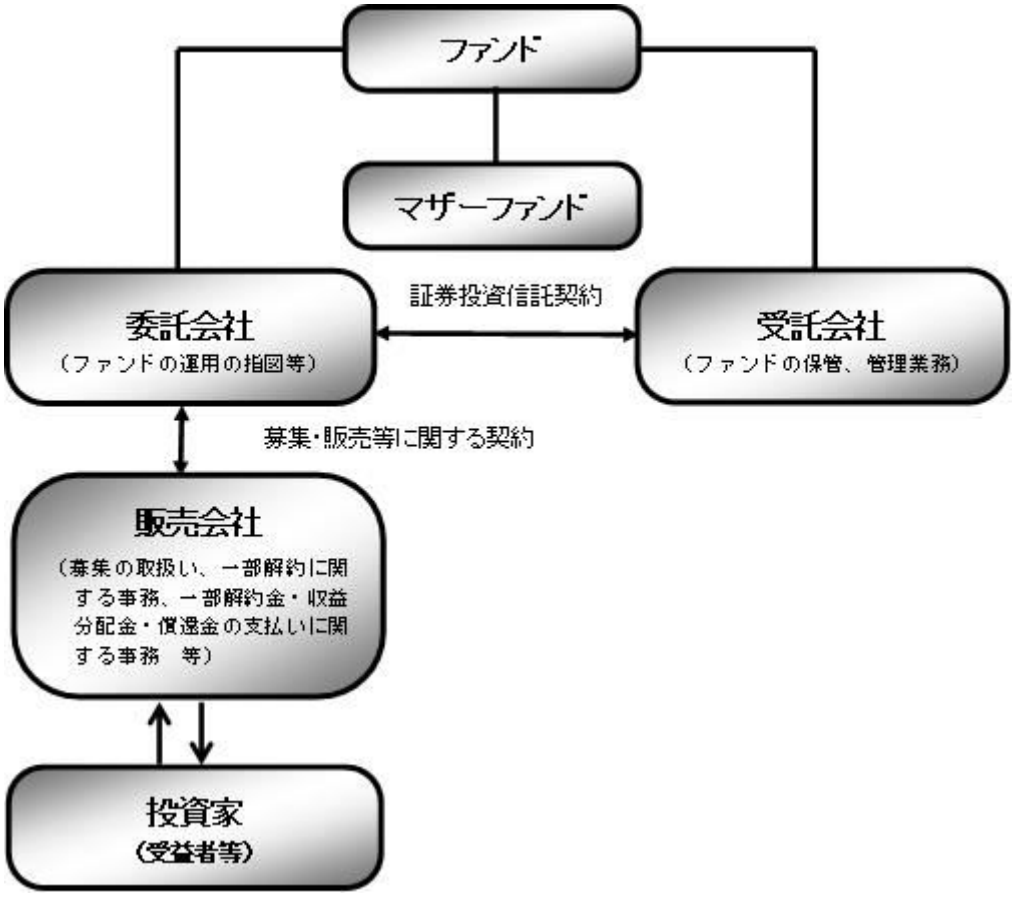
［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

［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、仕組債への投資又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。

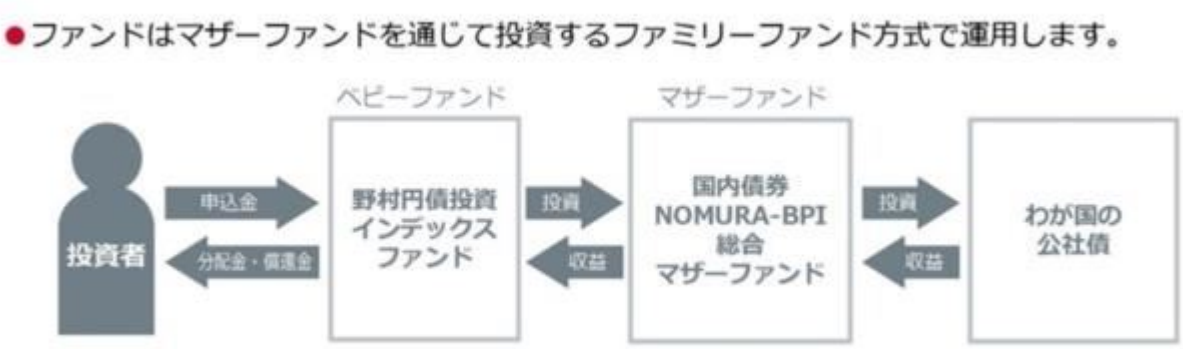
（２）【ファンドの沿革】

2010年10月1日　　信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



ファンド	**野村円債投資インデックスファンド**
マザーファンド（親投資信託）	**国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド**
委託会社（委託者）	**野村アセットマネジメント株式会社**
受託会社（受託者）	**野村信託銀行株式会社**



■委託会社の概況(2021年10月末現在)■

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月１日	野村證券投資信託委託株式会社として設立
1997年10月１日	投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
2000年11月１日	野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

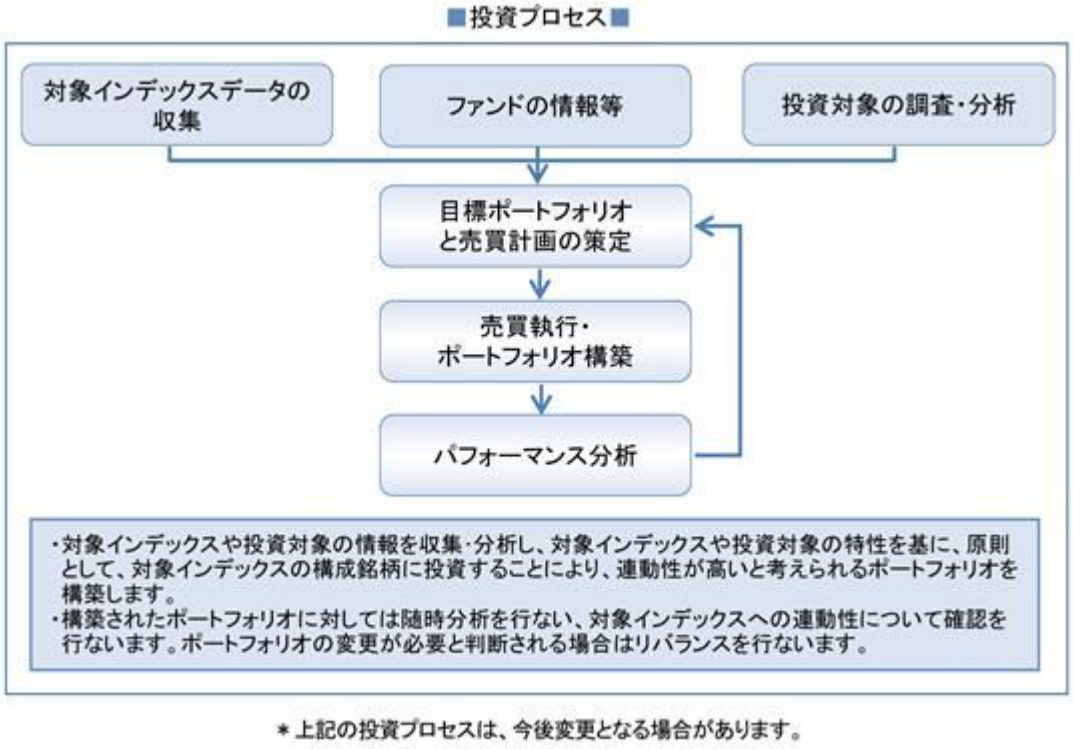
2【投資方針】

（1）【投資方針】

わが国の公社債を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI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。

■NOMURA-BPI総合とは■

◆NOMURA-BPI総合は、野村證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。



＊上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、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いません。

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】

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。
なお、デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定します。

①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 ⑦および⑧」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

②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、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。

③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②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 ②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

④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

① 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。

② 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

① 株式への投資は行ないません。

② 外貨建資産への投資は行ないません。

③ 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

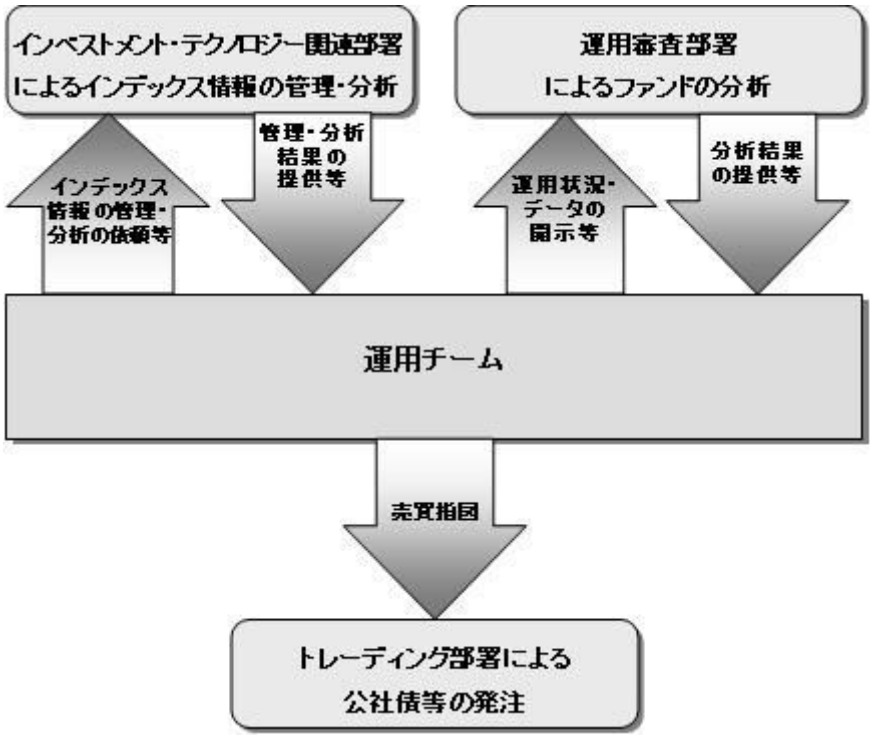
④ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（3）【運用体制】

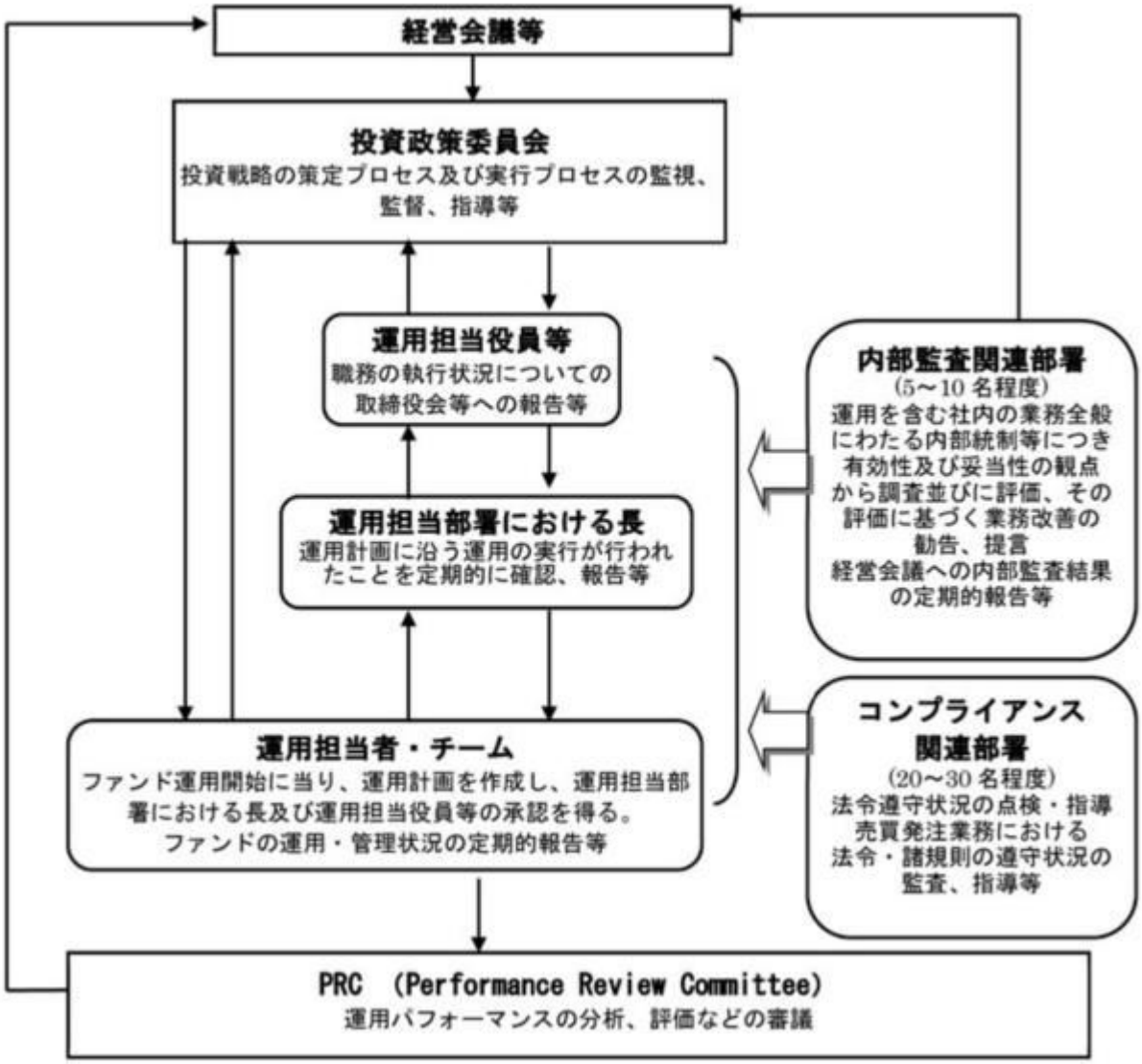
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※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、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（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ないます。

①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。

②収益分配金額は、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

③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な

います。

※利子・配当等収益とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸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なわない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

◆ファンドの決算日

原則として**毎月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

お客様と販売会社とのご契約によって、以下の通りとなります。

［分配金をお支払いする契約の場合］

決算日から起算して5営業日までに支払いを開始いたします。※1

［分配金を再投資する契約の場合］

分配金は税引き後無手数料で再投資されます。※2

※1　分配金は、決算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（当該収益分配金にかかる決算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、当該収益分配金にかかる決算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ます。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始いたします。

※2　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。

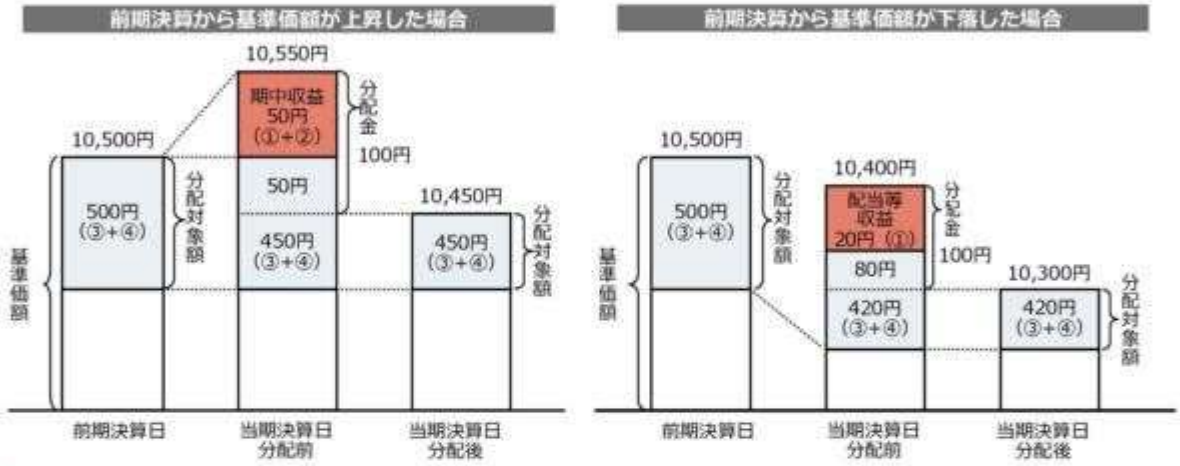
◆分配金に関する留意点

●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。

●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。

・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。

※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
分配対象額とは、①経費控除後の配当等収益②経費控除後の評価益を含む売買益③分配準備積立金④収益調整金です。



