

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年3月14日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）
【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】	継続募集額(平成29年3月15日から平成30年3月13日まで) 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】

野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）

（以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「タッチ&スイッチ」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。)

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。

「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1万口当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】

取得申込日の基準価額に、1.08%（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。  
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】

一般コース (分配金を受取るコース)	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
自動けいぞく投資コース (分配金が再投資されるコース)	1万円以上1円単位

ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合には1口単位とします。

販売会社や申込形態によっては、買付単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### (7) 【申込期間】

平成29年 3月15日から平成30年 3月13日まで

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

#### (8) 【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

#### (9) 【払込期日】

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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、「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、「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/>

（ 1 1 ）【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

（ 1 2 ）【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】

わが国の株式および公社債を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「野村日経225 マザーファンド」および「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。

## &lt;商品分類&gt;

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。

（野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型））

## 《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)
単位型	<b>国内</b>	株式
	海外	債券
<b>追加型</b>	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

## 《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
--------	------	--------	------

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル  <b>日本</b>	<b>ファミリーファンド</b>
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニア	
不動産投信	その他 ( )	中南米  アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合(株式、債</b> <b>券)資産配分変更型))</b>		中近東 (中東)	
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング	

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（資産複合）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。（平成22年7月1日現在）

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

- (1)単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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(収益の源泉)による区分]

- (1)株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲

げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

- (5)資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を實質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[ 独立した区分 ]

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

[ 補足分類 ]

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

< 属性区分表定義 >

[ 投資対象資産による属性区分 ]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。  
 (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。  
 (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1) ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

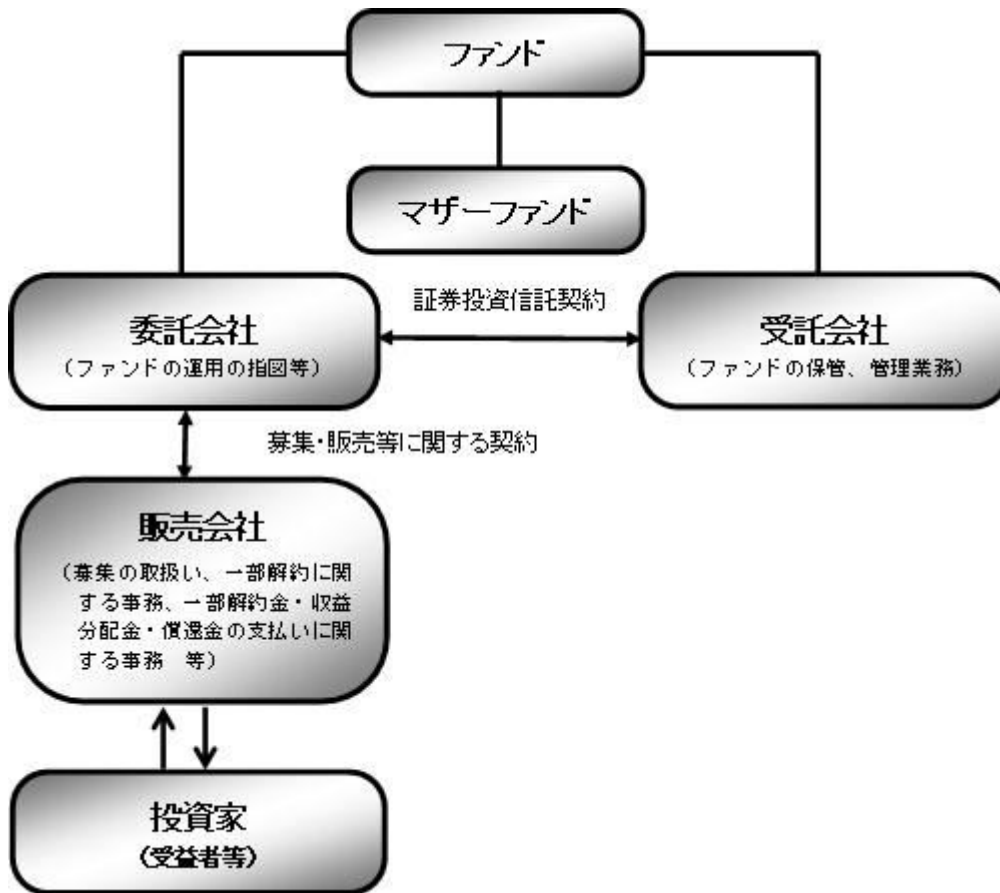
- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款に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

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

平成26年11月21日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

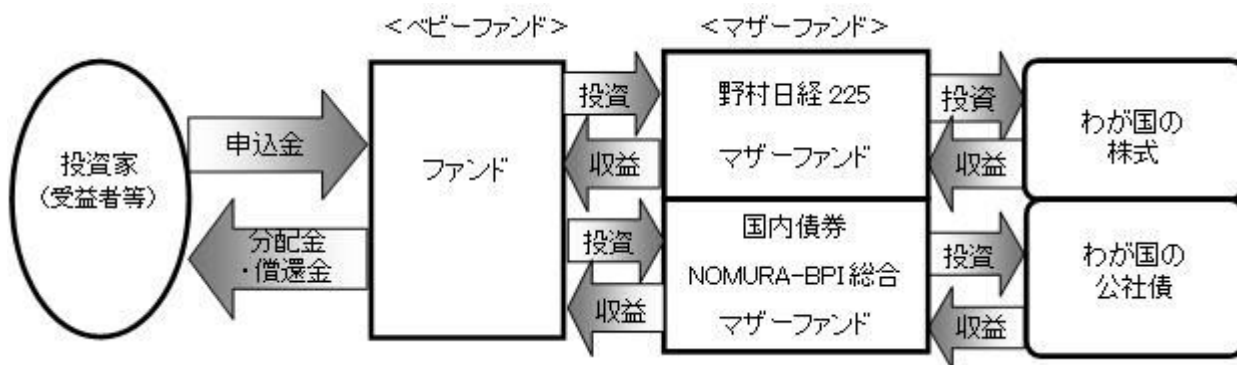
## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】





#### 《ファミリーファンド方式について》

ファンドはファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



ファンド	野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）
マザーファンド (親投資信託)	野村日経225 マザーファンド 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(平成29年1月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

- ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

- ・資本金の額

17,180百万円

- ・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立  
 平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更  
 平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更  
 平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

- ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

「野村日経225 マザーファンド」および「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的に運用を行なうことを基本とします。

基準価額（1万口当たり。支払い済みの分配金累計額は加算しません。）が一定水準（12,000円）以上となるまで、「野村日経225 マザーファンド」の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。

- ・効率的な運用を行なうため、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を活用する場合があります。
- ・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」には原則として投資を行ないません。

ファンドは基準価額が一定水準（12,000円）に到達しており、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」による運用に切り替えが完了しております。

基準価額が一定水準（12,000円）以上となった場合には、一定期間内で「野村日経225 マザーファンド」の組入比率を引き下げ、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」による運用に切り替えていくことを基本とします。

「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」による運用に切り替えが完了した以降、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。

各マザーファンドの投資方針等について

野村日経225 マザーファンド

- ・日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価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。
- ・効率的な運用を行なうため、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を活用し、また、わが国の金融商品取引所に上場している日経平均株価を対象指数とする上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。

日経平均株価(日経225)とは、日本経済新聞社が発表している株価指数で、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。わが国の株式市場全体の動向を示す指標の1つです。

「日経平均株価」(日経225)は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。

「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。

本件投資信託は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負わない。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

#### 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

・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。

NOMURA-BPI総合(NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合)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。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

野村日経225 マザーファンド受益証券および国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、実質的にわが国の株式および公社債に投資します。また、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を活用する場合があります。

#### 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、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、後述の「(5)投資制限 および 」に定めるものに限りません。)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。)

二．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲等(信託約款)

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野村日経225 マザーファンド受益証券および国内債券NOMURA-BP1総合 マザーファンド受益証券のほか、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きます。）に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．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の新株引受権証券を含みます。）
- 6．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。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券および新株予約権証券
- 12．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
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14．投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（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。）
- 15．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。）
- 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
- 17．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 18．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 19．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 20．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第17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
- 21．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1号の証券または証書ならびに第12号、第17号および第18号の証券または証書のうち第1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2号から第6号までの証券ならびに第12号、第17号および第18号の証券または証書のうち第2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、第13号および第14号の証券ならびに第17号の証券または証書のうち第13号および第14号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

### 金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

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

### その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

### (参考)マザーファンドの概要

「野村日経225 マザーファンド」

## 運用の基本方針

約款第14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、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を取引対象とします。

#### (2)投資態度

日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。

効率的な運用を行なうため、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を活用し、また、わが国の金融商品取引所に上場している日経平均株価を対象指数とする上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。

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。

「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

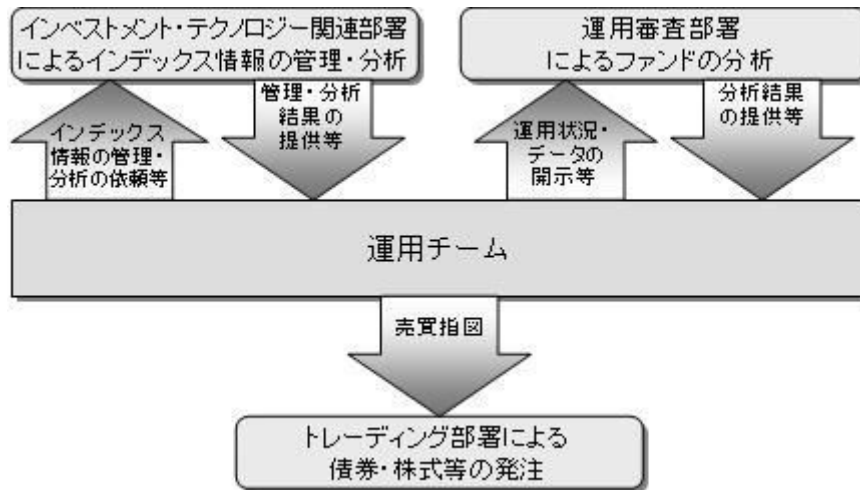
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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。