●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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

普通分配金	分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本と同額の場合または投資者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。
元本払戻金（特別分配金）	分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本を下回っている場合には、下回る部分の分配金の額が元本払戻金（特別分配金）となります。

◆投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の投資者の個別元本となります。

（分配金の一部が元本の一部払い戻しに相当する場合の一例）　（分配金の全部が元本の一部払い戻しに相当する場合の一例）

分配金に関する留意点に記載の図はイメージ図であり、全ての状況について説明したものではありません。また、実際の分配金額や基準価額について示唆、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

①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ます。）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。

②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。

③デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。(運用の基本方針　２　運用方法　(3)投資制限)

④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。

⑤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。

⑥投資する株式の範囲(約款第19条)

(ⅰ)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。

(ⅱ)上記(ⅰ)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るものとします。

⑦先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

(ⅰ)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　③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。

(ⅱ)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 ③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 ③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。

⑧スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

(ⅰ)委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに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。

(ⅱ)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。

(ⅲ)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。

(ⅳ)上記(ⅲ)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。

(ⅴ)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

(ⅵ)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たときは、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。

⑨有価証券の貸付の指図および範囲(約款第24条)

(ⅰ)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。**

(ⅱ)上記(ⅰ)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。

(ⅲ)委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑩公社債の借入れ(約款第25条)

(ⅰ)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たときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

(ⅱ)上記(ⅰ)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。

(ⅲ)信託財産の一部解約等の事由により、上記(ⅱ)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。

(ⅳ)上記(ⅰ)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑪資金の借入れ(約款第31条)

(ⅰ)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。

(ⅱ)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。

(ⅲ)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。

(ⅳ)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑫一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。(運用の基本方針　2　運用方法　(3)投資制限)

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なう売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

≪委託会社におけるリスクマネジメント体制≫

リスク管理関連の委員会

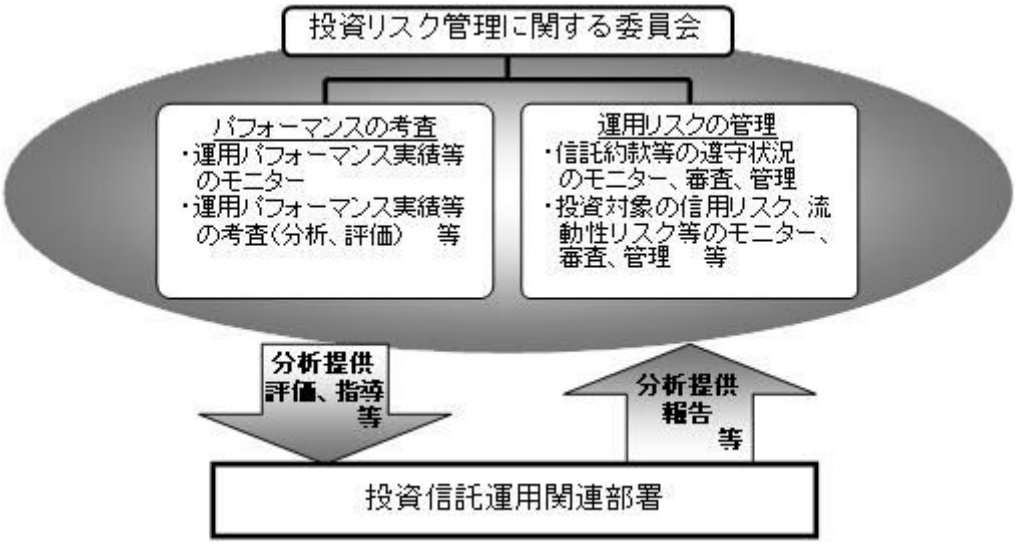
◆パフォーマンスの考査

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、審議を行ないます。

◆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なうことにより、適切な管理を行ないます。

リスク管理体制図



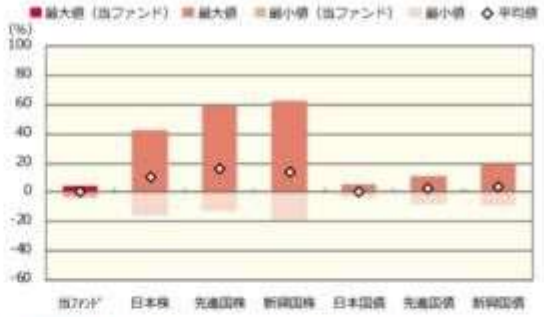
※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

投資リスク

リスクの定量的比較（2016年11月末～2021年10月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値（%）	**4.5**	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値（%）	**△3.9**	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△7.9	△9.4
平均値（%）	**△0.1**	10.1	15.6	13.7	0.2	3.0	4.1

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2016年11月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2016年11月から2021年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2016年11月から2021年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>
○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
○先進国株：MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）
○新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
○日本国債：NOMURA-BPI国債
○先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
○新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

○NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。

○FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

○JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメークを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
JPMSLLCはNASD, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込日の基準価額に、1.1%(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率)(税抜1.0%)以内※で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（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0.407%（税抜年0.37%）を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
年0.160%	年0.185%	年0.025%

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

≪支払先の役務の内容≫

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

（4）【その他の手数料等】

①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。

②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。

③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す。

④監査法人等に支払うファンドの監査に係る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。

※これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

（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＞

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

なお、配当控除は適用されません。

＜換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税＞

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

≪損益通算について≫

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》(注2)	《配当所得》
・特定公社債(注1)の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金

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

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

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

◆法人の投資家に対する課税

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、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。

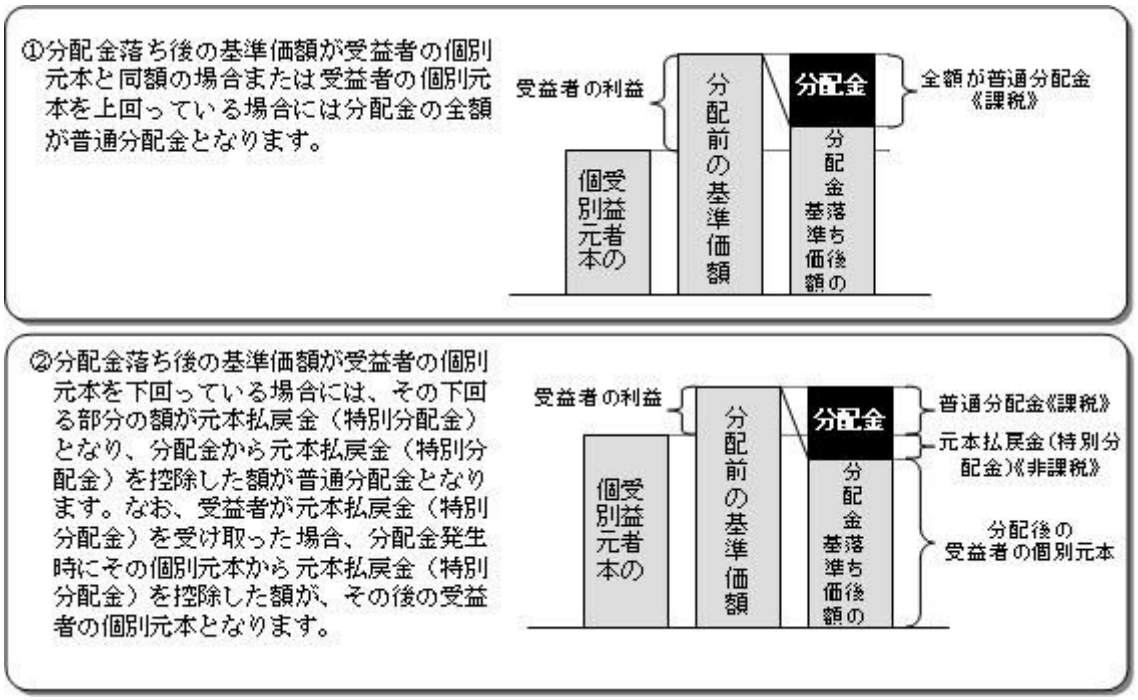
■個別元本について■

◆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。

※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（2021年10月末現在）が変更になる場合があります。

５【運用状況】

以下は2021年10月29日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

野村円債投資インデックスファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,062,087,003	99.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	106,148	0.00
合計（純資産総額）		1,062,193,151	100.00

（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	654,978,365,750	80.12
地方債証券	日本	55,173,582,923	6.74
特殊債券	日本	66,134,909,406	8.08
社債券	日本	36,440,232,650	4.45
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	4,767,654,148	0.58
合計（純資産総額）		817,494,744,877	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

野村円債投資インデックスファンド

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）	投資比率（％）
1	日本	親投資信託受益証券	国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	799,583,681	1.3271	1,061,127,504	1.3283	1,062,087,003	99.99

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	99.99
合　　計	99.99

（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（１０年）第３６２回	9,800,000,000	100.28	9,827,670,000	100.32	9,831,948,000	0.1	2031/3/20	1.20
2	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４３回	9,500,000,000	100.97	9,592,534,000	100.86	9,581,700,000	0.1	2026/6/20	1.17
3	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４２回	8,550,000,000	100.93	8,630,016,000	100.81	8,619,511,500	0.1	2026/3/20	1.05
4	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５１回	8,500,000,000	100.90	8,576,500,000	100.96	8,581,940,000	0.1	2028/6/20	1.04
5	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	100.46	8,539,355,000	100.29	8,524,650,000	0.1	2023/3/20	1.04
6	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６１回	8,400,000,000	100.07	8,405,910,000	100.45	8,438,136,000	0.1	2030/12/20	1.03
7	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６０回	7,900,000,000	100.18	7,914,852,000	100.57	7,945,425,000	0.1	2030/9/20	0.97
8	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６３回	7,450,000,000	100.55	7,491,595,500	100.19	7,464,229,500	0.1	2031/6/20	0.91
9	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	101.89	7,438,481,000	101.63	7,419,647,000	0.3	2025/12/20	0.90
10	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５０回	7,150,000,000	100.97	7,219,860,000	100.96	7,218,640,000	0.1	2028/3/20	0.88
11	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３８回	7,100,000,000	100.62	7,144,134,000	100.44	7,131,879,000	0.1	2023/12/20	0.87
12	日本	国債証券	国庫債券　利付（２年）第４２７回	6,800,000,000	100.26	6,817,956,000	100.21	6,814,280,000	0.005	2023/8/1	0.83
13	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	102.37	6,756,816,000	101.84	6,721,902,000	0.6	2024/6/20	0.82
14	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３７回	6,600,000,000	100.54	6,635,949,000	100.39	6,626,136,000	0.1	2023/9/20	0.81
15	日本	国債証券	国庫債券　利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	93.56	6,568,409,500	93.38	6,555,556,800	0.5	2060/3/20	0.80
16	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１５７回	6,540,000,000	98.57	6,446,835,000	98.80	6,461,847,000	0.2	2036/6/20	0.79
17	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５２回	6,400,000,000	100.96	6,461,440,000	100.93	6,459,584,000	0.1	2028/9/20	0.79
18	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４４回	6,400,000,000	100.99	6,463,360,000	100.88	6,456,448,000	0.1	2026/9/20	0.78
19	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４１回	6,400,000,000	100.75	6,448,372,000	100.57	6,436,992,000	0.1	2024/9/20	0.78
20	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４８回	6,300,000,000	100.53	6,333,577,000	100.39	6,324,885,000	0.005	2026/6/20	0.77
21	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１５６回	6,150,000,000	101.40	6,236,170,500	101.79	6,260,638,500	0.4	2036/3/20	0.76
22	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	100.87	6,123,123,200	100.66	6,110,122,700	0.1	2025/3/20	0.74

23	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	102.08	6,124,860,000	101.48	6,088,800,000	0.8	2023/6/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１７６回	6,020,000,000	101.04	6,082,701,300	100.71	6,062,802,200	0.5	2041/3/20	0.74
25	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	102.02	6,019,180,000	101.50	5,988,972,000	0.6	2023/12/20	0.73
26	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	110.10	5,890,403,500	110.23	5,897,733,000	1	2035/12/20	0.72
27	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	100.94	5,854,520,000	100.97	5,856,492,000	0.1	2027/9/20	0.71
28	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５９回	5,600,000,000	100.32	5,617,920,000	100.68	5,638,584,000	0.1	2030/6/20	0.68
29	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４５回	5,500,000,000	100.97	5,553,350,000	100.90	5,549,555,000	0.1	2026/12/20	0.67
30	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１７５回	5,500,000,000	100.42	5,523,385,000	100.88	5,548,400,000	0.5	2040/12/20	0.67

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(％)
国債証券	80.12
地方債証券	6.74
特殊債券	8.08
社債券	4.45
合　　計	99.41

②【投資不動産物件】

野村円債投資インデックスファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

野村円債投資インデックスファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

野村円債投資インデックスファンド

2021年10月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

	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3特定期間 (2012年 3月21日)	1,277	1,278	0.9989	0.9994
第4特定期間 (2012年 9月20日)	1,760	1,761	1.0094	1.0099
第5特定期間 (2013年 3月21日)	1,972	1,973	1.0240	1.0245
第6特定期間 (2013年 9月20日)	1,866	1,867	1.0173	1.0178
第7特定期間 (2014年 3月20日)	1,891	1,892	1.0262	1.0267
第8特定期間 (2014年 9月22日)	2,062	2,063	1.0299	1.0304
第9特定期間 (2015年 3月20日)	2,298	2,299	1.0476	1.0481
第10特定期間 (2015年 9月24日)	2,504	2,505	1.0460	1.0465
第11特定期間 (2016年 3月22日)	2,681	2,683	1.0968	1.0973
第12特定期間 (2016年 9月20日)	2,597	2,598	1.0883	1.0888
第13特定期間 (2017年 3月21日)	2,242	2,243	1.0671	1.0676
第14特定期間 (2017年 9月20日)	2,183	2,184	1.0667	1.0672
第15特定期間 (2018年 3月20日)	2,060	2,061	1.0664	1.0669
第16特定期間 (2018年 9月20日)	1,908	1,909	1.0554	1.0559
第17特定期間 (2019年 3月20日)	1,788	1,788	1.0712	1.0717
第18特定期間 (2019年 9月20日)	1,632	1,633	1.0855	1.0860
第19特定期間 (2020年 3月23日)	1,421	1,422	1.0626	1.0631
第20特定期間 (2020年 9月23日)	1,357	1,358	1.0568	1.0573
第21特定期間 (2021年 3月22日)	1,168	1,168	1.0484	1.0489
第22特定期間 (2021年 9月21日)	1,082	1,083	1.0476	1.0481
2020年10月末日	1,292	—	1.0532	—
11月末日	1,253	—	1.0538	—
12月末日	1,236	—	1.0531	—
2021年 1月末日	1,215	—	1.0497	—
2月末日	1,174	—	1.0402	—
3月末日	1,153	—	1.0466	—
4月末日	1,146	—	1.0477	—
5月末日	1,137	—	1.0473	—
6月末日	1,121	—	1.0470	—
7月末日	1,120	—	1.0513	—
8月末日	1,115	—	1.0496	—
9月末日	1,078	—	1.0452	—

10月末日	1,062	—	1.0433	—

②【分配の推移】

野村円債投資インデックスファンド

	計算期間	1口当たりの分配金
第3特定期間	2011年 9月21日～2012年 3月21日	0.0030円
第4特定期間	2012年 3月22日～2012年 9月20日	0.0030円
第5特定期間	2012年 9月21日～2013年 3月21日	0.0030円
第6特定期間	2013年 3月22日～2013年 9月20日	0.0030円
第7特定期間	2013年 9月21日～2014年 3月20日	0.0030円
第8特定期間	2014年 3月21日～2014年 9月22日	0.0030円
第9特定期間	2014年 9月23日～2015年 3月20日	0.0030円
第10特定期間	2015年 3月21日～2015年 9月24日	0.0030円
第11特定期間	2015年 9月25日～2016年 3月22日	0.0030円
第12特定期間	2016年 3月23日～2016年 9月20日	0.0030円
第13特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月21日	0.0030円
第14特定期間	2017年 3月22日～2017年 9月20日	0.0030円
第15特定期間	2017年 9月21日～2018年 3月20日	0.0030円
第16特定期間	2018年 3月21日～2018年 9月20日	0.0030円
第17特定期間	2018年 9月21日～2019年 3月20日	0.0030円
第18特定期間	2019年 3月21日～2019年 9月20日	0.0030円
第19特定期間	2019年 9月21日～2020年 3月23日	0.0030円
第20特定期間	2020年 3月24日～2020年 9月23日	0.0030円
第21特定期間	2020年 9月24日～2021年 3月22日	0.0030円
第22特定期間	2021年 3月23日～2021年 9月21日	0.0030円

※各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

③【収益率の推移】

野村円債投資インデックスファンド

	計算期間	収益率
第3特定期間	2011年 9月21日～2012年 3月21日	0.3%
第4特定期間	2012年 3月22日～2012年 9月20日	1.4%
第5特定期間	2012年 9月21日～2013年 3月21日	1.7%
第6特定期間	2013年 3月22日～2013年 9月20日	△0.4%
第7特定期間	2013年 9月21日～2014年 3月20日	1.2%
第8特定期間	2014年 3月21日～2014年 9月22日	0.7%
第9特定期間	2014年 9月23日～2015年 3月20日	2.0%

第10特定期間	2015年 3月21日～2015年 9月24日	0.1%
第11特定期間	2015年 9月25日～2016年 3月22日	5.1%
第12特定期間	2016年 3月23日～2016年 9月20日	△0.5%
第13特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月21日	△1.7%
第14特定期間	2017年 3月22日～2017年 9月20日	0.2%
第15特定期間	2017年 9月21日～2018年 3月20日	0.3%
第16特定期間	2018年 3月21日～2018年 9月20日	△0.8%
第17特定期間	2018年 9月21日～2019年 3月20日	1.8%
第18特定期間	2019年 3月21日～2019年 9月20日	1.6%
第19特定期間	2019年 9月21日～2020年 3月23日	△1.8%
第20特定期間	2020年 3月24日～2020年 9月23日	△0.3%
第21特定期間	2020年 9月24日～2021年 3月22日	△0.5%
第22特定期間	2021年 3月23日～2021年 9月21日	0.2%

※各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村円債投資インデックスファンド

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第3特定期間	2011年 9月21日～2012年 3月21日	605,028,515	67,064,681	1,278,957,534
第4特定期間	2012年 3月22日～2012年 9月20日	721,122,203	255,834,715	1,744,245,022
第5特定期間	2012年 9月21日～2013年 3月21日	543,290,575	360,811,258	1,926,724,339
第6特定期間	2013年 3月22日～2013年 9月20日	367,489,850	459,775,678	1,834,438,511
第7特定期間	2013年 9月21日～2014年 3月20日	503,404,791	494,288,621	1,843,554,681
第8特定期間	2014年 3月21日～2014年 9月22日	557,179,838	398,000,124	2,002,734,395
第9特定期間	2014年 9月23日～2015年 3月20日	650,838,330	460,059,159	2,193,513,566
第10特定期間	2015年 3月21日～2015年 9月24日	599,250,453	398,077,004	2,394,687,015
第11特定期間	2015年 9月25日～2016年 3月22日	931,877,646	881,464,476	2,445,100,185
第12特定期間	2016年 3月23日～2016年 9月20日	910,171,428	968,578,002	2,386,693,611
第13特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月21日	364,870,018	650,558,728	2,101,004,901
第14特定期間	2017年 3月22日～2017年 9月20日	204,109,729	258,558,537	2,046,556,093
第15特定期間	2017年 9月21日～2018年 3月20日	86,959,473	201,099,467	1,932,416,099
第16特定期間	2018年 3月21日～2018年 9月20日	59,874,008	183,464,712	1,808,825,395
第17特定期間	2018年 9月21日～2019年 3月20日	56,423,662	195,942,946	1,669,306,111
第18特定期間	2019年 3月21日～2019年 9月20日	33,321,905	198,462,116	1,504,165,900
第19特定期間	2019年 9月21日～2020年 3月23日	32,679,300	199,222,916	1,337,622,284
第20特定期間	2020年 3月24日～2020年 9月23日	15,743,286	68,446,211	1,284,919,359
第21特定期間	2020年 9月24日～2021年 3月22日	12,687,869	183,252,416	1,114,354,812
第22特定期間	2021年 3月23日～2021年 9月21日	24,079,804	104,766,704	1,033,667,912

※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（2021年10月29日現在）

基準価額・純資産の推移（日次）

分配の推移

（1万口あたり、課税前）

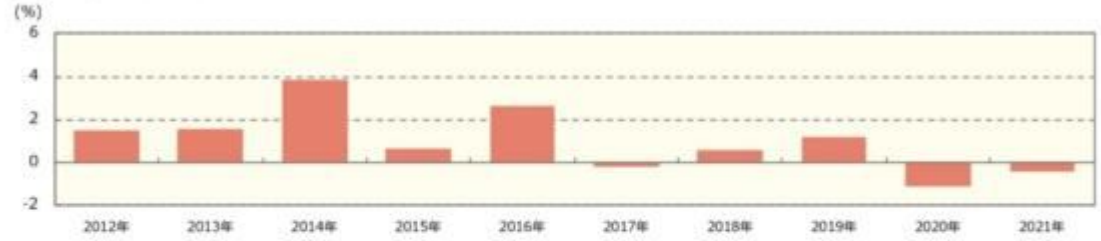
2021年10月	5 円
2021年9月	5 円
2021年8月	5 円
2021年7月	5 円
2021年6月	5 円
直近1年間累計	60 円
設定来累計	650 円

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（１０年）第３６２回	国債証券	1.2
2	国庫債券　利付（１０年）第３４３回	国債証券	1.2
3	国庫債券　利付（１０年）第３４２回	国債証券	1.0
4	国庫債券　利付（１０年）第３５１回	国債証券	1.0
5	国庫債券　利付（５年）第１３５回	国債証券	1.0
6	国庫債券　利付（１０年）第３６１回	国債証券	1.0
7	国庫債券　利付（１０年）第３６０回	国債証券	1.0
8	国庫債券　利付（１０年）第３６３回	国債証券	0.9
9	国庫債券　利付（１０年）第３４１回	国債証券	0.9
10	国庫債券　利付（１０年）第３５０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。
・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

(1)受益権の募集

申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。

(2)申込締切時間

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の受け付け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申込み分とします。

(3)販売単位

1万口以上1万口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。

(4)販売価額

取得申込日の基準価額とします。

(5)申込代金の支払い

販売会社の定める期日までに支払うものとします。

(6)積立方式

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

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

(7)申込受け付けの中止および取り消し

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号ロ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、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、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。

(8)申込手続等に関する照会先

ファンドの申込（販売）手続等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/

※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。

2【換金（解約）手続等】

(1)解約の請求

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。

(2)解約請求の締切時間

一部解約の実行の請求の受け付けについては、午後3時までに解約請求の申込みが行われ、かつ、その解約請求の申込みの受け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。

(3)換金単位

1万口単位、1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。

(4)換金価額

換金のお申込み日の基準価額となります。

(5)換金制限

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。

(6)換金代金の支払い

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。

(7)解約請求の受け付けの中止および取り消し

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付けを中止することおよび既に受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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付けたものとします。

(8)換金手続等に関する照会先

ファンドの換金（解約）手続等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/

※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。

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。)を法令および一般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。※ ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) ③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(2010年10月1日設定)。

（4）【計算期間】

原則として、毎月21日から翌月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

(ⅰ)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します。

(ⅱ)上記(ⅰ)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。

(ⅲ)上記(ⅰ)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

(ⅳ)上記(ⅰ)から(ⅲ)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(ⅰ)から(ⅲ)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。

(ⅴ)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。

(ⅵ)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「(e)信託約款の変更等(ⅳ)」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、毎年2月、8月に終了する計算期間の末日および償還時に交付運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知れている受益者に対して交付します。

(d)有価証券報告書

委託者は、有価証券報告書を原則毎年3月、9月の決算日を基準に作成し3ヵ月以内に関東財務局長に提出します。

(e)信託約款の変更等

(ⅰ)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。

(ⅱ)委託者は、上記(ⅰ)の事項(上記(ⅰ)の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、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します。

(ⅲ)上記(ⅱ)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。

(ⅳ)上記(ⅱ)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

(ⅴ)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。

(ⅵ)上記(ⅱ)から(ⅴ)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。

(ⅶ)上記(ⅰ)から(ⅵ)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っても、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。

(f)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。

(g)受託者の辞任および解任に伴う取扱い

(ⅰ)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「(e)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。

(ⅱ)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。

(h)反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、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おいて、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

(i)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

(j)関係法人との契約の更新に関する手続

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。

①収益分配金に対する請求権

■収益分配金の支払い開始日■

＜累積投資契約を結んでいない場合＞

収益分配金は、決算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(当該収益分配金にかかる決算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、当該収益分配金にかかる計算期間の末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ます。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

＜累積投資契約を結んでいる場合＞

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。なお、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。

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

②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ます。)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。

③換金(解約)請求権

受益者は、一部解約の実行を請求することができます。詳しくは、前述の「2　換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第３【ファンドの経理状況】

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

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

(３)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2021年3月23日から2021年9月21日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【野村円債投資インデックスファンド】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 (2021年 3月22日現在)	当期 (2021年 9月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	419,291	671,753
親投資信託受益証券	1,168,169,906	1,082,741,607
未収入金	622,203	1,805,263
流動資産合計	1,169,211,400	1,085,218,623
資産合計	1,169,211,400	1,085,218,623
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	557,177	516,833
未払解約金	-	1,455,963
未払受託者報酬	24,731	26,629
未払委託者報酬	341,328	367,460
その他未払費用	1,970	2,120
流動負債合計	925,206	2,369,005
負債合計	925,206	2,369,005
純資産の部		
元本等		
元本	1,114,354,812	1,033,667,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	53,931,382	49,181,706
（分配準備積立金）	37,430,738	33,341,745
元本等合計	1,168,286,194	1,082,849,618
純資産合計	1,168,286,194	1,082,849,618
負債純資産合計	1,169,211,400	1,085,218,623

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2020年 9月24日 至　2021年 3月22日	当期 自　2021年 3月23日 至　2021年 9月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	△4,004,641	4,721,313
営業収益合計	△4,004,641	4,721,313
営業費用		
支払利息	7	7
受託者報酬	169,237	156,077
委託者報酬	2,335,469	2,153,896
その他費用	13,479	12,423
営業費用合計	2,518,192	2,322,403
営業利益又は営業損失（△）	△6,522,833	2,398,910
経常利益又は経常損失（△）	△6,522,833	2,398,910
当期純利益又は当期純損失（△）	△6,522,833	2,398,910
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△164,013	△40,890
期首剰余金又は期首欠損金（△）	72,947,227	53,931,382
剰余金増加額又は欠損金減少額	660,173	1,157,748
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	660,173	1,157,748
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,789,435	5,136,539
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,789,435	5,136,539
分配金	3,527,763	3,210,685
期末剰余金又は期末欠損金（△）	53,931,382	49,181,706

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
４.その他	当該財務諸表の特定期間は、2021年 3月23日から2021年 9月21日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

前期 2021年 3月22日現在	当期 2021年 9月21日現在
１．　特定期間の末日における受益権の総数 1,114,354,812口	１．　特定期間の末日における受益権の総数 1,033,667,912口
２．　特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	２．　特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額　1.0484円	1口当たり純資産額　1.0476円
(10,000口当たり純資産額)　(10,484円)	(10,000口当たり純資産額)　(10,476円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期
自 2020年 9月24日
至 2021年 3月22日

１.分配金の計算過程

2020年 9月24日から2020年10月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	456,508円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	128,768,708円
分配準備積立金額	D	43,465,924円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	172,691,140円
当ファンドの期末残存口数	F	1,258,193,746口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,372円
10,000口当たり分配金額	H	5円

当期
自 2021年 3月23日
至 2021年 9月21日

１.分配金の計算過程

2021年 3月23日から2021年 4月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	540,910円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	112,846,852円
分配準備積立金額	D	36,839,820円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	150,227,582円
当ファンドの期末残存口数	F	1,098,582,651口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,367円
10,000口当たり分配金額	H	5円

収益分配金金額	I=F×H/10,000	629,096円

2020年10月21日から2020年11月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	543,699円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	123,353,167円
分配準備積立金額	D	41,387,770円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	165,284,636円
当ファンドの期末残存口数	F	1,204,649,261口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,372円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	602,324円

2020年11月21日から2020年12月21日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	411,452円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	121,109,709円
分配準備積立金額	D	40,493,386円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	162,014,547円
当ファンドの期末残存口数	F	1,182,115,432口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,370円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	591,057円

2020年12月22日から2021年 1月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	377,140円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	119,614,637円
分配準備積立金額	D	39,650,841円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	159,642,618円
当ファンドの期末残存口数	F	1,166,294,035口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,368円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	583,147円

2021年 1月21日から2021年 2月22日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	321,445円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	115,943,412円
分配準備積立金額	D	38,157,233円

収益分配金金額	I=F×H/10,000	549,291円

2021年 4月21日から2021年 5月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	321,079円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	111,996,676円
分配準備積立金額	D	36,474,854円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	148,792,609円
当ファンドの期末残存口数	F	1,089,715,818口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,365円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	544,857円

2021年 5月21日から2021年 6月21日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	555,660円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	110,378,753円
分配準備積立金額	D	35,201,637円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	146,136,050円
当ファンドの期末残存口数	F	1,070,102,981口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,365円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	535,051円

2021年 6月22日から2021年 7月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	612,378円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	110,234,128円
分配準備積立金額	D	35,058,499円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	145,905,005円
当ファンドの期末残存口数	F	1,067,779,776口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,366円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	533,889円

2021年 7月21日から2021年 8月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	267,461円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	109,707,724円
分配準備積立金額	D	34,814,030円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	154,422,090円
当ファンドの期末残存口数	F	1,129,925,521口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,366円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	564,962円

2021年 2月23日から2021年 3月22日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	653,540円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	114,403,031円
分配準備積立金額	D	37,334,375円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	152,390,946円
当ファンドの期末残存口数	F	1,114,354,812口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,367円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	557,177円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	144,789,215円
当ファンドの期末残存口数	F	1,061,529,855口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,363円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	530,764円

2021年 8月21日から2021年 9月21日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	278,564円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	106,894,345円
分配準備積立金額	D	33,580,014円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	140,752,923円
当ファンドの期末残存口数	F	1,033,667,912口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,361円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	516,833円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

前期 自 2020年 9月24日 至 2021年 3月22日	当期 自 2021年 3月23日 至 2021年 9月21日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその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。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2021年 3月22日現在	当期 2021年 9月21日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 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。	１．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 ２．時価の算定方法 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2020年 9月24日 至 2021年 3月22日	当期 自 2021年 3月23日 至 2021年 9月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）
１ 元本の移動

前期 自 2020年 9月24日 至 2021年 3月22日		当期 自 2021年 3月23日 至 2021年 9月21日	
期首元本額	1,284,919,359円	期首元本額	1,114,354,812円

期中追加設定元本額	12,687,869円	期中追加設定元本額	24,079,804円
期中一部解約元本額	183,252,416円	期中一部解約元本額	104,766,704円

２ 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2020年 9月24日 至 2021年 3月22日	当期 自 2021年 3月23日 至 2021年 9月21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	6,162,161	△1,950,155
合計	6,162,161	△1,950,155

３ デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式(2021年9月21日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2021年9月21日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	812,564,058	1,082,741,607	
	小計	銘柄数：1	812,564,058	1,082,741,607	
		組入時価比率：100.0%		100.0%	
合計				1,082,741,607	

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

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

第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2021年 9月21日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,999,820,785
国債証券	638,777,333,500
地方債証券	54,269,004,869
特殊債券	64,366,863,305
社債券	34,000,434,550
未収利息	740,790,300
前払費用	14,818,567
流動資産合計	800,169,065,876
資産合計	800,169,065,876
負債の部	
流動負債	
未払解約金	387,930,294
未払利息	6,562
流動負債合計	387,936,856
負債合計	387,936,856
純資産の部	
元本等	
元本	600,229,184,142
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	199,551,944,878
元本等合計	799,781,129,020
純資産合計	799,781,129,020
負債純資産合計	800,169,065,876

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	国債証券、地方債証券、特殊債券、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	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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 9月21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	1.3325円
(10,000口当たり純資産額)	(13,325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 2021年 3月23日 至 2021年 9月21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その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、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。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 9月21日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、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）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 9月21日現在	
期首	2021年 3月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	553,262,430,525円