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】

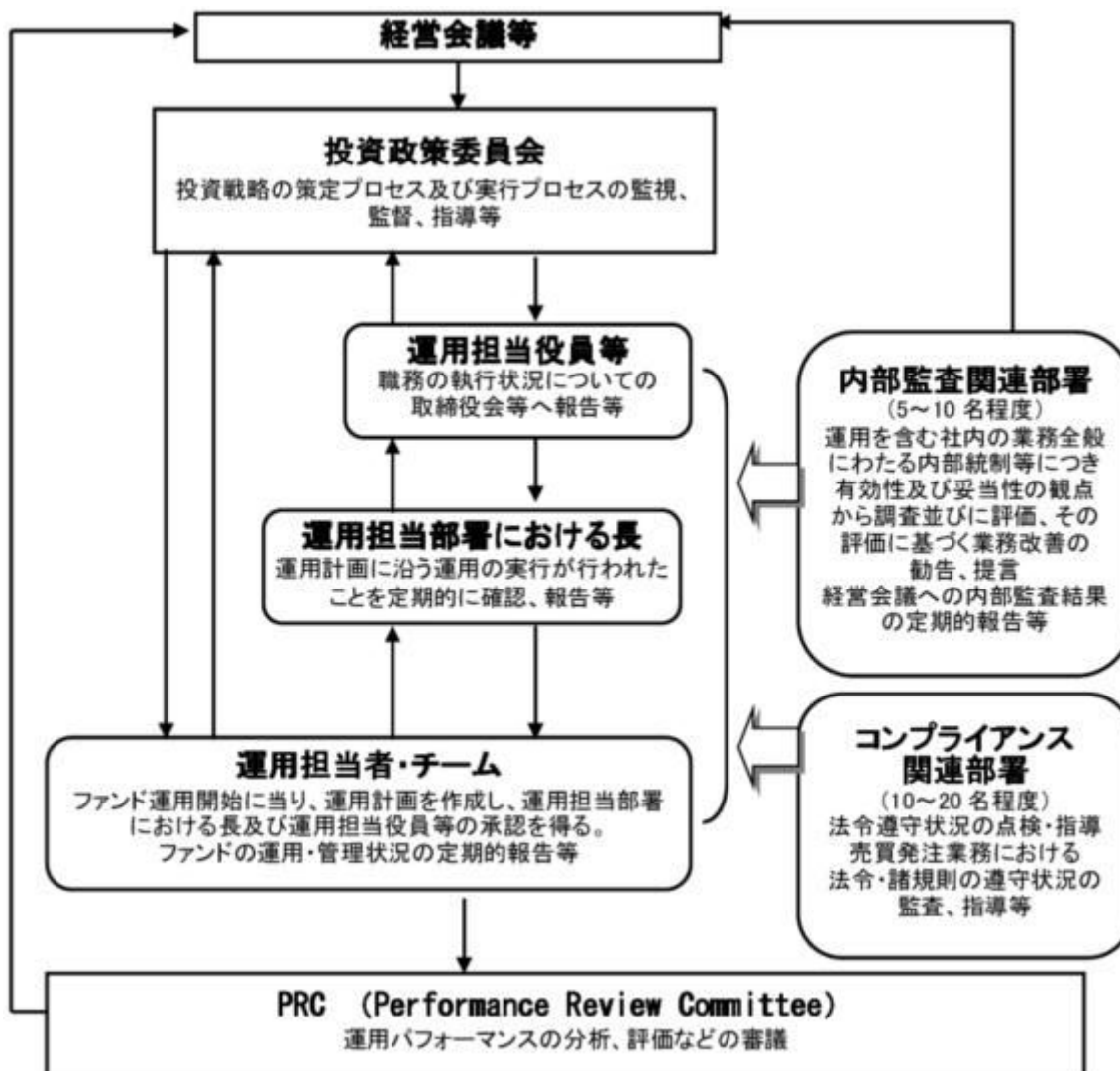
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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いません。

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

収益分配金額は、上記の範囲内で、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。

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年12月18日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

#### （５）【投資制限】

運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 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。）の利用は行いません。

投資する株式等の範囲(信託約款)

( )委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ( )上記( )の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券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。

#### 信用取引の指図範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。
- ( )上記( )の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売り出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券  
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。
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、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。)
- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )委託者は、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行なうことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ( )スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ません。

- ( )スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ( )委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

#### 公社債の借入れ（信託約款）

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約取引の指図および範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ( )上記( )の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産と野村日経225 マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属する野村日経225 マザーファンド受益証券の時価総額に野村日経225 マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ( )上記( )の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ(信託約款)

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

同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

同一の法人の発行する株式について、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( )委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- ( )当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

### 3【投資リスク】

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。

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [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。

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。

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

投資方針に記載の一定水準（12,000円）は、あくまでも一定期間内で「野村日経225 マザーファンド」の組入比率を引き下げ、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」による運用（以下「債券運用」といいます。）に切り替えていくための価額水準であり、基準価額が12,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。

また、株式売却の際に発生する売買委託手数料等や市場インパクト、債券運用に切り替わるまでの株式の価格変動の影響、ファンドが実質的に組み入れている銘柄について速やかに売却できない場合、基準価額が12,000円以上となった日以降收受される信託報酬、または債券運用への切り替え完了後に投資方針に沿った運用ができない場合等により、基準価額が12,000円以上となった日の翌営業日以降（債券運用への切り替え完了後も含みます。）の基準価額が12,000円を下回る場合があります。

ファンドは基準価額が一定水準（12,000円）に到達しており、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」による運用に切り替えが完了しております。

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

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

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

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

### リスク管理関連の委員会

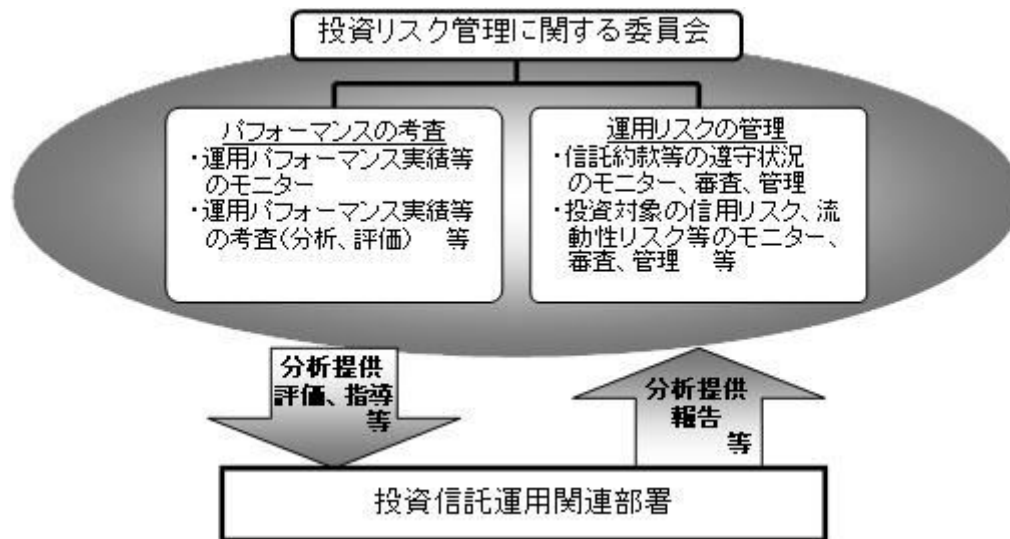
#### パフォーマンスの考査

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

#### 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

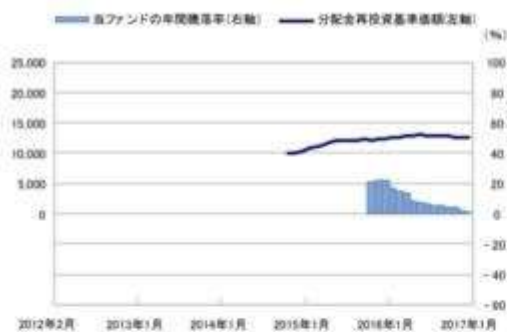


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

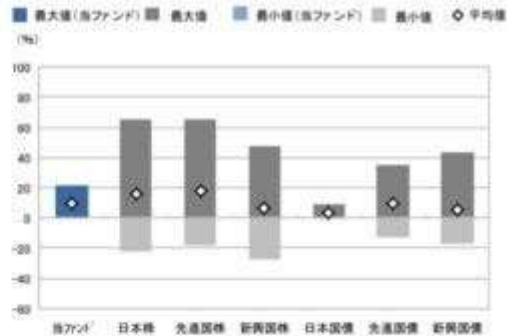
## リスクの定量的比較

(2012年2月末～2017年1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(%)	21.8	85.0	65.7	47.4	8.3	34.9	43.7
最小値(%)	0.7	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	0.5	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	10.1	15.8	18.2	6.7	3.1	9.2	5.3

- 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。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- 年間騰落率は、2015年11月から2017年1月の各月末における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。
- 2012年2月から2017年1月の5年間(当ファンドは2015年11月から2017年1月)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：シティ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・マーケット・グローバル・ディバースファイド(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、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 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。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益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、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index 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・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてはここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに関連することなく、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値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあります。また、発行体の引受人、プレスメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMS LLC」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)についての誤解、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、或いは伝達または承認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。JPMS LLCはNASD、NYSE、SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPSE 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、Citigroup Index LLC 他)

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

取得申込日の基準価額に、1.08%(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下さい。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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、ファンドの純資産総額に年0.54%（税抜年0.50%）の率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬率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0.23%	年0.23%	年0.04%

### 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】

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

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

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

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。

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を1口当たり換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

い、信託財産に繰り入れられます。

\*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です。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>（注2）</sup>	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 特定公社債<sup>（注1）</sup>の利子</li> <li>・ 公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul>	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 譲渡益</li> <li>・ 譲渡損</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 上場株式の配当</li> <li>・ 公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul>

（注1）「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、平成27年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

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

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

法人の投資家に対する課税

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



源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 換金(解約)時および償還時の課税について

##### [個人の投資家の場合]

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

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

##### [法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

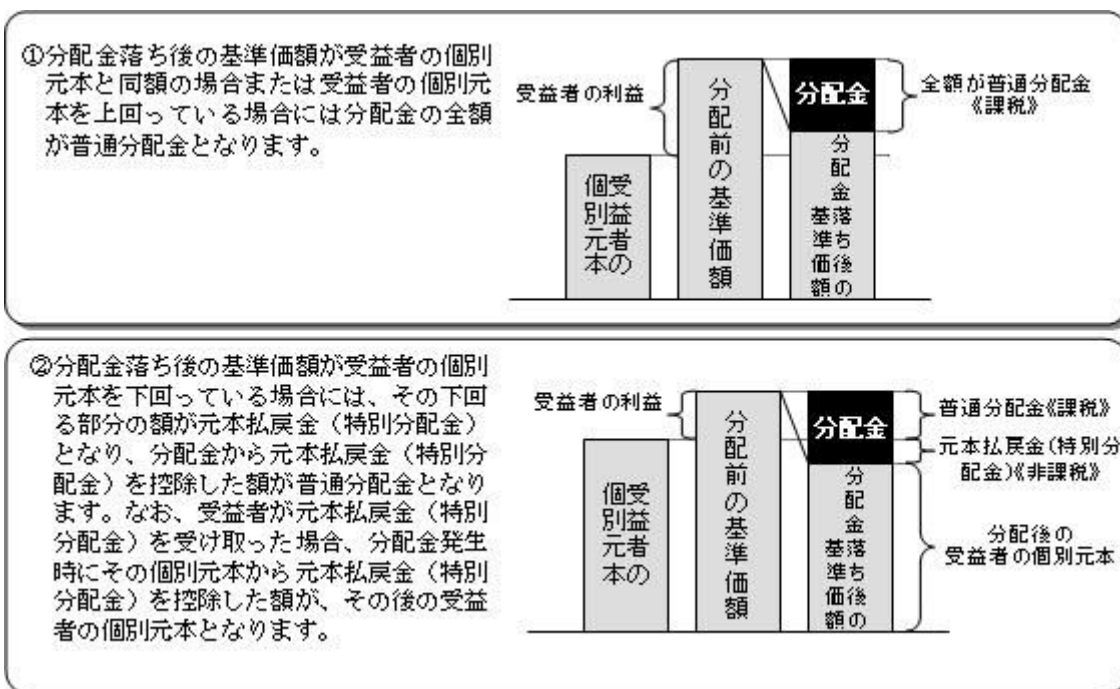
#### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

#### 分配金の課税について

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



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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（平成29年1月末現在）が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は平成29年 1月31日現在の運用状況であります。

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

## (1)【投資状況】

野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）

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	65,655,982	99.99
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,324	0.00
合計(純資産総額)		65,661,306	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	538,480,877,840	79.05
地方債証券	日本	53,138,512,217	7.80
特殊債券	日本	56,096,545,207	8.23
社債券	日本	27,750,785,450	4.07
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,696,258,136	0.83
合計(純資産総額)		681,162,978,850	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）