同期中における追加設定元本額	76,601,201,020円
同期中における一部解約元本額	29,634,447,403円
期末元本額	600,229,184,142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	411,243,312円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	42,174,271,378円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	18,138,569,054円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	3,387,943,622円
野村資産設計ファンド２０１５	352,515,623円
野村資産設計ファンド２０２０	355,773,820円
野村資産設計ファンド２０２５	359,437,452円
野村資産設計ファンド２０３０	287,124,745円
野村資産設計ファンド２０３５	157,193,763円
野村資産設計ファンド２０４０	208,529,096円
野村日本債券インデックスファンド	832,841,022円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	160,761,313,440円
のむラップ・ファンド（保守型）	14,314,960,774円
のむラップ・ファンド（普通型）	14,099,127,995円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,015,515,618円
野村日本債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	10,235,687,416円
野村資産設計ファンド２０４５	22,287,135円
野村円債投資インデックスファンド	812,564,058円
野村インデックスファンド・国内債券	2,113,207,057円
マイ・ロード	34,234,100,546円
野村インデックスファンド・内外７資産バランス・為替ヘッジ型	1,445,090,125円
野村日本債券インデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	19,580,089,707円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	2,035,994,418円
野村資産設計ファンド２０５０	24,331,362円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	28,329,401円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	7,647,701円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	4,146,367円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	2,573,979円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	1,124,275,196円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	393,993,648円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	57,158,056円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	27,959,224円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	110,246,163円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	14,247,934円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	10,305,483円
野村６資産均等バランス	3,474,581,981円
世界６資産分散ファンド	119,314,650円
野村資産設計ファンド２０６０	8,937,572円
ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　国内債券・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合連動型上場投信	24,484,313,257円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	22,040,533,098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）	566,237,337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）	89,502,163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）	1,816,099,395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）	1,034,649,521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）	18,689,277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）	10,149,663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）	678,171円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,684,495,331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）	8,382,768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）	66,923,381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）	70,444,744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）	379,508,436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）	314,060,864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）	939,233,312円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	165,524,294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）	890,726,458円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	315,099,975円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	14,742,794円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	38,265,553,369円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	50,830,629,892円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	19,378,525,307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）	50,945,734,721円
マイバランスＤＣ３０	13,764,091,807円
マイバランスＤＣ５０	11,340,272,719円
マイバランスＤＣ７０	3,835,626,202円
野村ＤＣ国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合	13,144,664,224円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	1,195,045,134円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	2,934,467,631円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	1,349,977,661円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	190,502,947円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	29,515,740円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	33,187,244円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	63,738,141円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	25,678,145円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	9,848,262円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	883,075,003円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	458,216,623円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	170,865,945円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	217,274,080円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	4,614,549円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	43,872,481円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	460,782,183円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1　有価証券明細表
(1)株式(2021年9月21日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2021年9月21日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券　利付（２年）第４１７回	500,000,000	501,175,000	
		国庫債券　利付（２年）第４１８回	4,400,000,000	4,411,220,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２０回	500,000,000	501,500,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２１回	3,500,000,000	3,511,200,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２２回	1,400,000,000	1,404,732,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２３回	5,200,000,000	5,211,076,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２４回	2,300,000,000	2,305,175,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２６回	1,500,000,000	1,503,720,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２７回	5,300,000,000	5,313,780,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３４回	2,500,000,000	2,507,000,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	8,529,155,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３６回	4,300,000,000	4,317,243,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３７回	5,500,000,000	5,525,245,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３８回	5,500,000,000	5,528,435,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３９回	5,200,000,000	5,229,848,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４０回	5,100,000,000	5,132,283,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４１回	5,500,000,000	5,537,180,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	6,116,799,700	
		国庫債券　利付（５年）第１４４回	4,400,000,000	4,436,388,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４５回	5,900,000,000	5,952,097,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４６回	2,100,000,000	2,119,236,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４７回	3,600,000,000	3,618,648,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４８回	3,300,000,000	3,317,292,000	
		国庫債券　利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,416,878,800	
		国庫債券　利付（４０年）第２回	900,000,000	1,265,184,000	
		国庫債券　利付（４０年）第３回	900,000,000	1,270,458,000	
		国庫債券　利付（４０年）第４回	1,130,000,000	1,601,074,400	
		国庫債券　利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,643,604,000	
		国庫債券　利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,754,584,000	
		国庫債券　利付（４０年）第７回	1,400,000,000	1,818,712,000	
		国庫債券　利付（４０年）第８回	1,500,000,000	1,824,465,000	
		国庫債券　利付（４０年）第９回	2,050,000,000	1,871,322,000	
		国庫債券　利付（４０年）第１０回	2,010,000,000	2,142,539,400	
		国庫債券　利付（４０年）第１１回	1,750,000,000	1,808,747,500	
		国庫債券　利付（４０年）第１２回	2,070,000,000	1,929,861,000	
		国庫債券　利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	6,515,262,000	
		国庫債券　利付（４０年）第１４回	2,420,000,000	2,397,736,000	

		国庫債券　利付（１０年）第３２６回	2,100,000,000	2,121,441,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,135,526,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３２８回	5,250,000,000	5,306,805,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,096,900,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,870,262,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,927,531,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	5,996,229,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,665,196,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,732,594,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３５回	4,600,000,000	4,686,388,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３６回	2,750,000,000	2,805,962,500	
		国庫債券　利付（１０年）第３３７回	3,000,000,000	3,041,520,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３８回	5,000,000,000	5,091,100,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３９回	5,000,000,000	5,097,700,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,287,654,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	7,429,137,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４２回	8,550,000,000	8,630,968,500	
		国庫債券　利付（１０年）第３４３回	9,500,000,000	9,595,095,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４４回	7,400,000,000	7,474,222,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４５回	5,000,000,000	5,052,700,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４６回	5,100,000,000	5,156,304,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４７回	5,400,000,000	5,460,750,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	5,868,150,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４９回	2,800,000,000	2,833,404,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５０回	7,150,000,000	7,238,660,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５１回	8,500,000,000	8,606,590,000	
			6,700,000,000	6,787,167,000	

		国庫債券　利付（１０年）第３５２回			
		国庫債券　利付（１０年）第３５３回	4,900,000,000	4,964,239,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５４回	4,350,000,000	4,407,333,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５５回	5,100,000,000	5,165,433,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５６回	4,800,000,000	4,859,712,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,923,579,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５８回	5,470,000,000	5,535,202,400	
		国庫債券　利付（１０年）第３５９回	5,600,000,000	5,661,320,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６０回	7,900,000,000	7,978,210,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６１回	8,400,000,000	8,473,668,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６２回	9,800,000,000	9,874,186,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６３回	4,700,000,000	4,729,657,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１回	500,000,000	613,885,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２回	500,000,000	603,245,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３回	160,000,000	192,358,400	
		国庫債券　利付（３０年）第４回	900,000,000	1,139,634,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５回	150,000,000	181,431,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６回	600,000,000	742,926,000	
		国庫債券　利付（３０年）第７回	600,000,000	741,930,000	
		国庫債券　利付（３０年）第８回	100,000,000	118,971,000	
		国庫債券　利付（３０年）第９回	265,000,000	303,639,650	
		国庫債券　利付（３０年）第１０回	250,000,000	278,240,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１１回	160,000,000	189,491,200	
		国庫債券　利付（３０年）第１２回	220,000,000	271,667,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１３回	290,000,000	355,571,900	
		国庫債券　利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,023,200,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,165,905,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,189,069,950	
		国庫債券　利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,549,608,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１８回	2,200,000,000	2,819,828,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１９回	2,050,000,000	2,634,578,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２０回	1,270,000,000	1,672,196,300	
		国庫債券　利付（３０年）第２１回	300,000,000	387,786,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２２回	600,000,000	794,334,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,115,864,400	

		国庫債券　利付（３０年）第２４回	700,000,000	932,344,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２５回	500,000,000	652,910,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,125,043,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,086,346,500	
		国庫債券　利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,623,744,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,014,230,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,265,012,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,583,844,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,610,568,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	3,102,528,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３４回	2,800,000,000	3,731,504,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	2,992,369,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３６回	2,000,000,000	2,610,960,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	2,968,196,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,039,232,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３９回	1,400,000,000	1,814,610,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,661,205,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,886,745,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	2,014,640,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,638,624,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,766,506,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,073,422,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,196,846,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,114,817,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,281,007,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４９回	2,900,000,000	3,483,161,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５０回	1,900,000,000	2,019,947,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,508,437,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,883,261,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,722,644,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,801,048,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,588,140,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	2,010,314,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,691,728,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,216,256,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,648,256,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,240,229,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６１回	1,000,000,000	1,027,020,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６２回	700,000,000	682,675,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,327,088,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６４回	1,500,000,000	1,417,890,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６５回	1,200,000,000	1,132,464,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６６回	2,600,000,000	2,449,616,000	

		国庫債券　利付（３０年）第６７回	1,300,000,000	1,288,937,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６８回	1,950,000,000	1,930,909,500	
		国庫債券　利付（３０年）第６９回	2,200,000,000	2,232,516,000	
		国庫債券　利付（３０年）第７０回	1,610,000,000	1,631,928,200	
		国庫債券　利付（３０年）第７１回	1,730,000,000	1,751,555,800	
		国庫債券　利付（２０年）第５９回	230,000,000	235,214,100	
		国庫債券　利付（２０年）第６０回	780,000,000	794,765,400	
		国庫債券　利付（２０年）第６１回	300,000,000	305,037,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６２回	440,000,000	447,106,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６３回	300,000,000	310,083,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６４回	400,000,000	416,192,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６５回	455,000,000	475,675,200	
		国庫債券　利付（２０年）第６６回	300,000,000	312,957,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６７回	310,000,000	325,639,500	
		国庫債券　利付（２０年）第６８回	290,000,000	306,805,500	
		国庫債券　利付（２０年）第６９回	560,000,000	591,052,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７０回	540,000,000	577,519,200	
		国庫債券　利付（２０年）第７１回	200,000,000	212,796,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７２回	1,470,000,000	1,568,063,700	
		国庫債券　利付（２０年）第７３回	1,200,000,000	1,282,836,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７４回	800,000,000	857,832,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７５回	600,000,000	646,572,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７６回	910,000,000	974,255,100	
		国庫債券　利付（２０年）第７７回	700,000,000	751,877,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７８回	800,000,000	860,584,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７９回	860,000,000	928,361,400	
		国庫債券　利付（２０年）第８０回	1,400,000,000	1,516,550,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８１回	360,000,000	390,553,200	
		国庫債券　利付（２０年）第８２回	820,000,000	892,881,600	
		国庫債券　利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,499,081,400	
		国庫債券　利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,307,952,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８５回	400,000,000	439,892,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８６回	1,700,000,000	1,884,875,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８７回	500,000,000	552,120,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,226,082,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８９回	470,000,000	521,634,200	
		国庫債券　利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,672,755,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９１回	250,000,000	280,045,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９２回	650,000,000	725,185,500	
		国庫債券　利付（２０年）第９３回	300,000,000	334,686,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９４回	200,000,000	224,228,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９５回	100,000,000	113,795,000	

		国庫債券　利付（２０年）第９６回	400,000,000	450,564,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９７回	300,000,000	341,403,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９８回	300,000,000	339,597,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９９回	1,100,000,000	1,250,865,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１００回	820,000,000	942,278,400	
		国庫債券　利付（２０年）第１０１回	250,000,000	290,545,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０２回	1,500,000,000	1,752,765,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０３回	600,000,000	697,038,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０４回	400,000,000	459,268,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,191,327,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０６回	400,000,000	464,148,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０７回	300,000,000	347,523,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,830,144,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,033,497,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,279,729,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１１回	800,000,000	940,632,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,102,418,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,346,080,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	2,002,549,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,186,250,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,309,913,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,655,234,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１８回	500,000,000	588,710,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１９回	800,000,000	927,912,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２０回	800,000,000	913,896,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２１回	1,200,000,000	1,406,340,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２２回	900,000,000	1,046,646,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２３回	500,000,000	596,780,000	

		国庫債券　利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,184,320,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２５回	1,400,000,000	1,689,086,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２６回	1,200,000,000	1,425,060,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２７回	500,000,000	589,040,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,126,970,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２９回	1,300,000,000	1,523,509,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３０回	1,700,000,000	1,997,840,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３１回	800,000,000	932,192,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,518,608,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,649,690,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,653,946,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３５回	700,000,000	819,672,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３６回	700,000,000	812,378,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,173,790,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３８回	800,000,000	921,976,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,163,130,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,706,065,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,065,946,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,130,823,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,521,507,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,506,739,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,723,936,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,850,048,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４７回	4,000,000,000	4,711,480,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,452,086,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４９回	3,850,000,000	4,502,652,000	
			3,330,000,000	3,858,071,400	

		国庫債券　利付（２０年）第１５０回			
		国庫債券　利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,835,350,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	3,007,962,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５３回	1,600,000,000	1,839,072,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５４回	1,620,000,000	1,841,778,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	5,938,607,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５６回	6,150,000,000	6,300,982,500	
		国庫債券　利付（２０年）第１５７回	6,540,000,000	6,507,365,400	
		国庫債券　利付（２０年）第１５８回	2,770,000,000	2,874,235,100	
		国庫債券　利付（２０年）第１５９回	2,900,000,000	3,049,031,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,450,673,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,204,643,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,783,266,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６３回	2,600,000,000	2,725,034,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,681,692,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,266,528,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,442,830,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,672,098,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,726,730,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６９回	2,530,000,000	2,506,749,300	
		国庫債券　利付（２０年）第１７０回	2,000,000,000	1,978,040,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７１回	1,500,000,000	1,480,785,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７２回	3,840,000,000	3,853,248,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７３回	3,250,000,000	3,255,655,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７４回	3,670,000,000	3,670,000,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７５回	5,500,000,000	5,593,225,000	
			6,020,000,000	6,112,226,400	

		国庫債券　利付（２０年）第１７６回			
		国庫債券　利付（２０年）第１７７回	1,500,000,000	1,493,160,000	
		メキシコ合衆国　第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,233,000	
	小計	銘柄数：266 組入時価比率：79.9%	598,615,000,000	638,777,333,500 80.7%	
	合計			638,777,333,500	
地方債証券	日本円	東京都　公募第７１５回	100,000,000	100,949,000	
		東京都　公募第７１６回	200,000,000	201,930,000	
		東京都　公募第７３１回	100,000,000	101,581,000	
		東京都　公募第７３６回	100,000,000	101,513,000	
		東京都　公募第７４５回	300,000,000	305,988,000	
		東京都　公募第７６０回	100,000,000	100,224,000	
		東京都　公募第７６１回	100,000,000	100,374,000	
		東京都　公募第７６９回	500,000,000	505,155,000	
		東京都　公募第７７８回	100,000,000	100,807,000	
		東京都　公募（３０年）第７回	100,000,000	134,625,000	
		東京都　公募第１０回	200,000,000	264,960,000	
		東京都　公募第１回	300,000,000	308,061,000	
		東京都　公募（２０年）第３回	200,000,000	211,652,000	
		東京都　公募第７回	100,000,000	108,696,000	
		東京都　公募（２０年）第１３回	100,000,000	113,110,000	
		東京都　公募（２０年）第１６回	200,000,000	228,294,000	
		東京都　公募（２０年）第１７回	200,000,000	229,450,000	
		東京都　公募第２３回	100,000,000	118,499,000	
		東京都　公募（２０年）第２６回	100,000,000	116,867,000	
		東京都　公募（２０年）第２９回	200,000,000	232,248,000	
		東京都　公募（５年）第３１回	300,000,000	300,039,000	
		北海道　公募平成２４年度第９回	100,000,000	100,868,000	
		北海道　公募平成２５年度第１回	300,000,000	302,751,000	
		北海道　公募平成２６年度第１３回	100,000,000	101,487,000	
		北海道　公募平成２７年度第７回	100,000,000	102,061,000	
		北海道　公募平成２９年度第５回	200,000,000	201,612,000	
		北海道　公募平成２９年度第７回	100,000,000	101,007,000	
		北海道　公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,911,000	
		北海道　公募平成３０年度第１５回	269,280,000	270,198,244	
		北海道　公募令和２年度第４回	300,000,000	301,953,000	
		宮城県　公募第３１回１号	300,000,000	306,213,000	
		宮城県　公募第３２回２号	100,000,000	100,527,000	
		神奈川県　公募第１９６回	100,000,000	101,008,000	
		神奈川県　公募第２００回	100,000,000	101,647,000	
		神奈川県　公募第２０５回	100,000,000	101,653,000	

		神奈川県　公募第２０６回	100,000,000	101,795,000	
		神奈川県　公募第２１０回	200,000,000	202,928,000	
		神奈川県　公募第２１２回	100,000,000	101,465,000	
		神奈川県　公募第２３１回	200,000,000	202,178,000	
		神奈川県　公募第２４７回	200,000,000	200,782,000	
		神奈川県　公募（３０年）第3回	100,000,000	134,150,000	
		神奈川県　公募第７回	300,000,000	336,192,000	
		神奈川県　公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,597,000	
		神奈川県　公募（２０年）第１７回	200,000,000	236,160,000	
		神奈川県　公募（２０年）第２６回	100,000,000	115,589,000	
		大阪府　公募第３７８回	104,000,000	105,579,760	
		大阪府　公募第３８１回	100,000,000	101,652,000	
		大阪府　公募第３８２回	100,000,000	101,682,000	
		大阪府　公募第３８３回	100,000,000	101,790,000	
		大阪府　公募第３８４回	100,000,000	101,785,000	
		大阪府　公募第３８７回	300,000,000	304,542,000	
		大阪府　公募第３８９回	100,000,000	101,631,000	
		大阪府　公募第３９６回	200,000,000	204,042,000	
		大阪府　公募第４１７回	102,000,000	103,205,640	
		大阪府　公募第４２３回	100,000,000	100,859,000	
		大阪府　公募第４２９回	179,000,000	180,670,070	
		大阪府　公募第４５２回	100,000,000	99,892,000	
		大阪府　公募第５回	100,000,000	117,978,000	
		大阪府　公募第８回	100,000,000	117,084,000	
		大阪府　公募（５年）第１７３回	200,000,000	199,968,000	
		大阪府　公募（５年）第１７４回	200,000,000	199,968,000	
		大阪府　公募（５年）第１７８回	400,000,000	399,928,000	
		京都府　公募平成２４年度第６回	100,000,000	100,863,000	
		京都府　公募平成２５年度第１５回	200,000,000	203,286,000	
		京都府　公募平成２６年度第５回	100,000,000	115,408,000	
		京都府　公募平成２６年度第７回	200,000,000	203,376,000	
		京都府　公募（２０年）平成２７年度第５回	200,000,000	225,724,000	
		京都府　公募（１５年）平成２７年度第８回	100,000,000	106,242,000	
		京都府　公募（１５年）平成２８年度第２回	200,000,000	201,896,000	
		京都府　公募（２０年）平成２８年度第５回	100,000,000	100,101,000	
		京都府　公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,917,000	
		兵庫県　公募平成２６年度第１７回	100,000,000	101,579,000	
		兵庫県　公募平成２９年度第２２回	100,000,000	100,927,000	
		兵庫県　公募（３０年）第２回	200,000,000	267,698,000	
		兵庫県　公募（１５年）第１回	300,000,000	324,348,000	

		兵庫県　公募（１５年）第３回	200,000,000	215,326,000	
		兵庫県　公募（１２年）第３回	300,000,000	305,991,000	
		兵庫県　公募（１５年）第１１回	100,000,000	105,558,000	
		兵庫県　公募第２回	100,000,000	113,987,000	
		兵庫県　公募第９回	100,000,000	117,732,000	
		兵庫県　公募（２０年）第１１回	200,000,000	231,098,000	
		兵庫県　公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,368,000	
		兵庫県　公募（２０年）第２２回	100,000,000	114,735,000	
		静岡県　公募平成２４年度第１０回	100,000,000	101,015,000	
		静岡県　公募平成２５年度第５回	101,000,000	102,721,040	
		静岡県　公募平成２６年度第３回	165,000,000	168,001,350	
		静岡県　公募平成２６年度第８回	100,000,000	101,698,000	
		静岡県　公募平成２６年度第９回	200,000,000	203,424,000	
		静岡県　公募平成２７年度第１１回	115,400,000	115,968,922	
		静岡県　公募平成２８年度第２回	300,000,000	301,077,000	
		静岡県　公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,822,000	
		静岡県　公募（３１年）第１回	174,000,000	174,582,900	
		静岡県　公募（５年）令和３年度第２回	100,000,000	100,044,000	
		静岡県　公募（１５年）第２回	200,000,000	215,818,000	
		静岡県　公募（１５年）第５回	200,000,000	214,800,000	
		静岡県　公募（１５年）第９回	100,000,000	105,790,000	
		静岡県　公募（２０年）第１１回	100,000,000	115,857,000	
		静岡県　公募（２０年）第１４回	200,000,000	233,650,000	
		静岡県　公募（２０年）第１８回	100,000,000	115,605,000	
		静岡県　公募（２０年）第３０回	200,000,000	200,110,000	
		愛知県　公募平成２０年度第８回	100,000,000	114,364,000	
		愛知県　公募（２０年）平成２２年度第８回	200,000,000	232,170,000	
		愛知県　公募（２０年）平成２４年度第４回	100,000,000	116,278,000	
		愛知県　公募（１５年）平成２４年度第１４回	400,000,000	431,516,000	
		愛知県　公募平成２４年度第１７回	100,000,000	118,524,000	
		愛知県　公募（３０年）平成２５年度第８回	120,000,000	156,620,400	
		愛知県　公募平成２６年度第８回	100,000,000	126,569,000	
		愛知県　公募平成２６年度第１３回	100,000,000	114,393,000	
		愛知県　公募平成２６年度第１７回	300,000,000	304,767,000	
		愛知県　公募（１５年）平成２７年度第２回	300,000,000	317,163,000	
		愛知県　公募平成２７年度第１５回	100,000,000	101,970,000	
		愛知県　公募平成２９年度第８回	100,000,000	101,008,000	
		愛知県　公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,716,000	
		愛知県　公募平成３０年度第７回	200,000,000	201,914,000	

		広島県　公募平成２４年度第４回	100,000,000	100,963,000	
		広島県　公募平成２５年度第３回	200,000,000	203,216,000	
		広島県　公募平成２６年度第５回	109,650,000	110,861,632	
		広島県　公募平成２６年度第７回	200,000,000	203,226,000	
		広島県　公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,629,000	
		広島県　公募平成２９年度第４回	211,300,000	213,575,701	
		広島県　公募平成３０年度第６回	300,000,000	300,144,000	
		広島県　公募令和２年度第２回	100,000,000	100,745,000	
		広島県　公募令和２年度第７回	300,000,000	303,213,000	
		埼玉県　公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,693,000	
		埼玉県　公募平成２５年度第６回	148,000,000	150,405,000	
		埼玉県　公募平成２５年度第１０回	100,000,000	101,630,000	
		埼玉県　公募平成２５年度第１１回	100,000,000	101,643,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第３回	100,000,000	101,782,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第６回	200,000,000	203,338,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第７回	400,000,000	406,204,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第９回	100,000,000	101,471,000	
		埼玉県　公募平成２７年度第９回	100,000,000	101,041,000	
		埼玉県　公募平成２８年度第５回	100,000,000	100,242,000	
		埼玉県　公募平成３０年度第４回	200,000,000	202,224,000	
		埼玉県　公募平成３０年度第７回	200,000,000	200,082,000	
		埼玉県　公募令和２年度第４回	300,000,000	301,821,000	
		埼玉県　公募（１５年）第１回	100,000,000	107,035,000	
		埼玉県　公募（１５年）第２回	200,000,000	213,758,000	
		埼玉県　公募（１５年）第３回	100,000,000	102,969,000	
		埼玉県　公募（２５年）第２回	200,000,000	210,682,000	
		埼玉県　公募（３０年）第９回	200,000,000	209,298,000	
		埼玉県　公募（２０年）第６回	100,000,000	115,492,000	
		埼玉県　公募（２０年）第１６回	100,000,000	112,667,000	
		埼玉県　公募（２０年）第２０回	100,000,000	104,177,000	
		福岡県　公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,806,000	
		福岡県　公募平成２７年度第１回	300,000,000	306,522,000	
		福岡県　公募平成２９年度第１回	100,000,000	100,976,000	
		福岡県　公募平成２３年度第１回	100,000,000	107,616,000	
		福岡県　公募（１５年）平成２７年度第１回	200,000,000	212,630,000	
		福岡県　公募（１５年）令和元年度第１回	100,000,000	100,248,000	
		福岡県　公募（３０年）平成１９年度第１回	100,000,000	134,979,000	
		福岡県　公募（３０年）平成２６年度第１回	100,000,000	126,834,000	
		福岡県　公募（３０年・定時償還）平成２９年度第２回	100,000,000	107,039,000	
			300,000,000	345,858,000	

		福岡県　公募（２０年）平成２０年度第１回			
		福岡県　公募（２０年）平成２０年度第２回	100,000,000	114,436,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２２年度第１回	300,000,000	344,832,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２２年度第２回	300,000,000	356,079,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２４年度第２回	100,000,000	115,861,000	
		千葉県　公募平成２４年度第７回	100,000,000	100,939,000	
		千葉県　公募平成２４年度第８回	100,000,000	101,129,000	
		千葉県　公募平成２５年度第３回	100,000,000	101,560,000	
		千葉県　公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,693,000	
		千葉県　公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,759,000	
		千葉県　公募平成２６年度第３回	200,000,000	203,470,000	
		千葉県　公募平成２７年度第６回	200,000,000	203,996,000	
		千葉県　公募平成２８年度第４回	200,000,000	200,850,000	
		千葉県　公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,629,000	
		千葉県　公募平成２９年度第８回	100,000,000	101,037,000	
		千葉県　公募（２０年）第１回	400,000,000	435,372,000	
		千葉県　公募（２０年）第８回	100,000,000	118,029,000	
		千葉県　公募（２０年）第１３回	200,000,000	233,498,000	
		千葉県　公募（２０年）第１６回	200,000,000	232,912,000	
		千葉県　公募（２０年）第１７回	100,000,000	114,879,000	
		長野県　公募令和３年度第１回	300,000,000	302,415,000	
		群馬県　公募第１２回	100,000,000	102,023,000	
		群馬県　公募（２０年）第３回	100,000,000	116,273,000	
		岐阜県　公募平成２６年度第１回	186,670,000	189,796,722	
		共同発行市場地方債　公募第１１５回	100,000,000	100,873,000	
		共同発行市場地方債　公募第１１６回	200,000,000	201,880,000	
		共同発行市場地方債　公募第１１８回	100,000,000	101,129,000	
		共同発行市場地方債　公募第１１９回	200,000,000	202,260,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２０回	300,000,000	303,060,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２１回	100,000,000	100,900,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２２回	400,000,000	404,140,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２４回	300,000,000	305,025,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２６回	100,000,000	101,628,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２８回	700,000,000	710,045,000	

		共同発行市場地方債　公募第１２９回	100,000,000	101,604,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３０回	100,000,000	101,782,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３２回	100,000,000	101,654,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３６回	200,000,000	203,470,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３７回	500,000,000	508,265,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３９回	155,000,000	157,607,100	
		共同発行市場地方債　公募第１４３回	540,000,000	548,294,400	
		共同発行市場地方債　公募第１４５回	1,000,000,000	1,014,580,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５２回	400,000,000	408,288,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５４回	300,000,000	305,271,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５６回	200,000,000	200,900,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５７回	300,000,000	301,101,000	
		共同発行市場地方債　公募第１６１回	300,000,000	300,885,000	
		共同発行市場地方債　公募第１７２回	600,000,000	606,810,000	
		共同発行市場地方債　公募第１８４回	100,000,000	100,920,000	
		共同発行市場地方債　公募第１８６回	400,000,000	405,584,000	
		共同発行市場地方債　公募第１８８回	300,000,000	304,587,000	
		共同発行市場地方債　公募第１９０回	610,000,000	614,904,400	
		共同発行市場地方債　公募第１９１回	100,000,000	100,665,000	
		共同発行市場地方債　公募第２００回	100,000,000	100,040,000	
		共同発行市場地方債　公募第２１３回	300,000,000	300,687,000	
		共同発行市場地方債　公募第２１５回	400,000,000	401,304,000	
		堺市　公募平成２２年度第１回	100,000,000	117,023,000	
		堺市　公募平成２６年度第１回	100,000,000	123,240,000	
		島根県　公募（３０年）平成２９年度第１回	100,000,000	106,761,000	
		佐賀県　公募平成２８年度第１回	100,000,000	100,311,000	
		福島県　公募平成２６年度第１回	200,000,000	203,154,000	
		滋賀県　公募平成２５年度第１回	100,000,000	101,422,000	

		滋賀県　公募平成２６年度第１回	142,000,000	144,239,340	
		栃木県　公募平成２４年度第１回	100,000,000	100,945,000	
		栃木県　公募平成２５年度第１回	100,000,000	101,422,000	
		熊本市　公募平成２９年度第１回	100,000,000	100,895,000	
		新潟市　公募平成２５年度第１回	233,200,000	236,998,828	
		新潟市　公募平成２９年度第１回	100,000,000	101,030,000	
		浜松市　公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,118,000	
		大阪市　公募平成２５年度第６回	100,000,000	101,505,000	
		大阪市　公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,788,000	
		大阪市　公募平成２７年度第６回	100,000,000	101,967,000	
		大阪市　公募令和３年度第２回	300,000,000	301,290,000	
		大阪市　公募（１５年）第１回	100,000,000	108,493,000	
		大阪市　公募（２０年）第１回	300,000,000	341,487,000	
		大阪市　公募（２０年）第５回	100,000,000	116,957,000	
		大阪市　公募（２０年）第６回	100,000,000	115,591,000	
		大阪市　公募（２０年）第１７回	100,000,000	117,118,000	
		大阪市　公募（２０年）第２６回	100,000,000	104,340,000	
		名古屋市　公募第４８１回	100,000,000	100,930,000	
		名古屋市　公募第４８８回	300,000,000	305,376,000	
		名古屋市　公募第４８９回	100,000,000	101,496,000	
		名古屋市　公募第５０１回	200,000,000	201,560,000	
		名古屋市　公募第５０３回	100,000,000	101,070,000	
		名古屋市　公募第５０４回	200,000,000	202,218,000	
		名古屋市　公募第５１１回	200,000,000	200,168,000	
		名古屋市　公募第５１２回	300,000,000	301,953,000	
		名古屋市　公募（１２年）第１回	200,000,000	207,736,000	
		名古屋市　公募（１５年）第２回	100,000,000	106,810,000	
		京都市　公募平成２９年度第１回	100,000,000	101,064,000	
		京都市　公募平成２９年度第４回	101,280,000	102,515,616	
		京都市　公募（２０年）第２回	100,000,000	108,543,000	
		京都市　公募（２０年）第５回	200,000,000	224,500,000	
		京都市　公募（２０年）第６回	100,000,000	114,047,000	
		京都市　公募（２０年）第１３回	100,000,000	114,371,000	
		京都市　公募（２０年）第１５回	200,000,000	204,690,000	
		神戸市　公募平成２６年度第１７回	300,000,000	302,814,000	
		神戸市　公募平成２８年度第１回	200,000,000	200,730,000	
		神戸市　公募平成３０年度第２回	200,000,000	209,298,000	
		横浜市　公募公債平成２４年度２回	200,000,000	201,740,000	
		横浜市　公募公債平成２５年度１回	200,000,000	202,176,000	
		横浜市　公募公債平成２５年度５回	200,000,000	202,824,000	
		横浜市　公募公債平成２６年度５回	200,000,000	203,040,000	
		横浜市　公募平成２８年度第５回	300,000,000	303,405,000	
		横浜市　公募平成２９年度第３回	100,000,000	101,117,000	