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	50,629,228	1.3011	65,873,689	1.2968	65,655,982	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 - B P I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 (5年)第12 5回	8,200,000,000	101.32	8,308,896,000	100.83	8,268,716,000	0.1	2020/9/20	1.21
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	8,100,000,000	101.27	8,203,194,000	100.81	8,165,934,000	0.1	2020/6/20	1.19
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	8,100,000,000	101.17	8,195,013,000	100.79	8,164,152,000	0.2	2018/12/20	1.19
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	7,800,000,000	101.15	7,890,402,000	100.73	7,857,486,000	0.1	2019/12/20	1.15
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	7,500,000,000	102.03	7,652,257,000	100.36	7,527,225,000	0.1	2026/3/20	1.10
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	101.21	7,388,841,000	100.78	7,357,305,000	0.1	2020/3/20	1.08
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	7,200,000,000	103.67	7,464,702,000	102.16	7,355,808,000	0.3	2025/12/20	1.07
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	7,300,000,000	101.05	7,376,796,000	100.69	7,350,735,000	0.2	2018/9/20	1.07
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	7,000,000,000	101.16	7,081,620,000	100.76	7,053,690,000	0.3	2018/6/20	1.03
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	6,900,000,000	102.31	7,060,028,000	100.32	6,922,494,000	0.1	2026/6/20	1.01
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	6,800,000,000	101.15	6,878,240,000	100.28	6,819,448,000	0.1	2026/9/20	1.00
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	6,200,000,000	101.99	6,323,778,000	100.92	6,257,226,000	0.1	2021/6/20	0.91
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	6,000,000,000	104.57	6,274,560,000	103.00	6,180,420,000	0.4	2025/9/20	0.90
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,900,000,000	104.55	6,168,509,000	103.00	6,077,354,000	0.4	2025/6/20	0.89
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	6,000,000,000	100.91	6,055,165,000	100.95	6,057,180,000	0.1	2021/9/20	0.88
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	101.58	6,095,240,000	100.89	6,053,460,000	0.1	2021/3/20	0.88
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	5,900,000,000	101.28	5,975,579,000	100.83	5,949,088,000	0.2	2019/3/20	0.87
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	105.49	5,802,280,000	104.02	5,721,430,000	0.6	2023/3/20	0.83
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	107.08	5,675,293,000	105.40	5,586,412,000	0.8	2023/6/20	0.82
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	101.44	5,579,585,000	100.96	5,553,020,000	0.2	2019/9/20	0.81

21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	101.38	5,575,960,000	100.85	5,547,135,000	0.1	2020/12/20	0.81
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	106.60	5,277,145,500	105.12	5,203,638,000	1.2	2020/12/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,900,000,000	106.47	5,217,373,000	104.88	5,139,463,000	0.8	2022/9/20	0.75
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,900,000,000	104.56	5,123,783,000	102.95	5,044,893,000	0.4	2025/3/20	0.74
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	101.37	5,068,700,000	100.89	5,044,750,000	0.2	2019/6/20	0.74
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第37 2回	5,000,000,000	100.62	5,031,300,000	100.62	5,031,300,000	0.1	2019/1/15	0.73
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	4,700,000,000	105.34	4,951,215,000	103.65	4,871,832,000	0.5	2024/9/20	0.71
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,700,000,000	101.06	4,750,146,000	100.65	4,730,832,000	0.1	2019/6/20	0.69
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	3,700,000,000	123.67	4,576,098,000	119.80	4,432,711,000	1.7	2033/9/20	0.65
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	4,100,000,000	106.10	4,350,182,000	104.34	4,278,309,000	0.6	2024/6/20	0.62

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.05
地方債証券	7.80
特殊債券	8.23
社債券	4.07
合計	99.16

## 【投資不動産物件】

野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)

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。

## 【その他投資資産の主要なもの】

野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)

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】

#### 【純資産の推移】

野村ターゲットプライス「日経２２５」（国内債券運用移行型）

平成29年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2015年12月18日)	92	92	1.2247	1.2247
第2計算期間	(2016年12月19日)	69	69	1.2528	1.2528
	2016年 1月末日	93		1.2398	
	2月末日	91		1.2603	
	3月末日	91		1.2699	
	4月末日	88		1.2805	
	5月末日	88		1.2845	
	6月末日	87		1.2996	
	7月末日	85		1.2881	
	8月末日	82		1.2753	
	9月末日	80		1.2755	
	10月末日	79		1.2715	
	11月末日	72		1.2629	
	12月末日	68		1.2554	
	2017年 1月末日	65		1.2479	

#### 【分配の推移】

野村ターゲットプライス「日経２２５」（国内債券運用移行型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2014年11月21日～2015年12月18日	0.0000円
第2計算期間	2015年12月19日～2016年12月19日	0.0000円

#### 【収益率の推移】

野村ターゲットプライス「日経２２５」（国内債券運用移行型）

	計算期間	収益率
--	------	-----

第1計算期間	2014年11月21日～2015年12月18日	22.5%
第2計算期間	2015年12月19日～2016年12月19日	2.3%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2014年11月21日～2015年12月18日	157,306,052	81,504,067	75,801,985
第2計算期間	2015年12月19日～2016年12月19日		20,483,851	55,318,134

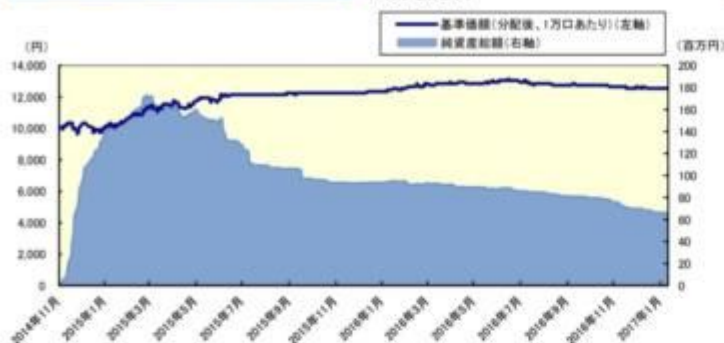
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

## 運用実績 (2017年1月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移

(日次・設定来)



## 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2016年12月	0 円
2015年12月	0 円
---	---
---	---
---	---
設定来累計	0 円

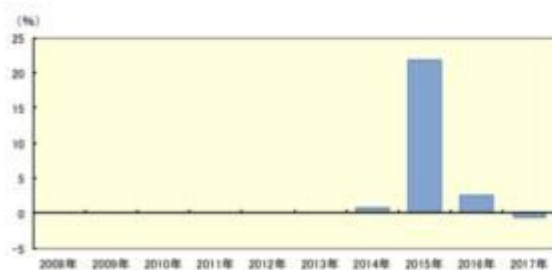
## 主要な資産の状況

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(5年)第125回	国債証券	1.2
2	国庫債券 利付(5年)第124回	国債証券	1.2
3	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	1.2
4	国庫債券 利付(5年)第122回	国債証券	1.1
5	国庫債券 利付(10年)第342回	国債証券	1.1
6	国庫債券 利付(5年)第123回	国債証券	1.1
7	国庫債券 利付(10年)第341回	国債証券	1.1
8	国庫債券 利付(5年)第115回	国債証券	1.1
9	国庫債券 利付(5年)第113回	国債証券	1.0
10	国庫債券 利付(10年)第343回	国債証券	1.0

## 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。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2014年は設定日(2014年11月21日)から年末までの収益率。
- ・2017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】

- ・申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかか

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。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・販売の単位は、「一般コース」の場合は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、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。また、原則として、お買付け後のコース変更はできません。

#### 積立方式

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

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

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ・金融商品取引所（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、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付けを中止することおよびすでに受付けした取得申込の受付けを取り消す場合があります。

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。



- ・受益者は、受益権を、「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。
- ・換金価額は、換金のお申込み日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

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/>

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

### 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1万口当た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
株式	原則として、基準価額計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 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) 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】

平成32年12月18日までとします(平成26年11月21日設定)。

なお、委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

## （４）【計算期間】

原則として、毎年12月19日から翌年12月18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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

### （a）ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託終了前に、平成30年1月1日以降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、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、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、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

### （b）信託期間の終了

（ ）委託者は、上記「（a）ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。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發します。

（ ）上記（ ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議

決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )から( )までに規定するこの信託契約の解約の手続を行なうことが困難な場合には適用しません。
- ( ) 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ( ) 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更等」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。
- (c) 運用報告書
- ファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知れている受益者に対して交付します。
- (d) 信託約款の変更等
- ( ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- ( ) 委託者は、上記( )の事項（上記( )の変更事項にあつ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、併合事項にあつ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。
- ( ) 上記( )の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( ) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ( ) 上記( )から( )の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合

にあっても、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。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

( ) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対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なう場合において、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。

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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。

なお、運用の外部委託を行なう場合は、委託者と運用の委託先との間で締結する「運用指図に関する権限の委託契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から更新しない旨を書面によって通知がない限り、1年毎に自動的に更新されるものとします。但し、当該契約はファンドの償還日に終了するものとします。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

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。

#### 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。

#### 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)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成27年12月19日から平成28年12月19日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (平成27年12月18日現在)	第2期 (平成28年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	379,560	345,503
親投資信託受益証券	92,814,757	69,286,416
未収入金	-	4,124
流動資産合計	93,194,317	69,636,043
資産合計	93,194,317	69,636,043
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	117,225
未払受託者報酬	28,685	17,386
未払委託者報酬	329,809	199,909
その他未払費用	2,082	1,242
流動負債合計	360,576	335,762
負債合計	360,576	335,762
純資産の部		
元本等		
元本	75,801,985	55,318,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,031,756	13,982,147
（分配準備積立金）	16,200,870	13,375,792
元本等合計	92,833,741	69,300,281
純資産合計	92,833,741	69,300,281
負債純資産合計	93,194,317	69,636,043

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成26年11月21日 至 平成27年12月18日	自	平成27年12月19日 至 平成28年12月19日
営業収益				
受取利息		223		1
有価証券売買等損益		30,811,775		2,916,773
営業収益合計		30,811,998		2,916,774
営業費用				
支払利息		-		44
受託者報酬		56,068		37,339
委託者報酬		644,643		429,190
その他費用		4,087		2,690
営業費用合計		704,798		469,263
営業利益又は営業損失（ ）		30,107,200		2,447,511
経常利益又は経常損失（ ）		30,107,200		2,447,511
当期純利益又は当期純損失（ ）		30,107,200		2,447,511
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（ ）		13,906,330		911,754
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		17,031,756
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,707,961		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,707,961		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		877,075		4,585,366
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		877,075		4,585,366
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,031,756		13,982,147



## (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	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成27年12月19日から平成28年12月19日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 平成27年12月18日現在	第2期 平成28年12月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 75,801,985口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 55,318,134口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2247円 (10,000口当たり純資産額) (12,247円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2528円 (10,000口当たり純資産額) (12,528円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成26年11月21日 至 平成27年12月18日	第2期 自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,254,553円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>14,946,317円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>830,886円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>17,031,756円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>75,801,985口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,246円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,254,553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	14,946,317円	収益調整金額	C	830,886円	分配準備積立金額	D	0円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,031,756円	当ファンドの期末残存口数	F	75,801,985口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,246円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>519,517円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>1,016,240円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>606,355円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>11,840,035円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>13,982,147円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>55,318,134口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,527円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	519,517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	1,016,240円	収益調整金額	C	606,355円	分配準備積立金額	D	11,840,035円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,982,147円	当ファンドの期末残存口数	F	55,318,134口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,527円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,254,553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	14,946,317円																																																											
収益調整金額	C	830,886円																																																											
分配準備積立金額	D	0円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,031,756円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	75,801,985口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,246円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	519,517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	1,016,240円																																																											
収益調整金額	C	606,355円																																																											
分配準備積立金額	D	11,840,035円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,982,147円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	55,318,134口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,527円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
	2. 追加情報																																																												

	平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。
--	--

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成26年11月21日 至 平成27年12月18日	第2期 自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成27年12月18日現在	第2期 平成28年12月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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。	2. 時価の算定方法 同左
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。	

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成26年11月21日 至 平成27年12月18日	第2期 自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第1期 自 平成26年11月21日 至 平成27年12月18日	第2期 自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19日
期首元本額 - 円	期首元本額 75,801,985円
期中追加設定元本額 157,306,052円	期中追加設定元本額 0円
期中一部解約元本額 81,504,067円	期中一部解約元本額 20,483,851円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成26年11月21日 至 平成27年12月18日	第2期 自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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	1,665,002	1,901,102
合計	1,665,002	1,901,102

## 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(平成28年12月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年12月19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 - B P I 総合 マザーファンド	53,252,184	69,286,416	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 100.0%	53,252,184	69,286,416 100.0%	
合計				69,286,416	

(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 - B P I 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 - B P I 総合 マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成28年12月19日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,951,813,784
国債証券	538,483,300,750
地方債証券	50,111,119,511
特殊債券	53,412,739,291
社債券	28,256,242,470
未収利息	2,103,303,700

(平成28年12月19日現在)

前払費用	21,123,870
流動資産合計	676,339,643,376
資産合計	676,339,643,376
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	952,728,676
未払利息	5,004
流動負債合計	1,152,733,680
負債合計	1,152,733,680
純資産の部	
元本等	
元本	518,923,650,401
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	156,263,259,295
元本等合計	675,186,909,696
純資産合計	675,186,909,696
負債純資産合計	676,339,643,376

## 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。

(貸借対照表に関する注記)

平成28年12月19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	1.3011円
(10,000口当たり純資産額)	(13,011円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年12月19日 至 平成28年12月19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

平成28年12月19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

平成28年12月19日現在	
期首	平成27年12月19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	505,841,897,662円
同期中における追加設定元本額	84,232,566,874円
同期中における一部解約元本額	71,150,814,135円
期末元本額	518,923,650,401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	411,834,463円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	17,996,234,042円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	18,989,607,357円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,511,931,361円
野村資産設計ファンド2015	508,204,681円
野村資産設計ファンド2020	324,085,822円
野村資産設計ファンド2025	243,659,183円
野村資産設計ファンド2030	146,564,982円
野村資産設計ファンド2035	77,581,454円

野村資産設計ファンド2040	157,964,617円
野村日本債券インデックスファンド	1,294,642,835円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	272,519,298,453円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	9,631,977,255円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	4,225,758,471円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	708,475,014円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	14,753,568,417円
野村資産設計ファンド2045	11,100,263円
野村円債投資インデックスファンド	1,847,684,184円
野村インデックスファンド・国内債券	1,367,952,402円
マイ・ロード	34,423,268,020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	263,308,127円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	53,252,184円
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	29,646,575円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	6,017,257,642円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,136,096,617円
野村資産設計ファンド2050	7,928,354円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	7,172,022円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,308,215円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	859,148円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	786,541円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	271,303,097円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	9,868,234円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	45,641,685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)	950,088,774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)	270,122,771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)	8,619,946,778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)	1,704,914,935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)	20,231,190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)	29,016,200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)	4,512,563円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,190,047,889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)	374,571,325円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	2,077,571,683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)	881,653,436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)	198,967,501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)	387,061,350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)	891,538,629円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,788,256,870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)	750,456,867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)	973,601,362円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	12,196,021,688円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	17,895,949,302円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,989,836,029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)	42,111,580,892円
マイバランスDC30	6,953,426,599円
マイバランスDC50	4,586,797,159円

マイバランスDC70	1,383,332,102円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	8,624,177,475円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	67,210,622円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	3,465,992円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	3,470,701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(平成28年12月19日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成28年12月19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360回	2,200,000,000	2,208,954,000	
		国庫債券 利付(2年)第362回	1,400,000,000	1,406,034,000	
		国庫債券 利付(2年)第366回	4,000,000,000	4,019,440,000	
		国庫債券 利付(2年)第368回	1,500,000,000	1,507,830,000	
		国庫債券 利付(2年)第369回	1,500,000,000	1,508,055,000	
		国庫債券 利付(5年)第109回	2,800,000,000	2,812,376,000	
		国庫債券 利付(5年)第110回	1,000,000,000	1,006,920,000	
		国庫債券 利付(5年)第111回	1,400,000,000	1,411,438,000	
		国庫債券 利付(5年)第112回	2,200,000,000	2,220,460,000	
		国庫債券 利付(5年)第113回	7,000,000,000	7,054,600,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	1,500,000,000	1,513,275,000	
		国庫債券 利付(5年)第115回	7,300,000,000	7,351,173,000	
		国庫債券 利付(5年)第116回	8,100,000,000	8,161,641,000	
		国庫債券 利付(5年)第117回	5,900,000,000	5,949,147,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,045,700,000	
		国庫債券 利付(5年)第119回	4,700,000,000	4,731,208,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,553,075,000	
		国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,524,115,000	
		国庫債券 利付(5年)第122回	7,800,000,000	7,855,146,000	



国庫債券 利付（5年）第123回	7,300,000,000	7,352,268,000	
国庫債券 利付（5年）第124回	8,100,000,000	8,158,239,000	
国庫債券 利付（5年）第125回	8,200,000,000	8,261,664,000	
国庫債券 利付（5年）第126回	5,500,000,000	5,543,010,000	
国庫債券 利付（5年）第127回	6,000,000,000	6,048,540,000	
国庫債券 利付（5年）第128回	6,200,000,000	6,250,344,000	
国庫債券 利付（5年）第129回	3,500,000,000	3,529,155,000	
国庫債券 利付（40年）第1回	1,960,000,000	2,895,880,400	
国庫債券 利付（40年）第2回	900,000,000	1,287,306,000	
国庫債券 利付（40年）第3回	900,000,000	1,293,723,000	
国庫債券 利付（40年）第4回	1,300,000,000	1,882,842,000	
国庫債券 利付（40年）第5回	1,300,000,000	1,811,030,000	
国庫債券 利付（40年）第6回	1,300,000,000	1,779,271,000	
国庫債券 利付（40年）第7回	1,400,000,000	1,832,530,000	
国庫債券 利付（40年）第8回	1,500,000,000	1,819,500,000	
国庫債券 利付（40年）第9回	1,500,000,000	1,316,850,000	
国庫債券 利付（10年）第290回	1,250,000,000	1,275,725,000	
国庫債券 利付（10年）第291回	1,400,000,000	1,427,062,000	
国庫債券 利付（10年）第292回	1,600,000,000	1,638,928,000	
国庫債券 利付（10年）第293回	750,000,000	772,732,500	
国庫債券 利付（10年）第294回	500,000,000	514,405,000	
国庫債券 利付（10年）第295回	1,600,000,000	1,641,168,000	
国庫債券 利付（10年）第297回	1,100,000,000	1,134,837,000	
国庫債券 利付（10年）第298回	1,500,000,000	1,544,490,000	
国庫債券 利付（10年）第299回	1,400,000,000	1,446,186,000	
国庫債券 利付（10年）第300回	1,000,000,000	1,037,490,000	
国庫債券 利付（10年）第301回	1,500,000,000	1,561,995,000	
国庫債券 利付（10年）第302回	700,000,000	727,181,000	

国庫債券 利付(10年)第303回	3,300,000,000	3,440,646,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,039,860,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,277,038,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,147,960,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,778,319,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,783,793,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,126,840,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,853,106,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,860,930,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,206,162,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,388,736,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,311,034,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	2,600,000,000	2,749,526,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,474,200,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,900,764,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,363,904,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,958,040,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,686,865,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,377,536,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,520,528,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,841,345,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,349,888,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,138,581,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,193,408,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,256,519,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,716,700,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,584,451,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	4,009,190,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,978,926,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	4,400,000,000	4,586,296,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	5,000,000,000	5,211,650,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,276,382,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,700,000,000	4,868,871,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,700,000,000	2,800,116,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,778,181,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	5,044,942,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,900,000,000	6,077,236,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	6,000,000,000	6,182,880,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	7,200,000,000	7,357,896,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	7,500,000,000	7,527,525,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	6,900,000,000	6,926,013,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,816,820,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	132,815,000	

国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	256,778,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	203,883,200	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,224,828,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	190,420,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	911,813,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	776,184,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	122,142,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	75,396,100	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	277,962,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	193,384,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	280,022,600	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	365,005,600	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,059,808,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,209,042,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,231,379,550	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,596,228,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,971,180,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,103,616,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,900,000,000	2,568,971,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,843,590,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	812,796,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,139,443,200	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	950,768,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	661,210,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,141,635,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,120,772,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	700,000,000	962,381,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	800,000,000	1,088,536,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	900,000,000	1,210,950,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,000,000,000	1,330,910,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,579,934,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,000,000,000	2,598,200,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	2,300,000,000	3,105,161,000	
国庫債券 利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,010,056,000	
国庫債券 利付(30年)第36回	1,800,000,000	2,362,824,000	
国庫債券 利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,976,798,000	

国庫債券	利付（30年）第38回	1,400,000,000	1,782,928,000
国庫債券	利付（30年）第39回	1,600,000,000	2,080,272,000
国庫債券	利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,404,238,000
国庫債券	利付（30年）第41回	1,000,000,000	1,252,660,000
国庫債券	利付（30年）第42回	1,200,000,000	1,505,556,000
国庫債券	利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,633,645,000
国庫債券	利付（30年）第44回	1,400,000,000	1,762,124,000
国庫債券	利付（30年）第45回	1,900,000,000	2,296,131,000
国庫債券	利付（30年）第46回	1,300,000,000	1,573,065,000
国庫債券	利付（30年）第47回	1,900,000,000	2,350,908,000
国庫債券	利付（30年）第48回	1,400,000,000	1,662,374,000
国庫債券	利付（30年）第49回	1,400,000,000	1,664,306,000
国庫債券	利付（30年）第50回	1,900,000,000	1,957,988,000
国庫債券	利付（30年）第51回	2,400,000,000	2,154,744,000
国庫債券	利付（30年）第52回	2,000,000,000	1,901,500,000
国庫債券	利付（20年）第38回	170,000,000	176,256,000
国庫債券	利付（20年）第39回	511,000,000	529,166,050
国庫債券	利付（20年）第40回	525,000,000	547,974,000
国庫債券	利付（20年）第41回	255,000,000	264,531,900
国庫債券	利付（20年）第42回	683,000,000	725,448,450
国庫債券	利付（20年）第43回	400,000,000	433,600,000
国庫債券	利付（20年）第44回	150,000,000	162,744,000
国庫債券	利付（20年）第45回	242,000,000	261,773,820
国庫債券	利付（20年）第46回	90,000,000	97,307,100
国庫債券	利付（20年）第47回	1,230,000,000	1,336,505,700
国庫債券	利付（20年）第48回	200,000,000	220,750,000
国庫債券	利付（20年）第49回	200,000,000	218,636,000
国庫債券	利付（20年）第50回	183,000,000	198,490,950
国庫債券	利付（20年）第51回	310,000,000	339,034,600
国庫債券	利付（20年）第52回	100,000,000	110,343,000
国庫債券	利付（20年）第53回	250,000,000	277,205,000
国庫債券	利付（20年）第54回	250,000,000	278,457,500
国庫債券	利付（20年）第55回	231,000,000	255,908,730
国庫債券	利付（20年）第56回	120,000,000	133,593,600
国庫債券	利付（20年）第57回	210,000,000	232,631,700
国庫債券	利付（20年）第58回	180,000,000	200,347,200

国庫債券 利付(20年)第59回	230,000,000	254,133,900
国庫債券 利付(20年)第60回	780,000,000	847,774,200
国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	319,728,000
国庫債券 利付(20年)第62回	440,000,000	463,768,800
国庫債券 利付(20年)第63回	300,000,000	335,730,000
国庫債券 利付(20年)第64回	400,000,000	452,044,000
国庫債券 利付(20年)第65回	455,000,000	515,669,700
国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	337,902,000
国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	352,153,800
国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	335,727,200
国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	644,252,000
国庫債券 利付(20年)第70回	540,000,000	635,715,000
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	232,458,000
国庫債券 利付(20年)第72回	670,000,000	776,905,200
国庫債券 利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,850,720,000
国庫債券 利付(20年)第74回	1,300,000,000	1,514,084,000
国庫債券 利付(20年)第75回	600,000,000	701,556,000
国庫債券 利付(20年)第76回	910,000,000	1,049,075,300
国庫債券 利付(20年)第77回	700,000,000	812,728,000
国庫債券 利付(20年)第78回	800,000,000	925,592,000
国庫債券 利付(20年)第79回	860,000,000	1,002,295,600
国庫債券 利付(20年)第80回	900,000,000	1,056,528,000
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	421,326,000
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	966,829,200
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,621,545,700
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,409,592,000
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	475,448,000
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,689,828,000
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	598,910,000
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,333,277,000
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	565,231,400
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,810,200,000
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	304,122,500
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,861,441,500
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	358,524,000
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	241,048,000