		横浜市　公募（３０年）第２回	200,000,000	258,982,000	
		横浜市　公募（２０年）第１８回	100,000,000	116,506,000	
		横浜市　公募（２０年）第２６回	100,000,000	117,886,000	
		横浜市　公募（２０年）第３０回	100,000,000	114,558,000	
		札幌市　公募（１５年）平成２３年度第９回	200,000,000	215,874,000	
		札幌市　公募（２０年）平成２４年度第１回	100,000,000	117,212,000	
		札幌市　公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	118,219,000	
		札幌市　公募平成２６年度第４回	100,000,000	101,482,000	
		札幌市　公募平成２６年度第９回	200,000,000	202,792,000	
		川崎市　公募第８５回	100,000,000	100,901,000	
		川崎市　公募（２０年）第１７回	100,000,000	115,347,000	
		川崎市　公募（２０年）第１９回	100,000,000	114,292,000	
		川崎市　公募（３０年）第１１回	100,000,000	104,015,000	
		北九州市　公募（１０年）令和２年度第２回	200,000,000	200,274,000	
		北九州市　公募（２０年）第３回	200,000,000	227,410,000	
		北九州市　公募（２０年）第１４回	100,000,000	117,012,000	
		福岡市　公募（２０年）平成２１年度第３回	200,000,000	233,168,000	
		福岡市　公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	117,329,000	
		福岡市　公募平成２６年度第２回	100,000,000	115,750,000	
		福岡市　公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,671,000	
		福岡市　公募平成２６年度第８回	160,000,000	162,608,000	
		広島市　公募平成２６年度第２回	100,000,000	101,486,000	
		広島市　公募平成２７年度第２回	500,000,000	509,880,000	
		広島市　公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	242,708,690	
		千葉市　公募平成２６年度第２回	200,000,000	203,214,000	
		三重県　公募平成２４年度第１回	140,660,000	141,889,368	
		三重県　公募平成２８年度第１回	155,000,000	156,179,550	
		福井県　公募平成２４年度第４回	100,000,000	100,733,000	
		福井県　公募平成２７年度第４回	200,000,000	200,780,000	
		徳島県　公募平成２９年度第２回	200,000,000	201,790,000	
		徳島県　公募平成３０年度第２回	300,000,000	304,593,000	
		山梨県　公募平成２４年度第１回	200,000,000	201,760,000	
		岡山県　公募平成２８年度第２回	168,900,000	170,528,196	
		岡山県　公募令和２年度第３回	300,000,000	303,366,000	
		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	115,199,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券　第１０２回	300,000,000	350,901,000	
			100,000,000	114,710,000	

		福岡北九州高速道路債券　第１１７回			
		福岡北九州高速道路債券　第１３６回	100,000,000	105,239,000	
	小計	銘柄数：296 組入時価比率：6.8%	51,732,340,000	54,269,004,869 6.9%	
	合計			54,269,004,869	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫　第４回円貨債券（２０１４）	100,000,000	101,625,000	
		新関西国際空港債券　政府保証第２回	191,000,000	194,038,810	
		新関西国際空港債券　政府保証第５回	117,000,000	117,870,480	
		新関西国際空港社債　財投機関債第６回	300,000,000	328,314,000	
		新関西国際空港社債　財投機関債第９回	100,000,000	108,251,000	
		新関西国際空港社債　財投機関債第１２回	100,000,000	107,669,000	
		新関西国際空港社債　財投機関債第２２回	200,000,000	200,112,000	
		原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券　政府保証第１６回	700,000,000	700,091,000	
		日本政策投資銀行債券　政府保証第２２回	100,000,000	103,868,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第４７回	100,000,000	107,480,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第６６回	400,000,000	401,368,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第７８回	200,000,000	201,772,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第８２回	100,000,000	101,186,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第８６回	300,000,000	302,985,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第９６回	200,000,000	201,692,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第１３７回	400,000,000	400,268,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第１３８回	400,000,000	400,736,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第１９回	159,000,000	160,620,210	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第３７回	400,000,000	401,568,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第３８回	1,500,000,000	1,500,450,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第４２回	300,000,000	302,709,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第５２回	300,000,000	299,958,000	

		日本政策投資銀行社債　政府保証第５５回	300,000,000	302,019,000	
		道路債券　財投機関債第１７回	300,000,000	305,739,000	
		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	131,458,000	
		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	221,852,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１７回	100,000,000	111,646,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第２３回	300,000,000	340,485,000	
		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	306,270,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第３９回	200,000,000	231,940,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第４７回	100,000,000	117,589,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第８９回	100,000,000	116,070,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１００回	200,000,000	201,942,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０２回	100,000,000	100,989,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０３回	350,000,000	408,096,500	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０５回	100,000,000	118,427,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０７回	100,000,000	101,623,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１１６回	400,000,000	405,644,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１２２回	100,000,000	101,715,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１２３回	100,000,000	101,680,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１３０回	200,000,000	202,990,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１３４回	200,000,000	202,820,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１３６回	200,000,000	203,402,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１４５回	300,000,000	357,210,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１４９回	100,000,000	120,787,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１５７回	100,000,000	106,514,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１６４回	100,000,000	111,327,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１７３回	100,000,000	93,350,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１８８回	100,000,000	103,528,000	

		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第２６０回	200,000,000	195,750,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９０回	100,000,000	116,600,000	
		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	233,574,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９７回	200,000,000	234,134,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９９回	200,000,000	236,086,000	
		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	235,420,000	
		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	232,614,000	
		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	130,054,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１６５回	100,000,000	125,991,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１６９回	100,000,000	115,971,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１７１回	100,000,000	115,236,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１７２回	300,000,000	383,931,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１７３回	200,000,000	201,710,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１７５回	200,000,000	201,792,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８０回	200,000,000	201,912,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８２回	900,000,000	910,458,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８３回	100,000,000	117,472,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８９回	196,000,000	197,760,080	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１９０回	400,000,000	404,228,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１９３回	1,000,000,000	1,015,990,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１９７回	272,000,000	276,515,200	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２０７回	300,000,000	304,746,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１１回	137,000,000	139,219,400	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１３回	145,000,000	147,372,200	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１６回	100,000,000	115,695,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１７回	100,000,000	124,733,000	
			100,000,000	115,748,000	

		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１９回			
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２０回	300,000,000	305,385,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２４回	100,000,000	124,846,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２５回	190,000,000	193,131,200	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２９回	630,000,000	640,464,300	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２３４回	100,000,000	101,505,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２３９回	500,000,000	559,925,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２４１回	200,000,000	203,136,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２５８回	400,000,000	406,260,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２６１回	401,000,000	407,307,730	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２７１回	151,000,000	151,101,170	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２９７回	100,000,000	100,394,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３０６回	403,000,000	406,002,350	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３１５回	100,000,000	100,692,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３２１回	600,000,000	605,166,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３２４回	100,000,000	100,481,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３３５回	100,000,000	104,856,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３３９回	500,000,000	505,910,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３４２回	131,000,000	132,108,260	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３５１回	100,000,000	100,879,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３５４回	200,000,000	201,574,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３５７回	100,000,000	101,345,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継　財投機関債第２８回	400,000,000	523,864,000	
		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	133,016,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継　財投機関債第３８回	1,000,000,000	1,067,250,000	
		公営企業債券　３０年第４回財投機関債	100,000,000	133,205,000	
			100,000,000	114,415,000	

		地方公営企業等金融機構債券（２０年）　第１回			
		地方公共団体金融機構債券　２０年第４回	100,000,000	116,702,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１６回	100,000,000	110,520,000	
		地方公共団体金融機構債券　２０年第６回	300,000,000	354,534,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ２４回	100,000,000	102,490,000	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第１０回	300,000,000	344,019,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１０４回	100,000,000	104,489,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１０６回	100,000,000	103,096,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１２２回	100,000,000	107,763,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１２４回	100,000,000	107,745,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１３２回	500,000,000	520,705,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４１回	102,000,000	102,884,340	
		地方公共団体金融機構債券　第４１回	600,000,000	605,238,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１４２回	100,000,000	103,188,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１４５回	200,000,000	207,284,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１４７回	100,000,000	106,765,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４２回	108,000,000	109,019,520	
		地方公共団体金融機構債券　第４２回	100,000,000	100,943,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４３回	202,000,000	203,878,600	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４４回	145,000,000	146,647,200	
		地方公共団体金融機構債券　第４４回	100,000,000	101,063,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４５回	223,000,000	225,622,480	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１６０回	100,000,000	106,559,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４８回	500,000,000	505,155,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券第４９回	13,000,000	13,203,320	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第２９回	100,000,000	117,401,000	
			100,000,000	101,686,000	

		政保　地方公共団体金融機構債券　第５０回			
		地方公共団体金融機構債券　第５１回	600,000,000	609,702,000	
		地方公共団体金融機構債券　第５２回	300,000,000	304,884,000	
		地方公共団体金融機構債券（１５年）　第２回	200,000,000	215,774,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第５６回	591,000,000	601,342,500	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第５９回	116,000,000	117,997,520	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第３８回	100,000,000	115,406,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ２４０回	300,000,000	324,858,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第６４回	100,000,000	101,634,000	
		地方公共団体金融機構債券　第６４回	100,000,000	101,685,000	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第３９回	100,000,000	114,750,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第６５回	400,000,000	406,552,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第６９回	320,000,000	324,460,800	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第７２回	189,000,000	192,492,720	
		地方公共団体金融機構債券　第７４回	300,000,000	305,817,000	
		地方公共団体金融機構債券　第７７回	100,000,000	101,950,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第７８回	509,000,000	516,955,670	
		地方公共団体金融機構債券　第７９回	400,000,000	407,988,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券（８年）　第５回	500,000,000	502,095,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第８３回	116,000,000	116,078,880	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第９１回	300,000,000	301,176,000	
		地方公共団体金融機構債券　第９５回	200,000,000	201,618,000	
		地方公共団体金融機構債券　第１０１回	400,000,000	404,252,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第１０８回	157,000,000	158,356,480	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第１１０回	100,000,000	100,783,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第１１３回	110,000,000	111,582,900	
			100,000,000	101,802,000	

		公営企業債券（２０年）　第２回財投機関債			
		公営企業債券（２０年）　第５回財投機関債	200,000,000	208,366,000	
		公営企業債券（２０年）　第１９回財投機関債	100,000,000	112,126,000	
		公営企業債券（２０年）　第２０回財投機関債	100,000,000	112,043,000	
		公営企業債券（２０年）　第２４回財投機関債	100,000,000	114,637,000	
		公営企業債券（２０年）　第２５回財投機関債	100,000,000	116,347,000	
		都市再生債券　財投機関債第９６回	200,000,000	203,498,000	
		都市再生債券　財投機関債第９７回	100,000,000	107,400,000	
		都市再生債券　財投機関債第１０１回	100,000,000	106,846,000	
		都市再生債券　財投機関債第１０９回	100,000,000	107,042,000	
		都市再生債券　財投機関債第１１３回	300,000,000	319,797,000	
		都市再生債券　財投機関債第１２１回	200,000,000	206,642,000	
		都市再生債券　財投機関債第１２７回	100,000,000	100,299,000	
		本州四国連絡橋債券　財投機関債第７回	100,000,000	108,301,000	
		民間都市開発推進機構　政府保証第１６回	360,000,000	365,266,800	
		民間都市開発推進機構　政府保証第１７回	400,000,000	402,480,000	
		東京交通債券　第３４７回	157,000,000	164,694,570	
		関西国際空港債券　政府保証第５４回	300,000,000	348,255,000	
		中部国際空港債券　政府保証第１８回	368,000,000	371,797,760	
		中部国際空港債券　政府保証第２２回	300,000,000	300,042,000	
		預金保険機構債券　政府保証第２３０回	600,000,000	601,806,000	
		預金保険機構債券　政府保証第２３１回	300,000,000	300,864,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第３回	400,000,000	448,028,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第６回	200,000,000	227,388,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１８回	100,000,000	104,263,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第４２回	100,000,000	106,715,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第４９回	100,000,000	117,408,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第５９回	100,000,000	116,544,000	

		住宅金融支援機構債券　財投機関債第７５回	100,000,000	118,473,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第７７回	300,000,000	324,678,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第７８回	100,000,000	118,406,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第８５回	200,000,000	233,322,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第９０回	200,000,000	216,038,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１２０回	100,000,000	117,827,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１２３回	100,000,000	117,270,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１２８回	100,000,000	133,171,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１３２回	200,000,000	213,188,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１３７回	100,000,000	108,322,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１４３回	100,000,000	107,863,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１７７回	250,000,000	254,972,500	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１８８回	300,000,000	301,047,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１９８回	300,000,000	301,488,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第２２３回	100,000,000	102,108,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第２４４回	130,000,000	131,777,100	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第３０１回	300,000,000	300,315,000	
		成田国際空港　第１３回一般担保付	200,000,000	202,178,000	
		成田国際空港　第１７回	400,000,000	406,124,000	
		沖縄振興開発金融公庫債券　財投機関債第６回	200,000,000	215,158,000	
		商工債券　利付第８１１回い号	300,000,000	300,546,000	
		商工債券　利付第８１５回い号	100,000,000	100,224,000	
		商工債券　利付第８１８回い号	100,000,000	100,249,000	
		商工債券　利付第８１９回い号	300,000,000	300,837,000	
		商工債券　利付第８２９回い号	200,000,000	200,524,000	
		商工債券　利付第８３１回い号	200,000,000	200,262,000	
		商工債券　利付第８３３回い号	100,000,000	100,015,000	
		商工債券　利付第８４５回い号	300,000,000	300,672,000	
		しんきん中金債券　利付第３３５回	200,000,000	200,180,000	
		しんきん中金債券　利付第３７４回	300,000,000	300,258,000	
		商工債券　利付（１０年）第１５回	200,000,000	203,306,000	

		国際協力機構債券　第６回財投機関債	200,000,000	236,304,000	
		東日本高速道路　第６１回	200,000,000	200,702,000	
		中日本高速道路　第６３回	100,000,000	102,217,000	
		中日本高速道路　第７９回	300,000,000	300,042,000	
		西日本高速道路　第２０回	200,000,000	202,930,000	
		西日本高速道路　第２２回	400,000,000	407,104,000	
		西日本高速道路　第２３回	100,000,000	101,554,000	
		西日本高速道路　第３０回	300,000,000	301,815,000	
		西日本高速道路　第５０回	200,000,000	200,026,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第５７回	300,000,000	304,344,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第６２回	100,000,000	101,570,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第６８回	200,000,000	203,276,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第６９回	100,000,000	114,783,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第７１回	500,000,000	508,110,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第９０回	300,000,000	301,575,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第１３５回	300,000,000	300,501,000	
		貸付債権担保第１９回住宅金融公庫債券	51,380,000	51,709,859	
		貸付債権担保第５回Ｓ種住宅金融公庫債券	29,907,000	29,936,009	
		貸付債権担保第４２回住宅金融公庫債券	33,366,000	34,029,649	
		貸付債権担保第７回Ｓ種住宅金融公庫債券	10,443,000	10,541,164	
		貸付債権担保第３９回住宅金融公庫債券	22,852,000	23,302,641	
		貸付債権担保第４０回住宅金融公庫債券	26,334,000	27,238,572	
		貸付債権担保第１５回住宅金融公庫債券	28,497,000	28,516,092	
		貸付債権担保第３２回住宅金融公庫債券	47,212,000	48,033,960	
		貸付債権担保第２０回住宅金融公庫債券	50,905,000	51,318,348	
		貸付債権担保第４４回住宅金融公庫債券	44,840,000	45,717,070	
		貸付債権担保第８回住宅金融支援機構債券	73,800,000	75,718,062	
		貸付債権担保第７回住宅金融支援機構債券	12,584,000	12,961,520	
		貸付債権担保第２５回住宅金融支援機構債券	19,156,000	20,455,926	
			63,492,000	67,524,376	

		貸付債権担保第２８回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保Ｓ種第１６回住宅金融支援機構債券	9,994,000	10,055,163	
		貸付債権担保第４２回住宅金融支援機構債券	59,770,000	62,863,097	
		貸付債権担保Ｓ種第１７回住宅金融支援機構債券	20,150,000	20,282,587	
		貸付債権担保第４５回住宅金融支援機構債券	71,436,000	75,462,847	
		貸付債権担保第５２回住宅金融支援機構債券	56,278,000	59,143,675	
		貸付債権担保第２４回住宅金融支援機構債券	34,716,000	36,886,444	
		貸付債権担保第４８回住宅金融支援機構債券	67,056,000	70,764,196	
		貸付債権担保第４０回住宅金融支援機構債券	75,591,000	78,901,885	
		貸付債権担保第６２回住宅金融支援機構債券	118,296,000	124,061,747	
		貸付債権担保第６０回住宅金融支援機構債券	113,112,000	119,079,789	
		貸付債権担保第６１回住宅金融支援機構債券	73,646,000	77,295,159	
		貸付債権担保第５１回住宅金融支援機構債券	25,360,000	26,661,728	
		貸付債権担保第４３回住宅金融支援機構債券	58,596,000	62,033,241	
		貸付債権担保第７９回住宅金融支援機構債券	38,078,000	39,720,684	
		貸付債権担保第８１回住宅金融支援機構債券	83,586,000	87,262,948	
		貸付債権担保第７２回住宅金融支援機構債券	37,033,000	38,629,122	
		貸付債権担保第２２回住宅金融公庫債券	20,978,000	21,140,999	
		貸付債権担保第７０回住宅金融支援機構債券	112,197,000	117,851,728	
		貸付債権担保第３３回住宅金融支援機構債券	23,807,000	25,343,741	
		貸付債権担保第３４回住宅金融支援機構債券	25,418,000	27,084,658	
		貸付債権担保第３５回住宅金融支援機構債券	23,602,000	25,063,907	
		貸付債権担保第４６回住宅金融支援機構債券	23,584,000	24,956,824	
		貸付債権担保第５５回住宅金融支援機構債券	72,276,000	76,233,111	
		貸付債権担保第５６回住宅金融支援機構債券	102,666,000	108,183,270	
		貸付債権担保第５７回住宅金融支援機構債券	34,440,000	36,322,146	
			72,686,000	76,185,830	