国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	860,846,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	483,596,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,591,135,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	363,993,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,555,469,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,872,822,400	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	313,582,500	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	629,265,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	748,320,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	489,808,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,333,105,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	495,808,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	369,378,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,932,256,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,089,360,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,357,884,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	999,320,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,226,438,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	1,800,000,000	2,232,072,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	3,107,625,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	627,870,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,383,844,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,900,000,000	2,365,747,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	617,050,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	966,296,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	945,312,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,500,000,000	1,835,040,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,331,033,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	2,000,000,000	2,505,460,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,239,180,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,142,163,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,241,540,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	981,552,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,500,000,000	1,842,360,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	607,140,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	1,944,432,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	960,888,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,563,432,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,703,814,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	900,000,000	1,096,785,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	481,632,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	832,041,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,204,620,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	940,064,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	832,895,000	



国庫債券 利付(20年)第140回	3,000,000,000	3,615,240,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,050,761,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,526,887,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	2,500,000,000	2,978,000,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,763,775,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,140,046,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	3,700,000,000	4,469,008,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,700,000,000	3,218,211,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,500,000,000	2,938,850,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,600,000,000	3,055,156,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	2,930,000,000	3,393,027,900	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,032,073,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	3,200,000,000	3,589,472,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	3,450,000,000	3,927,238,500	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,500,000,000	3,919,930,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,029,740,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,900,000,000	2,816,944,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,900,000,000	3,634,020,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	3,700,000,000	3,644,315,000	
メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	297,186,000	
ポーランド共和国 第15回円貨社債(2013)	100,000,000	100,773,000	
小計 銘柄数:264	490,265,000,000	538,483,300,750	

小計

		組入時価比率：79.8%		80.3%
合計				538,483,300,750
地方債証券	日本円	東京都 公募第655回	100,000,000	101,766,000
		東京都 公募第659回	300,000,000	307,296,000
		東京都 公募第660回	100,000,000	102,372,000
		東京都 公募第664回	100,000,000	102,928,000
		東京都 公募第668回	200,000,000	206,926,000
		東京都 公募第671回	100,000,000	103,551,000
		東京都 公募第685回	100,000,000	103,953,000
		東京都 公募第690回	200,000,000	210,312,000
		東京都 公募第703回	100,000,000	104,768,000
		東京都 公募第707回	100,000,000	104,316,000
		東京都 公募第708回	100,000,000	104,608,000
		東京都 公募第710回	100,000,000	104,169,000
		東京都 公募第712回	100,000,000	104,100,000
		東京都 公募第715回	100,000,000	104,186,000
		東京都 公募第716回	200,000,000	208,492,000
		東京都 公募（30年）第7回	100,000,000	133,523,000
		東京都 公募第10回	200,000,000	261,376,000
		東京都 公募（7年）第3回	100,000,000	101,008,000
		東京都 公募第1回	300,000,000	328,434,000
		東京都 公募（20年）第3回	100,000,000	115,453,000
		東京都 公募第7回	100,000,000	117,462,000
		東京都 公募（20年）第16回	200,000,000	239,484,000
		東京都 公募（20年）第17回	200,000,000	241,336,000
		東京都 公募第23回	100,000,000	122,848,000
		東京都 公募（20年）第26回	300,000,000	355,020,000
		北海道 公募平成20年度第7回	300,000,000	309,096,000
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	104,342,000
		北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	104,494,000
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	104,340,000
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	104,175,000
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	309,183,000
		北海道 公募（5年）平成25年度第8回	100,000,000	100,539,000
北海道 公募（5年）平成26年度第8回	200,000,000	200,984,000		

北海道 公募(5年)平成26年度 第10回	100,000,000	100,432,000	
北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	103,118,000	
宮城県 公募(5年)第9回1号	500,000,000	502,790,000	
神奈川県 公募第155回	100,000,000	102,417,000	
神奈川県 公募第156回	101,000,000	103,933,040	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	104,606,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	210,404,000	
神奈川県 公募第196回	100,000,000	103,718,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	104,898,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	103,869,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	103,853,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	204,840,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	134,061,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	359,223,000	
神奈川県 公募(5年)第56回	100,000,000	100,355,000	
大阪府 公募第320回	400,000,000	414,300,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	209,564,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	105,199,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	105,345,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	108,183,920	
大阪府 公募第384回	100,000,000	103,864,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	308,286,000	
大阪府 公募第5回	100,000,000	122,443,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	118,807,000	
大阪府 公募第98回	200,000,000	201,028,000	
大阪府 公募(5年)第99回	240,000,000	241,060,800	
大阪府 公募(5年)第101回	148,000,000	148,686,720	
大阪府 公募第102回	100,000,000	100,471,000	
大阪府 公募(5年)第130回	600,000,000	600,126,000	
京都府 公募平成20年度第3回	140,000,000	144,439,400	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	104,660,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	104,274,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	113,546,000	
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	206,346,000	
兵庫県 公募平成20年度第3回	100,000,000	102,501,000	

兵庫県	公募平成20年度第12回	100,000,000	103,538,000	
兵庫県	公募平成20年度第16回	100,000,000	103,353,000	
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	103,811,000	
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	104,505,000	
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	104,834,000	
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	131,726,000	
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	342,096,000	
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	110,816,000	
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	309,855,000	
兵庫県	公募第2回	100,000,000	121,674,000	
兵庫県	公募第9回	100,000,000	123,046,000	
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,399,000	
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	104,193,000	
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	104,602,000	
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	103,721,000	
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	106,536,820	
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	171,606,600	
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	103,181,000	
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	206,296,000	
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	114,768,762	
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	297,540,000	
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,875,000	
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,111,000	
愛知県	公募平成20年度第7回	210,000,000	216,171,900	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	119,950,000	
愛知県	公募平成20年度第10回	100,000,000	103,357,000	
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	118,864,380	
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	104,487,000	
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	104,689,000	
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	104,373,000	
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	104,931,000	
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,947,000	
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	117,388,000	
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	445,256,000	
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	119,664,000	

愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	123,256,000	
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	111,885,000	
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,740,000	
広島県	公募平成20年度第3回	300,000,000	308,463,000	
広島県	公募平成22年度第6回	200,000,000	210,402,000	
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	104,378,000	
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	209,480,000	
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	300,000,000	301,377,000	
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,230,056	
埼玉県	公募平成19年度第7回	200,000,000	203,924,000	
埼玉県	公募平成20年度第1回	100,000,000	102,083,000	
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	103,942,000	
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	209,406,000	
埼玉県	公募平成24年度第4回	100,000,000	104,350,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	105,447,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	155,078,840	
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	100,000,000	100,477,000	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	103,908,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	103,815,000	
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	103,966,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	206,210,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	410,488,000	
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	102,256,000	
福岡県	公募平成20年度第3回	100,000,000	102,387,000	
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	103,636,000	
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	104,969,000	
福岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	100,194,000	
福岡県	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,373,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	112,417,000	
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	134,396,000	
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	123,551,000	
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	120,066,000	
福岡県	公募(20年)平成24年	100,000,000	116,559,000	

度第 2 回			
千葉県 公募平成 2 0 年度第 1 回	100,000,000	102,087,000	
千葉県 公募平成 2 0 年度第 6 回	200,000,000	206,062,000	
千葉県 公募平成 2 1 年度第 1 回	100,000,000	103,592,000	
千葉県 公募平成 2 1 年度第 1 1 回	180,000,000	187,920,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	105,305,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 2 回	100,000,000	104,600,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 8 回	100,000,000	104,665,000	
千葉県 公募平成 2 5 年度第 2 回	900,000,000	903,330,000	
千葉県 公募平成 2 5 年度第 3 回	100,000,000	105,211,000	
千葉県 公募平成 2 5 年度第 4 回	100,000,000	105,443,000	
千葉県 公募（ 2 0 年 ） 第 8 回	100,000,000	122,998,000	
千葉県 公募（ 2 0 年 ） 第 1 7 回	100,000,000	112,656,000	
新潟県 公募平成 2 0 年度第 2 回	200,000,000	206,674,000	
新潟県 公募平成 2 1 年度第 2 回	150,000,000	156,978,000	
長野県 公募平成 2 5 年度第 1 回	1,100,000,000	1,105,313,000	
群馬県 公募第 8 回	100,000,000	105,104,000	
群馬県 公募第 1 2 回	100,000,000	103,108,000	
群馬県 公募（ 5 年 ） 第 4 回	600,000,000	602,700,000	
群馬県 公募（ 2 0 年 ） 第 3 回	100,000,000	117,423,000	
岐阜県 公募平成 2 6 年度第 1 回	186,670,000	192,477,303	
共同発行市場地方債 公募第 5 8 回	270,500,000	275,222,930	
共同発行市場地方債 公募第 6 2 回	100,000,000	102,495,000	
共同発行市場地方債 公募第 6 3 回	200,000,000	205,730,000	
共同発行市場地方債 公募第 6 4 回	262,000,000	269,440,800	
共同発行市場地方債 公募第 6 5 回	700,000,000	718,998,000	
共同発行市場地方債 公募第 6 6 回	181,000,000	185,944,920	
共同発行市場地方債 公募第 6 8 回	900,000,000	929,277,000	
共同発行市場地方債 公募第 7 0 回	110,000,000	113,281,300	
共同発行市場地方債 公募第 7 4 回	500,000,000	519,055,000	
共同発行市場地方債 公募第 7 5 回	310,000,000	323,119,200	
共同発行市場地方債 公募第 8 2 回	300,000,000	313,200,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 4 回	500,000,000	522,455,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 5 回	100,000,000	104,759,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 8 回	100,000,000	104,208,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 9 回	100,000,000	103,840,000	

共同発行市場地方債 公募第92回	110,000,000	114,459,400	
共同発行市場地方債 公募第93回	300,000,000	315,138,000	
共同発行市場地方債 公募第94回	300,000,000	315,291,000	
共同発行市場地方債 公募第96回	100,000,000	105,456,000	
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	314,814,000	
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	157,395,000	
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	104,873,000	
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	210,022,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	208,982,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	209,118,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	200,000,000	207,980,000	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	104,282,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	208,626,000	
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	104,633,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	208,876,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	311,211,000	
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	103,062,000	
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	413,684,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	105,377,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	104,807,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	311,442,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	104,553,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	103,850,000	

共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	207,020,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	206,362,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	159,761,600	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	553,008,600	
共同発行市場地方債 公募第145回	500,000,000	510,340,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	99,361,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	100,000,000	99,172,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	120,674,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	119,321,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	104,248,000	
島根県 公募平成25年度第3回	700,000,000	703,304,000	
福島県 公募平成24年度第2回	100,000,000	100,195,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,476,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,752,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	145,887,960	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,752,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	243,180,960	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,479,000	
大阪市 公募平成20年度第3回	110,000,000	113,183,400	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	104,617,000	
大阪市 公募平成25年度第1回	800,000,000	804,560,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	104,080,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,407,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	114,969,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	124,642,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	121,987,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	117,913,000	
名古屋市 公募第464回	300,000,000	308,442,000	
名古屋市 公募第469回	100,000,000	104,023,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	105,270,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	310,302,000	



名古屋市 公募(6年)第1回	200,000,000	200,848,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	214,734,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	106,542,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	193,649,900	
京都市 公募平成20年度第4回	200,000,000	206,742,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	105,105,000	
京都市 公募平成25年度第3回	100,000,000	100,544,000	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	117,015,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	111,837,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	104,324,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,123,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	198,346,000	
横浜市 公募平成20年度第3回	100,000,000	102,673,000	
横浜市 公募公債平成20年度5回	200,000,000	206,328,000	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	207,690,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	105,028,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	208,706,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	207,386,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	207,610,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	205,138,000	
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	118,841,000	
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	112,144,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	103,673,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	119,113,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	103,007,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	204,508,000	
川崎市 公募第81回	100,000,000	103,531,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	104,301,000	
川崎市 公募第85回	100,000,000	103,884,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	114,935,000	
北九州市 公募(5年)平成25年度第2回	100,000,000	100,544,000	
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	118,052,000	
福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	102,282,000	
福岡市 公募(5年)平成25年度第2回	300,000,000	301,671,000	

		福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	114,175,000	
		福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,037,000	
		福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	164,112,000	
		広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	104,042,000	
		広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,464,000	
		仙台市 公募平成25年度第1回	600,000,000	603,036,000	
		千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	105,305,000	
		鹿児島県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100,443,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	102,368,000	
		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	198,434,000	
		徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	416,560,000	
		山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	104,052,000	
		岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	104,529,000	
		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	121,661,000	
		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	366,723,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	120,269,000	
	小計	銘柄数:275 組入時価比率:7.4%	47,636,420,000	50,111,119,511	7.5%
	合計			50,111,119,511	
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	101,998,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	157,973,180	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	201,524,100	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,356,000	
		原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回	2,100,000,000	2,103,738,000	
		韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	100,000,000	100,584,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	114,038,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	101,433,000	

日本政策投資銀行社債 財投機関債 第31回	300,000,000	312,846,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第47回	100,000,000	107,870,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 5回	100,000,000	103,271,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 9回	141,000,000	146,346,720	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 16回	102,000,000	106,866,420	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 19回	140,000,000	145,560,800	
日本高速道路保有・債務返済機構承 継 政府保証第344回	200,000,000	211,508,000	
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	133,185,000	
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	241,512,000	
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	120,788,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第23回	200,000,000	243,502,000	
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	298,704,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第38回	100,000,000	102,807,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第39回	100,000,000	123,221,000	
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	124,474,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第80回	100,000,000	105,243,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第84回	400,000,000	420,412,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第86回	200,000,000	209,410,000	
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	117,411,000	
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	103,837,000	
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	410,081,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	119,692,000	

券 財投機関債第105回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第127回	300,000,000	301,380,000	
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	206,310,000	
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	205,850,000	
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	206,636,000	
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	341,736,000	
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	115,940,000	
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	86,061,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第6回	100,000,000	108,002,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第9回	100,000,000	108,151,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第56回	205,000,000	208,841,700	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第58回	136,000,000	139,353,760	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第60回	283,000,000	290,810,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第62回	100,000,000	102,755,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第67回	341,000,000	351,219,770	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第69回	100,000,000	103,124,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第71回	100,000,000	102,843,000	
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	244,518,000	
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	244,650,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第98回	300,000,000	312,255,000	
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	246,866,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第100回	400,000,000	418,024,000	

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	244,834,000	
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	239,970,000	
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	128,553,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	440,000,000	464,217,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	147,033,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	104,672,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	146,627,600	
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	123,569,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	104,763,000	
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	117,093,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	228,078,140	
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	115,928,000	
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	377,490,000	
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	209,588,000	
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	209,400,000	
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	208,586,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	400,000,000	419,704,000	
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	118,546,000	
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	202,289,640	
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	414,664,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	200,000,000	211,034,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	272,000,000	286,350,720	

券 政府保証債第 1 9 7 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 0 7 回	300,000,000	313,272,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 1 回	137,000,000	142,773,180	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 3 回	145,000,000	150,978,350	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 6 回	100,000,000	114,409,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 7 回	100,000,000	122,339,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 9 回	100,000,000	114,307,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 0 回	100,000,000	104,171,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 4 回	100,000,000	122,510,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 5 回	190,000,000	196,650,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 3 4 回	100,000,000	102,953,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 3 9 回	300,000,000	326,973,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 7 1 回	151,000,000	149,613,820	
日本高速道路保有・債務返済機構承 継 財投機関債第 3 3 回	100,000,000	137,370,000	
公営企業債券 政府保証第 8 8 1 回	200,000,000	203,296,000	
公営企業債券 政府保証第 8 8 6 回	203,000,000	208,505,360	
公営企業債券 3 0 年第 4 回財投機 関債	100,000,000	137,856,000	
公営企業債券 政府保証 1 5 年第 1 回	300,000,000	316,938,000	
政保 地方公営企業等金融機構債 券 第 2 回	400,000,000	412,284,000	
地方公営企業等金融機構債券 第 1 回	200,000,000	206,242,000	
地方公営企業等金融機構債券（ 2 0 年） 第 1 回	100,000,000	120,019,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 回	100,000,000	104,158,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 回	100,000,000	103,655,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保	200,000,000	206,848,000	

証第 5 回			
地方公共団体金融機構債券 20年 第 4 回	100,000,000	121,586,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第 6 回	300,000,000	370,353,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 回	100,000,000	110,148,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 3 回	200,000,000	208,960,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第 1 6 回	100,000,000	103,792,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 6 回	100,000,000	104,400,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 7 回	300,000,000	314,391,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 8 回	100,000,000	104,954,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 4 回	100,000,000	109,311,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 ( 6 年 ) 第 4 回	500,000,000	502,555,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6 回	100,000,000	108,142,000	
地方公共団体金融機構債券 第 3 7 回	400,000,000	418,012,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 8 回	194,000,000	203,176,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 9 回	100,000,000	104,587,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 0 回	101,000,000	105,809,620	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	102,000,000	106,764,420	
地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	600,000,000	626,862,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回	100,000,000	106,829,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4 回	200,000,000	204,322,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	214,546,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	113,198,040	

地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	104,541,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	210,881,940	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	102,000,000	107,004,120	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	104,529,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	233,795,430	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	108,013,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	105,705,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第10回	300,000,000	303,072,000	
地方公共団体金融機構債券 第51回	300,000,000	315,822,000	
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	315,237,000	
地方公共団体金融機構債券(15年) 第2回	200,000,000	218,840,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	120,965,960	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第14回	300,000,000	302,190,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第38回	100,000,000	113,847,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,414,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,260,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回	100,000,000	112,802,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	413,680,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	300,000,000	307,626,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	195,374,970	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	521,175,280	
地方公共団体金融機構債券 第79回	100,000,000	102,698,000	



回			
公営企業債券(20年) 第2回財 投機関債	100,000,000	108,410,000	
公営企業債券(20年) 第5回財 投機関債	200,000,000	227,730,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	124,321,000	
首都高速道路社債 第12回	100,000,000	100,586,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	104,046,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,495,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	104,251,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第 22回	2,000,000,000	2,009,240,000	
中小企業債券 第6回財投機関債	100,000,000	100,980,000	
都市再生債券 財投機関債第21回	300,000,000	309,027,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	105,045,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,748,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7回	100,000,000	117,564,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	120,000,000	125,216,400	
東京交通債券 第342回	200,000,000	223,830,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	176,643,840	
関西国際空港社債 財投機関債第2 6回	300,000,000	313,038,000	
関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	105,473,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	104,913,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	382,657,440	
預金保険機構債券 政府保証第20 9回	2,000,000,000	2,008,780,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	200,000,000	240,764,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第14回	200,000,000	204,636,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	114,134,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第25回	300,000,000	310,032,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第41回	100,000,000	104,489,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	114,487,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	120,080,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	105,597,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	122,056,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	344,013,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	121,944,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	105,022,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	209,824,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	227,456,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	130,311,000
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	209,232,000
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,318,000
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	105,382,000
商工債券 利付第753回い号	100,000,000	100,285,000
農林債券 利付第752回い号	100,000,000	100,320,000
農林債券 利付第756回い号	100,000,000	100,419,000
農林債券 利付第759回い号	100,000,000	100,660,000
農林債券 利付第760回い号	100,000,000	100,692,000
農林債券 利付第761回い号	100,000,000	100,540,000
農林債券 利付第764回い号	100,000,000	100,703,000
農林債券 利付第765回い号	300,000,000	301,872,000
農林債券 利付第767回い号	300,000,000	302,007,000
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	301,878,000
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	302,106,000
農林債券 利付第781回い号	100,000,000	100,844,000
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,630,000
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,603,000

しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,540,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,598,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,528,000	
しんきん中金債券 利付第308回	100,000,000	100,744,000	
商工債券 利付(3年)第181回	500,000,000	500,830,000	
商工債券 利付(3年)第182回	100,000,000	100,164,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	122,126,000	
東日本高速道路 第21回	100,000,000	100,870,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,762,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,620,000	
中日本高速道路社債 第32回	200,000,000	202,226,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	101,475,000	
中日本高速道路社債 第47回	100,000,000	100,339,000	
中日本高速道路 第62回	100,000,000	100,848,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	103,018,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	209,544,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	103,084,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	298,065,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	200,000,000	208,790,000	
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	206,652,000	
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	113,129,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	13,872,000	14,341,428	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	47,511,000	49,103,568	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	85,090,000	88,497,854	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	86,502,000	88,623,894	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	53,982,000	56,500,260	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	64,995,000	69,529,701	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	18,931,000	20,175,145	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫	43,822,000	46,016,605	

債券			
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	48,480,000	51,376,195	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	52,692,000	54,783,872	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	96,004,000	100,352,021	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	90,790,000	95,568,277	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	84,124,000	90,124,564	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	48,636,000	51,581,882	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	24,023,000	25,540,773	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	34,629,000	37,566,924	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	117,795,000	126,415,238	
貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券	29,899,000	31,068,050	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	124,686,000	131,013,814	
貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	61,180,000	63,731,206	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	163,125,000	173,992,387	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	117,438,000	123,953,460	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	65,116,000	70,672,348	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	156,132,000	167,326,664	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	164,604,000	171,986,489	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	207,588,000	216,512,208	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	204,672,000	214,592,451	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	134,308,000	140,429,758	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	55,820,000	59,236,184	

貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	123,594,000	130,951,550	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	70,250,000	72,899,127	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	147,376,000	152,999,868	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	70,199,000	72,847,608	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	36,830,000	38,499,503	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	206,712,000	216,448,135	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	43,342,000	46,294,890	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	44,948,000	47,983,338	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	46,667,000	49,736,288	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	54,957,000	58,775,961	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	134,710,000	141,780,927	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	196,137,000	206,477,342	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	65,954,000	69,490,453	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	132,340,000	138,307,210	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	17,776,000	18,633,336	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	137,045,000	142,163,630	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	55,540,000	57,536,663	
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券	23,472,000	23,911,395	
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	49,984,000	51,160,123	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	259,235,000	272,616,710	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	135,588,000	142,607,390	
貸付債権担保第64回住宅金融支援	216,627,000	225,383,063	