		貸付債権担保第７６回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保Ｓ種第３回住宅金融公庫債券	9,609,000	9,616,687	
		貸付債権担保第２３回住宅金融支援機構債券	68,276,000	72,266,732	
		貸付債権担保第３２回住宅金融支援機構債券	69,177,000	73,376,735	
		貸付債権担保第３９回住宅金融支援機構債券	124,345,000	130,410,549	
		貸付債権担保第５８回住宅金融支援機構債券	76,250,000	80,477,300	
		貸付債権担保第６４回住宅金融支援機構債券	125,406,000	131,421,725	
		貸付債権担保第７１回住宅金融支援機構債券	108,666,000	113,268,005	
		貸付債権担保第７３回住宅金融支援機構債券	85,170,000	89,916,524	
		貸付債権担保第７５回住宅金融支援機構債券	71,770,000	75,401,562	
		貸付債権担保第８３回住宅金融支援機構債券	176,416,000	184,037,171	
		貸付債権担保第８４回住宅金融支援機構債券	303,226,000	315,882,653	
		貸付債権担保第８８回住宅金融支援機構債券	46,688,000	48,479,885	
		貸付債権担保第８９回住宅金融支援機構債券	48,228,000	50,129,147	
		貸付債権担保第９０回住宅金融支援機構債券	49,383,000	51,141,528	
		貸付債権担保第９２回住宅金融支援機構債券	103,510,000	106,533,527	
		貸付債権担保第９３回住宅金融支援機構債券	110,004,000	112,403,187	
		貸付債権担保第９４回住宅金融支援機構債券	57,907,000	59,800,558	
		貸付債権担保第９６回住宅金融支援機構債券	61,488,000	63,336,329	
		貸付債権担保第９７回住宅金融支援機構債券	183,483,000	189,908,574	
		貸付債権担保第９８回住宅金融支援機構債券	189,501,000	196,914,279	
		貸付債権担保第９９回住宅金融支援機構債券	127,116,000	131,960,390	
		貸付債権担保第１００回住宅金融支援機構債券	61,714,000	63,935,704	
		貸付債権担保第１０１回住宅金融支援機構債券	62,686,000	65,115,709	
		貸付債権担保第１１５回住宅金融支援機構債券	235,176,000	237,767,639	
		貸付債権担保第１１６回住宅金融支援機構債券	157,608,000	160,038,315	
			159,172,000	161,389,265	

		貸付債権担保第１１７回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第１１８回住宅金融支援機構債券	79,315,000	80,476,171	
		貸付債権担保第１１９回住宅金融支援機構債券	158,470,000	160,686,995	
		貸付債権担保第１２０回住宅金融支援機構債券	79,985,000	80,882,431	
		貸付債権担保第１２１回住宅金融支援機構債券	80,482,000	81,533,899	
		貸付債権担保第１２３回住宅金融支援機構債券	81,695,000	82,912,255	
		貸付債権担保第１２５回住宅金融支援機構債券	327,420,000	331,407,975	
		貸付債権担保第１２６回住宅金融支援機構債券	247,173,000	250,326,927	
		貸付債権担保第１２８回住宅金融支援機構債券	165,030,000	167,023,562	
		貸付債権担保第１２９回住宅金融支援機構債券	168,046,000	170,492,749	
		貸付債権担保第１３４回住宅金融支援機構債券	170,658,000	172,446,495	
		貸付債権担保第１３５回住宅金融支援機構債券	85,879,000	86,771,282	
		貸付債権担保第１３６回住宅金融支援機構債券	86,504,000	87,698,620	
		貸付債権担保第１４０回住宅金融支援機構債券	86,748,000	87,604,202	
		貸付債権担保第１４２回住宅金融支援機構債券	267,081,000	268,616,715	
		貸付債権担保第１４４回住宅金融支援機構債券	266,571,000	268,250,397	
		貸付債権担保第１５０回住宅金融支援機構債券	461,175,000	460,082,015	
		貸付債権担保第１５２回住宅金融支援機構債券	185,868,000	187,102,163	
		貸付債権担保第１５４回住宅金融支援機構債券	188,160,000	188,929,574	
		貸付債権担保第１６４回住宅金融支援機構債券	293,025,000	294,736,266	
		貸付債権担保第１６５回住宅金融支援機構債券	195,478,000	197,112,196	
		貸付債権担保第１６６回住宅金融支援機構債券	294,009,000	297,678,232	
		貸付債権担保第１６７回住宅金融支援機構債券	196,784,000	199,212,314	
		貸付債権担保第１６８回住宅金融支援機構債券	197,358,000	199,627,617	
		貸付債権担保第１６９回住宅金融支援機構債券	297,369,000	300,512,190	
		貸付債権担保第１７０回住宅金融支援機構債券	497,520,000	501,520,060	
	小計	銘柄数：319	61,637,898,000	64,366,863,305	

		組入時価比率：8.0%		8.1%	
	合計			64,366,863,305	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）　第２９回円貨社債	200,000,000	199,636,000	
		フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）　第３１回円貨社債	100,000,000	99,742,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー　第１４回円貨社債	100,000,000	100,175,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー　第６回円貨社債（２０１４）	100,000,000	101,767,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー　第１５回円貨社債（２０１８	100,000,000	99,885,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー　第１６回円貨社債（２０１８	100,000,000	100,171,000	
		スタンダード・チャータード　第３回円貨社債（２０１５）	100,000,000	100,652,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー　第２回円	100,000,000	100,977,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー　第３回円	100,000,000	102,699,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー　第６回円貨社債	100,000,000	100,503,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー　第７回円貨社債	100,000,000	100,866,000	
		サンタンデール銀行　第１回円貨社債	100,000,000	100,225,000	
		フランス電力　第４回円貨社債（２０１７）	100,000,000	102,771,000	
		現代キャピタル・サービシズ・インク　第１５回円貨社債	200,000,000	198,646,000	
		ビー・エヌ・ピー・パリバ　第１回円貨社債（２０１７）	100,000,000	100,990,000	
		ウエストパック・バンキング・コーポレーション　第１２回円貨社	200,000,000	200,244,000	
		オーストラリア・ニュージーランド銀行　第１０回円貨社債	200,000,000	200,170,000	
		ＩＮＰＥＸ　第１回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,564,000	
		長谷工コーポレーション　第１４回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,662,000	
		大和ハウス工業　第９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,042,000	
		日揮ホールディングス　第６回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,786,000	
		明治ホールディングス　第１０回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,336,000	
		アサヒグループホールディングス第１６回特定社債間限定同順位	300,000,000	299,559,000	
		味の素　第２４回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,306,000	
		日本たばこ産業　第１３回	100,000,000	100,891,000	

		三越伊勢丹ホールディングス　第６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,910,000	
		トヨタ紡織　第２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,084,000	
		森ヒルズリート投資法人　第１７回特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	199,592,000	
		森ビル　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,624,000	
		セブン&アイ・ホールディングス第１３回社債間限定同順位特約	100,000,000	99,956,000	
		セブン&アイ・ホールディングス第１４回社債間限定同順位特約	600,000,000	601,554,000	
		セブン&アイ・ホールディングス第１５回社債間限定同順位特約	200,000,000	200,986,000	
		東レ　第３０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,803,000	
		東レ　第３３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,703,000	
		日本土地建物　第４回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,870,000	
		王子ホールディングス　第３４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,126,000	
		王子ホールディングス　第４２回社債間限定同順位特約付	600,000,000	599,916,000	
		住友化学　第５６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,615,000	
		三井化学　第４８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,533,000	
		三菱ケミカルホールディングス　第２９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,730,000	
		三菱ケミカルホールディングス　第３３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,284,000	
		三菱ケミカルホールディングス　第３７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,529,000	
		電通　第３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,116,000	
		電通　第６回社債間限定同順位特約付	300,000,000	304,554,000	
		ツムラ　第１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,054,000	
		オリエンタルランド　第１６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,103,000	
		オリエンタルランド　第１８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,660,000	
		ヤフー　第６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,159,000	
		ヤフー　第１２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,037,000	
		楽天　第１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,427,000	
		ブリヂストン　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,546,000	
			300,000,000	301,500,000	

		新日鐵住金　第９回社債間限定同順位特約付			
		ジェイ　エフ　イー　ホールディングス　第２８回社債間限定同順	100,000,000	100,034,000	
		ジェイ　エフ　イー　ホールディングス　第３４回社債間限定同順	100,000,000	100,211,000	
		住友金属鉱山　第３３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,980,000	
		住友電気工業　第２６回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,094,000	
		ＬＩＸＩＬグループ　第１１回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,622,000	
		荏原製作所　第１０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,923,000	
		日立製作所　第１７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,294,000	
		パナソニック　第１７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,950,000	
		パナソニック　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,956,000	
		パナソニック　第２１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,218,000	
		パナソニック　第２２回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,112,000	
		ソニー　第３２回	100,000,000	100,408,000	
		東海理化電機製作所　第１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,688,000	
		三菱重工業　第３５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,379,000	
		三菱重工業　第３８回社債間限定同順位特約付（第２回グリーンボ	300,000,000	299,703,000	
		ＪＡ三井リース　第８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,534,000	
		三井住友トラスト・パナソニックファイナンス　第２回社債間限定	100,000,000	100,138,000	
		トヨタ自動車　第１４回社債間限定同等特約付	100,000,000	101,416,000	
		トヨタ自動車　第２６回社債間限定同順位特約付	700,000,000	700,623,000	
		トヨタ自動車　第２７回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,935,000	
		楽天カード　第３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,661,000	
		ドンキホーテホールディングス　第１２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,548,000	
		ニコン　第２２回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,881,000	
		丸紅　第１１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,260,000	
		豊田通商　第１８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,660,000	
		豊田通商　第１９回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,638,000	

		三井物産　第７１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,421,000	
		住友商事　第４９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,532,000	
		住友商事　第５３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,776,000	
		クレディセゾン　第５０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,024,000	
		クレディセゾン　第６５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,950,000	
		イオン　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,776,000	
		三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ　第１回劣後特約付	100,000,000	101,475,000	
		りそなホールディングス　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,307,000	
		三井住友トラスト・ホールディングス　第２回劣後特約付	200,000,000	202,948,000	
		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	113,616,000	
		東京三菱銀行　第５７回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,385,000	
		三井住友フィナンシャルグループ第１回劣後特約付	300,000,000	303,780,000	
		三井住友フィナンシャルグループ第３回劣後特約付	100,000,000	101,538,000	
		三井住友フィナンシャルグループ第４回劣後特約付	100,000,000	105,205,000	
		三井住友信託銀行　第１８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,144,000	
		セブン銀行　第１０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,064,000	
		セブン銀行　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,378,000	
		セブン銀行　第１２回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,996,000	
		みずほフィナンシャルグループ　第１回劣後特約付	200,000,000	202,556,000	
		みずほ銀行　第７回劣後特約付	100,000,000	111,584,000	
		芙蓉総合リース　第２６回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,650,000	
		みずほリース　第３回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,975,000	
		みずほリース　第７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,936,000	
		ＮＴＴファイナンス　第２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,616,000	
		ＮＴＴファイナンス　第１７回日本電信電話保証付	200,000,000	201,234,000	
		ＮＴＴファイナンス　第１８回日本電信電話保証付	200,000,000	202,422,000	
		トヨタファイナンス　第８１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,632,000	

		トヨタファイナンス　第９６回社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,455,000	
		リコーリース　第２８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,628,000	
		アコム　第７７回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,222,000	
		ジャックス　第１９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,191,000	
		日立キャピタル　第６１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,789,000	
		日立キャピタル　第８０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,976,000	
		三井住友ファイナンス&リース　第２７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,267,000	
		三菱ＵＦＪリース　第５２回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,000,000	
		三菱ＵＦＪリース　第５６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,498,000	
		三菱ＵＦＪリース　第７６回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,884,000	
		大和証券グループ本社　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,306,000	
		三井不動産　第７１回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,044,000	
		三菱地所　第１２０回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,422,000	
		東京建物　第２５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,638,000	
		ダイビル　第１９回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,536,000	
		エヌ・ティ・ティ都市開発　第１５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,253,000	
		日本ビルファンド投資法人　第１３回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	101,736,000	
		野村不動産オフィスファンド投資法人　第７回特定投資法人債間限	100,000,000	115,401,000	
		積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人　第５回特定投資法人債	100,000,000	101,782,000	
		東武鉄道　第１２４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,764,000	
		相鉄ホールディングス　第３２回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	202,432,000	
		東京急行電鉄　第８２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,120,000	
		東京急行電鉄　第８３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,682,000	
		小田急電鉄　第６８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,610,000	
		小田急電鉄　第７４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,060,000	
		京成電鉄　第５８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,712,000	
			200,000,000	231,892,000	

		東日本旅客鉄道　第５７回社債間限定同順位特約付			
		東日本旅客鉄道　第７１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,299,000	
		東日本旅客鉄道　第１０６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,994,000	
		東日本旅客鉄道　第１０７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,811,000	
		東日本旅客鉄道　第１３３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,106,000	
		東日本旅客鉄道　第１４５回社債間限定同順位特約付	200,000,000	186,810,000	
		西日本旅客鉄道　第１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,909,000	
		西日本旅客鉄道　第１５回社債間限定同順位特約付	300,000,000	339,483,000	
		西日本旅客鉄道　第６５回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,878,000	
		西日本旅客鉄道　第６６回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,386,000	
		東海旅客鉄道　第１７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,704,000	
		東海旅客鉄道　第５１回社債間限定同順位特約付	200,000,000	234,152,000	
		東海旅客鉄道　第７０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,528,000	
		東海旅客鉄道　第７３回社債間限定同順位特約付	300,000,000	323,172,000	
		東海旅客鉄道　第７４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,205,000	
		東京地下鉄　第２２回	100,000,000	100,513,000	
		東京地下鉄　第２３回	100,000,000	103,179,000	
		東京地下鉄　第２４回	100,000,000	106,271,000	
		西武ホールディングス　第１回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,698,000	
		西日本鉄道　第４５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,763,000	
		阪急阪神ホールディングス　第４７回	400,000,000	430,420,000	
		阪急阪神ホールディングス　第４９回	100,000,000	103,979,000	
		名古屋鉄道　第５０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,693,000	
		日本通運　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,060,000	
		日本通運　第１２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,615,000	
		日本郵船　第３２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,180,000	
		横浜高速鉄道　第２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,144,000	
		九州旅客鉄道　第２回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,754,000	