	機構債券		
	貸付債権担保第7-1回住宅金融支援機構債券	203,685,000	211,225,418
	貸付債権担保第7-3回住宅金融支援機構債券	148,746,000	156,412,368
	貸付債権担保第7-5回住宅金融支援機構債券	132,426,000	138,781,123
	貸付債権担保第8-3回住宅金融支援機構債券	306,692,000	317,849,454
	貸付債権担保第8-4回住宅金融支援機構債券	536,368,000	555,006,788
	貸付債権担保第8-8回住宅金融支援機構債券	79,347,000	81,710,747
	貸付債権担保第8-9回住宅金融支援機構債券	81,118,000	83,644,825
	貸付債権担保第9-0回住宅金融支援機構債券	81,684,000	83,823,303
	貸付債権担保第9-2回住宅金融支援機構債券	168,228,000	171,582,466
	貸付債権担保第9-3回住宅金融支援機構債券	172,144,000	173,896,425
	貸付債権担保第9-4回住宅金融支援機構債券	88,048,000	90,171,717
	貸付債権担保第9-6回住宅金融支援機構債券	90,373,000	92,199,438
	貸付債権担保第9-7回住宅金融支援機構債券	268,845,000	275,934,442
	貸付債権担保第9-8回住宅金融支援機構債券	273,366,000	281,878,617
	貸付債権担保第9-9回住宅金融支援機構債券	182,704,000	188,102,903
	貸付債権担保第10-0回住宅金融支援機構債券	91,568,000	93,999,130
	貸付債権担保第10-1回住宅金融支援機構債券	92,423,000	95,210,477
	貸付債権担保第11-5回住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,728,000
	貸付債権担保第11-6回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,378,000
小計	銘柄数：283	50,526,494,000	53,412,739,291
	組入時価比率：7.9%		8.0%
合計			53,412,739,291

社債券	日本円	クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,106,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・ バンキング 第2回円貨社債	200,000,000	199,368,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハッ ド 第2回円貨社債(2015)	200,000,000	193,670,000	
		スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	99,206,000	
		スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	96,233,000	
		エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	99,453,000	
		エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	100,302,000	
		エイチエスピーシー・ファイナン ス・コーポレーション 第12回	100,000,000	107,598,000	
		パークレイズ・バンク・ピーエル シー 第7回円貨社債	100,000,000	99,434,000	
		ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	200,000,000	199,906,000	
		ラボバンク・ネダーランド 第23 回円貨社債(2013)	100,000,000	100,415,000	
		ラボバンク・ネダーランド 第25 回円貨社債(2014)	100,000,000	100,164,000	
		ソシエテ ジェネラル 第6回円貨 社債(2014)	200,000,000	200,762,000	
		清水建設 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,765,000	
		大和ハウス工業 第5回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,626,000	
		森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,102,000	
		アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,179,000	
		アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,387,000	
		キリンホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,380,000	
		トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,503,000	
		野村不動産ホールディングス 第5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,865,000	
		森ヒルズリート投資法人 第17回	200,000,000	197,028,000	

特定投資法人債間限定同順位特			
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,579,000	
東急不動産ホールディングス 第2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,234,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,813,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,928,000	
住友化学 第43回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	104,530,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,149,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,953,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,224,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,325,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,334,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,576,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	103,607,000	
JXホールディングス 第9回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	102,855,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,571,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,402,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,292,000	
住友大阪セメント 第14回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,212,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	104,372,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	98,798,000	
神戸製鋼所 第63回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,407,000	
ジェイ エフ イー ホールディン グス 第22回（JFEス保証	100,000,000	101,250,000	



豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,271,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,361,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	217,360,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,776,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,678,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,602,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,187,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,978,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,539,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,622,000	
ソニー 第26回	100,000,000	104,610,000	
ソニー 第32回	200,000,000	198,420,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,658,000	
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	300,000,000	300,930,000	
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,902,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	104,644,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,767,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,705,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,311,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,960,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,750,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,048,000	

豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,666,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,931,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,175,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,043,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,872,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,176,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,190,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,144,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,639,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,455,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,424,000	
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	102,483,000	
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	204,082,000	
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	123,320,000	
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,846,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	105,526,000	
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,483,000	
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	112,077,000	
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,771,000	
三菱東京UFJ銀行 第140回特定社債間限定同順位特約付	500,000,000	501,255,000	
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	304,956,000	
三井住友フィナンシャルグループ	100,000,000	102,033,000	

第3回劣後特約付			
三井住友フィナンシャルグループ	100,000,000	106,096,000	
第4回劣後特約付			
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,239,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	316,941,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	105,924,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	316,323,000	
三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,571,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,656,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,042,000	
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	204,330,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	105,722,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,544,000	
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付	1,000,000,000	1,005,980,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,371,000	
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,272,000	
ホンダファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,393,000	
ホンダファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,246,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,899,000	
オリエントコーポレーション 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,118,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,735,000	
日立キャピタル 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,884,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,164,000	
オリックス 第164回社債間限定	100,000,000	102,301,000	

同順位特約付			
三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,556,000	
三井住友ファイナンス&リース 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,076,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,482,000	
大和証券グループ本社 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,473,000	
大和証券グループ本社 第22回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,408,000	
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	102,201,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	105,311,000	
野村ホールディングス 第41回	200,000,000	202,004,000	
第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	101,911,000	
三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,230,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	111,169,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,122,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,910,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,167,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,914,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,989,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,714,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,655,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,730,000	
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	103,954,000	
オリックス不動産投資法人 第5回特定投資法人債間限定同順位特	100,000,000	100,684,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投	100,000,000	101,285,000	

資法人 第5回特定投資法人債			
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,564,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,888,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,181,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,374,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	109,288,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	222,700,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,828,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,724,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,765,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	121,199,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,302,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,916,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	246,844,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,657,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,429,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,455,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,196,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,975,000	
A N A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	96,725,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,814,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,524,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	104,443,000	

K D D I 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,746,000	
N T T ドコモ 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,859,000	
東京電力 第 4 5 5 回	200,000,000	206,592,000	
東京電力 第 4 5 9 回	100,000,000	105,026,000	
東京電力 第 5 4 2 回	100,000,000	101,845,000	
東京電力 第 5 4 4 回	100,000,000	102,612,000	
東京電力 第 5 4 7 回	100,000,000	105,473,000	
東京電力 第 5 4 8 回	100,000,000	113,714,000	
東京電力 第 5 5 9 回	100,000,000	102,893,000	
東京電力 第 5 6 0 回	100,000,000	111,445,000	
東京電力 第 5 6 5 回	300,000,000	309,435,000	
中部電力 第 4 8 2 回	200,000,000	210,174,000	
中部電力 第 5 0 0 回	200,000,000	207,750,000	
関西電力 第 4 4 8 回	200,000,000	206,130,000	
関西電力 第 4 6 9 回	100,000,000	102,852,000	
関西電力 第 4 8 2 回	100,000,000	103,351,000	
関西電力 第 4 8 4 回	100,000,000	102,756,000	
関西電力 第 4 9 6 回	100,000,000	103,738,000	
関西電力 第 4 9 7 回	200,000,000	209,210,000	
関西電力 第 4 9 8 回	200,000,000	201,230,000	
中国電力 第 3 1 4 回	100,000,000	103,793,000	
中国電力 第 3 3 0 回	100,000,000	107,872,000	
中国電力 第 3 7 7 回	200,000,000	210,756,000	
中国電力 第 3 7 8 回	100,000,000	104,687,000	
北陸電力 第 3 0 1 回	100,000,000	105,434,000	
北陸電力 第 3 0 4 回	100,000,000	104,586,000	
北陸電力 第 3 0 7 回	100,000,000	106,296,000	
北陸電力 第 3 0 8 回	100,000,000	103,092,000	
東北電力 第 4 3 1 回	400,000,000	409,920,000	
東北電力 第 4 7 3 回	100,000,000	101,411,000	
東北電力 第 4 7 5 回	100,000,000	103,044,000	
東北電力 第 4 8 1 回	200,000,000	206,526,000	
四国電力 第 2 8 1 回	200,000,000	211,036,000	
九州電力 第 4 0 0 回	100,000,000	105,118,000	
九州電力 第 4 0 9 回	100,000,000	103,429,000	

	九州電力 第420回	300,000,000	302,913,000	
	九州電力 第424回	200,000,000	211,582,000	
	北海道電力 第296回	100,000,000	102,922,000	
	北海道電力 第316回	207,000,000	213,667,470	
	北海道電力 第323回	100,000,000	109,054,000	
	北海道電力 第338回	100,000,000	97,815,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,462,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,573,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,052,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,826,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,072,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,845,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	123,925,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,193,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,453,000	
	東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,344,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,737,000	
小計	銘柄数：205 組入時価比率：4.2%	27,407,000,000	28,256,242,470	4.2%
合計			28,256,242,470	
合計			670,263,402,022	

(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】

野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）

平成29年 1月31日現在

資産総額	65,704,405円
負債総額	43,099円
純資産総額（ - ）	65,661,306円
発行済口数	52,618,281口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2479円

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	690,752,435,819円
負債総額	9,589,456,969円
純資産総額（ - ）	681,162,978,850円
発行済口数	525,276,722,898口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2968円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡

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

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先



口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

平成29年1月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

当社は指名委員会等設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

###### 株主総会

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

###### 取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

###### 代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役会で選定された執行役員が含まれます。

###### 委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成28年12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	938	20,027,932
単位型株式投資信託	67	311,767
追加型公社債投資信託	15	6,008,627
単位型公社債投資信託	316	1,931,751
合計	1,336	28,280,077

### 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。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57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. 財務諸表及び中間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(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		411	208
金銭の信託		56,824	55,341
有価証券		17,100	24,100
前払金		15	34
前払費用		29	2
未収入金		330	511
未収委託者報酬		12,679	14,131
未収運用受託報酬		7,436	7,309
繰延税金資産		2,594	2,028
その他		73	56
貸倒引当金		9	10
流動資産計		97,486	103,715

固定資産					
有形固定資産			1,322		1,176
建物	2	413		403	
器具備品	2	909		773	
無形固定資産			7,254		7,681
ソフトウェア		7,253		7,680	
その他		1		0	
投資その他の資産			24,840		23,225
投資有価証券		11,593		9,216	
関係会社株式		10,149		10,958	
従業員長期貸付金		30		-	
長期差入保証金		49		45	
長期前払費用		60		49	
前払年金費用		2,776		2,777	
その他		179		176	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			33,417		32,083
資産合計			130,903		135,799

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			118		118
未払金	1		11,602		11,855
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		32		31	
未払手数料		4,883		4,537	
その他未払金		6,684		7,284	
未払費用	1		10,221		8,872
未払法人税等			1,961		1,838
前受収益			-		45
賞与引当金			4,558		4,809
外国税支払損失引当金			1,721		-
流動負債計			30,182		27,538
固定負債					
退職給付引当金			2,467		2,708
時効後支払損引当金			521		526
繰延税金負債			747		68
固定負債計			3,735		3,303
負債合計			33,918		30,842
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			90,092		99,606
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			11,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		-		2,000	
利益剰余金			61,182		68,696
利益準備金		685		685	

その他利益剰余金		60,497		68,011
別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		35,890		43,405
評価・換算差額等			6,893	5,349
その他有価証券評価差額金			6,893	5,349
純資産合計			96,985	104,956
負債・純資産合計			130,903	135,799

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)		当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			96,159		104,445
運用受託報酬			31,466		31,351
その他営業収益			221		219
営業収益計			127,847		136,016
営業費用					
支払手数料			47,060		46,531
広告宣伝費			823		1,008
公告費			-		0
受益証券発行費			5		5
調査費			28,326		28,068
調査費		1,299		4,900	
委託調査費		27,027		23,167	
委託計算費			1,156		1,148
営業雑経費			3,275		3,899
通信費		193		185	
印刷費		951		969	
協会費		77		78	
諸経費		2,053		2,666	
営業費用計			80,648		80,662
一般管理費					
給料			11,660		11,835
役員報酬	2	289		367	
給料・手当		6,874		6,928	
賞与		4,496		4,539	
交際費			131		124
旅費交通費			472		488
租税公課			501		695
不動産賃借料			1,218		1,230
退職給付費用			723		1,063
固定資産減価償却費			3,120		2,589
諸経費			6,815		7,801
一般管理費計			24,643		25,827
営業利益			22,555		29,526