		九州旅客鉄道　第４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,557,000	
		ＡＮＡホールディングス　第３２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,830,000	
		澁澤倉庫　第８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,658,000	
		ＫＤＤＩ　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,554,000	
		ＫＤＤＩ　第２５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,924,000	
		東京電力　第５４８回	100,000,000	112,298,000	
		東京電力　第５６０回	100,000,000	111,900,000	
		中部電力　第５００回	200,000,000	204,318,000	
		中部電力　第５２４回	100,000,000	101,321,000	
		中部電力　第５３０回	200,000,000	200,824,000	
		関西電力　第５０９回	100,000,000	101,600,000	
		関西電力　第５１１回	300,000,000	303,726,000	
		関西電力　第５２７回	200,000,000	200,982,000	
		関西電力　第５３５回	200,000,000	200,464,000	
		中国電力　第３７７回	100,000,000	102,041,000	
		中国電力　第４００回	100,000,000	101,010,000	
		中国電力　第４０２回	100,000,000	100,508,000	
		北陸電力　第３０１回	100,000,000	101,659,000	
		北陸電力　第３０７回	100,000,000	104,399,000	
		北陸電力　第３０８回	100,000,000	102,054,000	
		北陸電力　第３２６回	100,000,000	102,570,000	
		東北電力　第４７５回	100,000,000	102,174,000	
		東北電力　第４８１回	200,000,000	205,300,000	
		東北電力　第４８４回	100,000,000	103,527,000	
		東北電力　第４９１回	100,000,000	101,399,000	
		東北電力　第５２１回	300,000,000	304,317,000	
		東北電力　第５２９回	200,000,000	199,542,000	
		四国電力　第２８１回	100,000,000	102,100,000	
		九州電力　第４２４回	100,000,000	102,514,000	
		九州電力　第４２８回	105,000,000	107,531,550	
		九州電力　第４４９回	200,000,000	202,876,000	
		九州電力　第４５１回	100,000,000	101,573,000	
		九州電力　第４７６回	100,000,000	101,431,000	
		九州電力　第４８１回	300,000,000	301,824,000	
		九州電力　第４８４回	200,000,000	201,678,000	
		北海道電力　第３２１回	100,000,000	102,537,000	
		北海道電力　第３２３回	100,000,000	108,554,000	
		北海道電力　第３３８回	100,000,000	104,063,000	
		北海道電力　第３４５回	300,000,000	301,530,000	

		電源開発　第４０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,202,000	
		電源開発　第４１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,995,000	
		電源開発　第５０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,380,000	
		電源開発　第５９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,101,000	
		東京電力パワーグリッド　第６回	100,000,000	103,147,000	
		東京電力パワーグリッド　第１１回	300,000,000	308,004,000	
		東京電力パワーグリッド　第１４回	100,000,000	100,487,000	
		東京電力パワーグリッド　第２８回	100,000,000	104,115,000	
		東京電力パワーグリッド　第３５回	100,000,000	105,695,000	
		東京電力パワーグリッド　第３８回	400,000,000	405,612,000	
		東京電力パワーグリッド　第４０回	400,000,000	430,484,000	
		東京瓦斯　第３８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	125,937,000	
		東京瓦斯　第５５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,886,000	
		大阪瓦斯　第３６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,191,000	
		大阪瓦斯　第４３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,720,000	
		北海道瓦斯　第１７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,173,000	
		北海道瓦斯　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,444,000	
		広島ガス　第１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,070,000	
		東京都競馬　第３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,895,000	
		ファーストリテイリング　第７回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,294,000	
		ソフトバンクグループ　第５４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,907,000	
	小計	銘柄数：219 組入時価比率：4.3%	33,305,000,000	34,000,434,550 4.3%	
	合計			34,000,434,550	
合計				791,413,636,224	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村円債投資インデックスファンド

2021年10月29日現在

Ⅰ　資産総額	1,065,500,647円
Ⅱ　負債総額	3,307,496円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,062,193,151円
Ⅳ　発行済口数	1,018,076,585口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0433円

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

2021年10月29日現在

Ⅰ　資産総額	822,568,655,182円
Ⅱ　負債総額	5,073,910,305円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	817,494,744,877円
Ⅳ　発行済口数	615,441,146,878口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3283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

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①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た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

2021年10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数　　20,000,000株

発行済株式総数　　5,150,693株

過去５年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

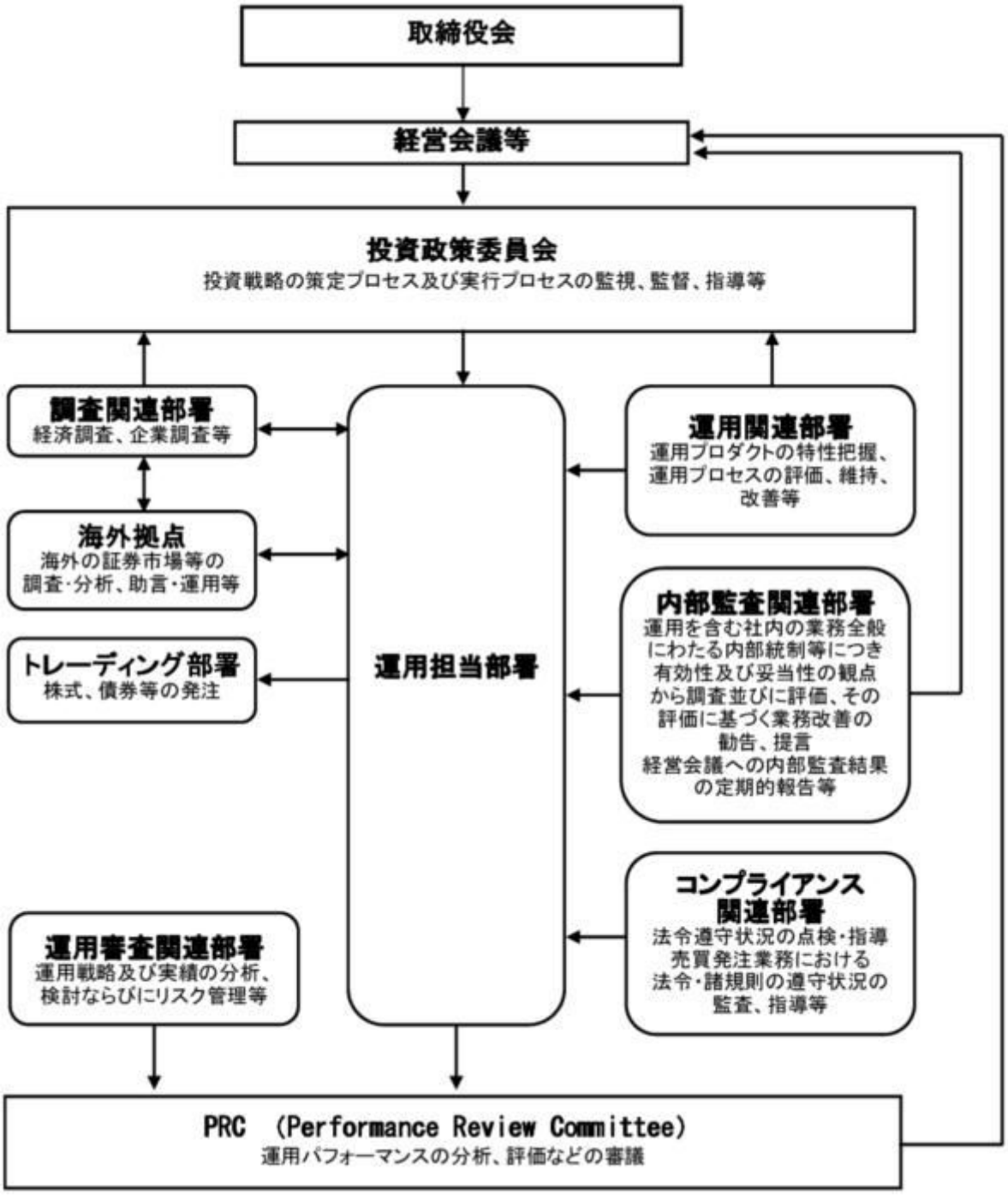
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

「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2021年9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

種類	本数	純資産総額(百万円)

追加型株式投資信託	989	39,313,559
単位型株式投資信託	198	820,184
追加型公社債投資信託	14	6,430,213
単位型公社債投資信託	506	1,591,773
合計	1,707	48,155,729

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．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			2,626		4,281
金銭の信託			41,524		35,912
有価証券			24,399		30,400
前払費用			106		167
未収入金			522		632
未収委託者報酬			23,936		24,499
未収運用受託報酬			4,336		4,347
その他			71		268
貸倒引当金			△14		△14
流動資産計			97,509		100,496
固定資産					
有形固定資産			645		2,666
建物	※２	295		1,935	
器具備品	※２	349		731	
無形固定資産			5,894		5,429
ソフトウェア		5,893		5,428	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,486		16,487
投資有価証券		1,437		1,767	

関係会社株式		10,171		9,942	
従業員長期貸付金		16		-	
長期差入保証金		329		330	
長期前払費用		19		15	
前払年金費用		1,545		1,301	
繰延税金資産		2,738		3,008	
その他		229		122	
貸倒引当金		△0		-	
固定資産計			23,026		24,583
資産合計			120,536		125,080

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			157		123
未払金			15,279		16,948
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		3		8	
未払手数料		6,948		7,256	
関係会社未払金		7,262		8,671	
その他未払金		1,063		1,011	
未払費用	※1		10,290		9,171
未払法人税等			1,564		2,113
前受収益			26		22
賞与引当金			3,985		3,795
その他			67		-
流動負債計			31,371		32,175
固定負債					
退職給付引当金			3,311		3,299
時効後支払損引当金			572		580
資産除去債務			-		1,371
固定負債計			3,883		5,250
負債合計			35,254		37,425
(純資産の部)					
株主資本			85,270		87,596
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			54,360		56,686
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		53,675		56,001	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,069		31,395	
評価・換算差額等			10		57
その他有価証券評価差額金			10		57
純資産合計			85,281		87,654
負債・純資産合計			120,536		125,080

（２）【損益計算書】

		前事業年度 (自　2019年4月1日 至　2020年3月31日)		当事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			115,736		106,355
運用受託報酬			17,170		16,583
その他営業収益			340		428
営業収益計			133,247		123,367
営業費用					
支払手数料			39,435		34,739
広告宣伝費			1,006		1,005
公告費			-		0
調査費			26,833		24,506
調査費		5,696		5,532	
委託調査費		21,136		18,974	
委託計算費			1,342		1,358
営業雑経費			5,823		4,149
通信費		75		73	
印刷費		958		976	
協会費		92		88	
諸経費		4,696		3,011	
営業費用計			74,440		65,760
一般管理費					
給料			11,418		10,985
役員報酬		109		147	
給料・手当		7,173		7,156	
賞与		4,134		3,682	
交際費			86		35
旅費交通費			391		64
租税公課			1,029		1,121
不動産賃借料			1,227		1,147
退職給付費用			1,486		1,267
固定資産減価償却費			2,348		2,700
諸経費			10,067		10,739
一般管理費計			28,055		28,063
営業利益			30,751		29,542

		前事業年度 (自　2019年4月1日 至　2020年3月31日)		当事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021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	4,936		4,540	

受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	
為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
経常利益			35,555		36,157
特別利益					
投資有価証券等売却益		21		71	
株式報酬受入益		59		48	
移転補償金		-		2,077	
特別利益計			81		2,197
特別損失					
投資有価証券等評価損		119		36	
関係会社株式評価損		1,591		582	
固定資産除却損	※２	67		105	
事務所移転費用		-		406	
特別損失計			1,778		1,129
税引前当期純利益			33,858		37,225
法人税、住民税及び事業税			9,896		11,239
法人税等調整額			△34		△290
当期純利益			23,996		26,276

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自　2019年4月１日　至　2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							△25,650	△25,650	△25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△1,653	△1,653	△1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			△25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△23	△23	△23
当期変動額合計	△23	△23	△1,676
当期末残高	10	10	85,281

当事業年度(自　2020年4月1日　至　2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							△23,950	△23,950	△23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			△23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

[重要な会計方針]

１．有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの … 移動平均法による原価法
２．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
３．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	(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。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。

	(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。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (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。
5．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。
6．連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日）

・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号　2020年3月31日）

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

（1）概要

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

・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

（2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

◇　貸借対照表関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021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。** **未払費用　1,296百万円** **※２．有形固定資産より控除した減価償却累計額** **建物　761百万円** **器具備品　2,347** **合計　3,109**	**※１．関係会社に対する資産及び負債** **区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。** **未払費用　1,256百万円** **※２．有形固定資産より控除した減価償却累計額** **建物　346百万円** **器具備品　643** **合計　990**

◇　損益計算書関係

前事業年度 (自　2019年4月１日 至　2020年3月31日)	当事業年度 (自　2020年4月１日 至　2021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　4,931百万円 ※２．固定資産除却損 器具備品　7百万円 ソフトウェア　59 合計　67	※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　4,334百万円 ※２．固定資産除却損 器具備品　2百万円 ソフトウェア　102 合計　105

◇　株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自　2019年4月１日　至　2020年3月31日)

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．剰余金の配当に関する事項

（１）配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．剰余金の配当に関する事項

（１）配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

（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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

◇　金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月１日　至 2020年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リ

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

２．金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上しておりました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2020年4月１日　至 2021年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を

目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

2021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	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-

未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）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	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

◇ 有価証券関係

前事業年度 （自 2019年4月１日 至 2020年3月31日）

１．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

４．その他有価証券(2020年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

５．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月１日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度 （自 2020年4月１日　至 2021年3月31日）

１．売買目的有価証券(2021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(2021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(2021年3月31日)

該当事項はありません。

４．その他有価証券(2021年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

５．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

◇　退職給付関係

前事業年度(自　2019年4月１日　至　2020年3月31日)
１．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。 ２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	△138
退職給付の支払額	△858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	△436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	△35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自　2020年4月1日　至　2021年3月31日)

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	△893
退職給付の支払額	△781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	△626
年金資産の期末残高	19,349

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	19,959 百万円
年金資産	△19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	△2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	△1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	△409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	△34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

②長期期待運用収益率の設定方法
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

３．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

◇ 税効果会計関係

前事業年度末 (2020年3月31日)		当事業年度末 (2021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	1,235	賞与引当金	1,176
退職給付引当金	1,026	退職給付引当金	1,022
関係会社株式評価減	762	関係会社株式評価減	784
未払事業税	285	未払事業税	430
投資有価証券評価減	462	投資有価証券評価減	428
減価償却超過額	171	減価償却超過額	223
時効後支払損引当金	177	時効後支払損引当金	179
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
ゴルフ会員権評価減	167	ゴルフ会員権評価減	135
未払社会保険料	97	未払社会保険料	95
その他	219	その他	341
繰延税金資産小計	4,754	繰延税金資産小計	4,968
評価性引当額	△1,532	評価性引当額	△1,530
繰延税金資産合計	3,222	繰延税金資産合計	3,437
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	4	その他有価証券評価差額金	25
前払年金費用	478	前払年金費用	403
繰延税金負債合計	483	繰延税金負債合計	429
繰延税金資産の純額	2,738	繰延税金資産の純額	3,008
２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△4.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△3.5%
タックスヘイブン税制	2.6%	タックスヘイブン税制	1.9%
外国税額控除	△0.7%	外国税額控除	△0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	0.4%	その他	0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%

◇　資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

１．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

２．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

３．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）

	前事業年度 自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日	当事業年度 自　2020年4月 1日 至　2021年3月31日
期首残高	-	-
有形固定資産の取得に伴う増加	-	1,371
時の経過による調整額	-	-
期末残高	-	1,371

◇　セグメント情報等

前事業年度(自　2019年4月１日　至　2020年3月31日)

１．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

（１）製品・サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

① 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。

② 有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自　2020年4月１日　至　2021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

① 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。

② 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　2019年4月１日　至　2020年3月31日)

１．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	―	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1．上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2．取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
(*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

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

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自　2020年4月１日　至　2021年3月31日)

１．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	―	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

(*2) コマーシャル・ペーパーについては、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

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

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ 1株当たり情報

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額 16,557円31銭 1株当たり当期純利益 4,658円88銭	1株当たり純資産額 17,018円01銭 1株当たり当期純利益 5,101円61銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 23,996百万円 普通株式に係る当期純利益 23,996百万円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 5,150,693株	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 26,276百万円 普通株式に係る当期純利益 26,276百万円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 5,150,693株

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。

①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。)。

②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。)。

③通常の取引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④⑤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。

④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。

⑤上記③④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	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

＊2021年9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
七十七証券株式会社	3,000百万円	「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。
株式会社七十七銀行	24,658百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

＊2021年9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・連絡等を行ないます。

(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ないます。

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」と称して使用する場合があります。

(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

２０２１年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀　井　　純　子
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津　村　　健二郎
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水　永　　真太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の２０２０年４月１日から２０２１年3月３１日までの第６２期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の２０２１年3月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以　上

(注) 1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

２０２１年１１月１２日

野村アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御　　中

EY新日本有限責任監査法人

東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　伊　藤　志　保

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村円債投資インデックスファンドの２０２１年3月２３日から２０２１年9月２１日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村円債投資インデックスファンドの２０２１年9月２１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以　上

（注）1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。