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)		当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,038		7,323	
受取利息		5		4	
金銭の信託運用益		347		-	
為替差益		-		281	
その他		366		382	
営業外収益計			4,756		7,991
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,196	
時効後支払損引当金繰入額		28		72	
その他		137		52	
営業外費用計			166		1,321
經常利益			27,146		36,196
特別利益					
投資有価証券等売却益		794		50	
株式報酬受入益		142		96	
特別利益計			936		146
特別損失					
投資有価証券売却損		-		95	
投資有価証券等評価損		91		-	
固定資産除却損	3	357		60	
外国税支払損失引当金繰入額		1,721		-	
特別損失計			2,169		156
税引前当期純利益			25,913		36,186
法人税、住民税及び事業税			8,433		9,806
法人税等調整額			2,488		744
当期純利益			19,967		25,635

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249

会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(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	6,679	6,679	86,929
会計方針の変更による累積的影響額			81
会計方針の変更を反映した当期首残高	6,679	6,679	86,847
当期変動額			
剰余金の配当			10,043
当期純利益			19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	213	213	213
当期変動額合計	213	213	10,137
当期末残高	6,893	6,893	96,985

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金



	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当期変動額									
剰余金の配当							19,933	19,933	19,933
当期純利益							25,635	25,635	25,635
合併による増加			2,000	2,000			144	144	2,144
吸収分割による増加							1,668	1,668	1,668
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	2,000	2,000	-	-	7,514	7,514	9,514
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606

(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	6,893	6,893	96,985
当期変動額			
剰余金の配当			19,933
当期純利益			25,635
合併による増加			2,144
吸収分割による増加			1,668
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,543	1,543	1,543
当期変動額合計	1,543	1,543	7,971
当期末残高	5,349	5,349	104,956

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券  時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法  (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)  時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>
--------------------	--

<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>4. 引当金の計上基準</p> <p>5. 消費税等の会計処理方法</p> <p>6. 連結納税制度の適用</p>	<p>時価法</p> <p>(1) 有形固定資産  定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法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。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産  定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(1) 貸倒引当金  一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金  賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金  従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。  退職給付見込額の期間帰属方法  退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。  数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法  確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。  退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金  時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金  将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成27年3月31日)	当事業年度末 (平成28年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。
未払金 4,979百万円	未払金 5,894百万円
未払費用 1,411	未払費用 1,151
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 607百万円	建物 641百万円
器具備品 3,052	器具備品 3,132
合計 3,659	合計 3,774

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 3,966百万円	受取配当金 7,081百万円
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損	3. 固定資産除却損
建物 円 - 百万	建物 1百万円
器具備品 15	器具備品 4
ソフトウェア 342	ソフトウェア 54
ア	ア
合計 357	合計 60

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26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	10,043百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2日

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

平成27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	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27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	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

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

平成28年5月13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	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

金融商品関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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、自ら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、スワップ取引などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

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

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

平成27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	411	411	-
(2)金銭の信託	56,824	56,824	-
(3)未収委託者報酬	12,679	12,679	-
(4)有価証券及び投資有価証券	27,398	27,398	-
その他有価証券	27,398	27,398	-
(5)関係会社株式	3,064	196,109	193,045
資産計	100,378	293,423	193,045
(6)未払金	11,602	11,602	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	32	32	-
未払手数料	4,883	4,883	-
その他未払金	6,684	6,684	-
(7)未払費用	10,221	10,221	-

(8)未払法人税等	1,961	1,961	-
負債計	23,784	23,784	-

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

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(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1,294百万円、関係会社株式7,085百万円）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90百万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	411	-	-	-
金銭の信託	56,824	-	-	-

未収委託者報酬	12,679	-	-	-
有価証券	17,100	-	-	-
合計	87,015	-	-	-

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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、スワップ取引などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28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	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-
(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-

(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-
(6)関係会社株式	3,064	180,880	177,816
資産計	112,127	289,944	177,816
(7)未払金	11,855	11,855	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,537	4,537	-
その他未払金	7,284	7,284	-
(8)未払費用	8,872	8,872	-
(9)未払法人税等	1,838	1,838	-
負債計	22,566	22,566	-

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

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

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 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1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）は、市場価



格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	208	-	-	-
金銭の信託	55,341	-	-	-
未収委託者報酬	14,131	-	-	-
未収運用受託報酬	7,309	-	-	-
有価証券	24,100	-	-	-
合計	101,091	-	-	-

有価証券関係

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1. 売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	196,109	193,045
合計	3,064	196,109	193,045

4. その他有価証券(平成27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	10,298	282	10,015
小計	10,298	282	10,015
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	17,100	17,100	-

小計	17,100	17,100	-
合計	27,398	17,382	10,015

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	800	790	-
合計	800	790	-

（注）投資信託の「売却額」及び「売却損の合計額」は償還によるものであります。

## 当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	180,880	177,816
合計	3,064	180,880	177,816

## 4．その他有価証券(平成28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	7,971	282	7,688
小計	7,971	282	7,688
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	24,100	24,100	-
小計	24,100	24,100	-
合計	32,071	24,382	7,688

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	135	-	95
合計	135	-	95

## 退職給付関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	15,680 百万円
会計方針の変更による累積的影響額	127
会計方針の変更を反映した期首残高	15,808
勤務費用	746
利息費用	213
数理計算上の差異の発生額	1,128
退職給付の支払額	724
その他	46
退職給付債務の期末残高	17,218
(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	14,786 百万円
期待運用収益	369
数理計算上の差異の発生額	975
事業主からの拠出額	558
退職給付の支払額	573
年金資産の期末残高	16,117
(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	14,474 百万円
年金資産	16,117
	1,643
非積立型制度の退職給付債務	2,743
未積立退職給付債務	1,100
未認識数理計算上の差異	1,861
未認識過去勤務費用	451
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
退職給付引当金	2,467
前払年金費用	2,776
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	746 百万円
利息費用	213
期待運用収益	369
数理計算上の差異の費用処理額	24
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	24
確定給付制度に係る退職給付費用	550

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	31%
株式	13%
受益証券等	29%
生保一般勘定	21%
その他	6%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	1.1%
退職一時金制度の割引率	0.8%
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、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	17,218 百万円
勤務費用	811
利息費用	181
数理計算上の差異の発生額	1,150
退職給付の支払額	654
その他	13
退職給付債務の期末残高	18,692

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	16,117 百万円
期待運用収益	402
数理計算上の差異の発生額	711
事業主からの拠出額	511
退職給付の支払額	555
年金資産の期末残高	15,764

(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	15,775 百万円
年金資産	15,764
	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
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、191百万円でした。	

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成27年3月31日)	当事業年度末 (平成28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
関係会社株式評価減	1,784	関係会社株式評価減	1,676
賞与引当金	1,504	賞与引当金	1,490
退職給付引当金	789	退職給付引当金	839
所有株式税務簿価通算差異	690	所有株式税務簿価通算差異	669
投資有価証券評価減	475	投資有価証券評価減	460
未払事業税	387	未払事業税	350
ゴルフ会員権評価減	296	ゴルフ会員権評価減	240
減価償却超過額	186	減価償却超過額	177
時効後支払損引当金	166	時効後支払損引当金	163
子会社株式売却損	153	子会社株式売却損	148
関連会社株式譲渡益	169	関連会社株式譲渡益	120
未払社会保険料	92	未払社会保険料	89
外国税支払損失引当金	567	外国税支払損失引当金	-
その他	214	その他	251
繰延税金資産小計	7,479	繰延税金資産小計	6,678
評価性引当額	1,500	評価性引当額	1,453
繰延税金資産合計	5,979	繰延税金資産合計	5,224
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	3,243	その他有価証券評価差額金	2,403
前払年金費用	888	前払年金費用	861
繰延税金負債合計	4,132	繰延税金負債合計	3,264
繰延税金負債の純額	1,847	繰延税金資産の純額	1,959
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	36.0%	法定実効税率	33.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%
住民税等均等割	0.0%	住民税等均等割	0.0%
タックスヘイブン税制	1.2%	タックスヘイブン税制	0.8%
外国税額控除	0.2%	外国税額控除	0.2%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	-%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.8%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%
評価性引当額	7.3%	評価性引当額	0.0%
その他	2.8%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%
3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正		3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正	
「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の36%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33%に、平成28年4月1日に開始する前事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32%となります。		「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32%から31%となります。	
この税率変更により、繰延税金資産の純額は73百万円減少し、法人税等調整額が479百万円、その他有価証券評価差額金が405百万円、それぞれ増加しております。		この税率変更による財務諸表に与える影響は軽微であります。	

## 企業結合等関係

## 1. 会社分割について

当社は、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社(以下「NFR&T」)との、平成27年2月18日付吸収分割契約に基づき、NFR&Tの機関投資家顧問事業及びリテール運用関連事業を会社分割により承継いたしました。

## (1) 企業結合の概要

### 会社分割の目的

本件会社分割により、当社は、NFR&Tが行ってきた投資信託の運用・管理に係る事務および機関投資家向けの顧問関連事業をNFR&Tから承継し、野村グループのアセット・マネジメント部門内における営業、運用、管理業務を集約します。ファンドおよび運用会社の分析・評価業務は、NFR&Tが集約して行います。これらの再編により、運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供が可能となります。また、再編後の当社及びNFR&T両社は、それぞれの専門性を発揮することにより、品質の高い運用商品の提供を行い、投資家の多様なニーズに応えられると判断いたしました。

### 会社分割日程

吸収分割契約締結日	平成27年 2月 18日
機関投資家顧問事業の吸収分割効力発生日	平成27年 7月 1日
リテール運用関連事業の吸収分割効力発生日	平成27年 10月 1日

### 会社分割の方法

当社を分割承継会社とし、NFR&Tを分割会社とする無対価による吸収分割方式であります。

## (2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

## 2. 吸収合併について

当社は、野村プライベート・エクイティ・キャピタル株式会社(以下「NPEC」)との、平成27年2月18日付吸収合併契約に基づき、NPECを吸収合併いたしました。

## (1) 企業結合の概要

### 吸収合併の目的

運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供を可能とするためであります。

### 吸収合併日程

吸収合併契約締結日	平成27年 2月 18日
吸収合併効力発生日	平成27年 12月 1日

### 吸収合併の方法

当社を吸収合併存続会社とし、NPECを吸収合併消滅会社とする無対価による吸収合併方式であります。

## (2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

### セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)



関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接 21.4%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	3,990	未払費用	547
------	-------------	---------	-----------------	---------	-----------------	------------	-----------------------	-------	------	-----

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の 子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,273	未払手数料	4,182
親会社の 子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	1,976	未払費用	815

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

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱(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

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

(百万円)

㈱野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

純資産合計	348,841
売上高	358,952
税引前当期純利益	51,509
当期純利益	34,167

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接20.8%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	5,058	未払費用	279

### (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,084	未払手数料	3,865
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	2,412	未払費用	669

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

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)	
(株)野村総合研究所	
流動資産合計	239,155
固定資産合計	324,634
流動負債合計	122,933
固定負債合計	55,456
純資産合計	385,400
売上高	352,003
税引前当期純利益	56,508
当期純利益	40,179

### 1株当たり情報

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	18,829円58銭	1株当たり純資産額	20,377円23銭
1株当たり当期純利益	3,876円72銭	1株当たり当期純利益	4,977円07銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	19,967百万円	損益計算書上の当期純利益	25,635百万円
普通株式に係る当期純利益	19,967百万円	普通株式に係る当期純利益	25,635百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

### 中間財務諸表

#### 中間貸借対照表

		平成28年9月30日現在
--	--	--------------

区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		231
金銭の信託		54,692
有価証券		4,400
未収委託者報酬		13,740
未収運用受託報酬		7,312
繰延税金資産		907
その他		612
貸倒引当金		10
流動資産計		81,887
固定資産		
有形固定資産	1	1,065
無形固定資産		7,506
ソフトウェア		7,505
その他		0
投資その他の資産		21,276
投資有価証券		7,976
関係会社株式		10,341
前払年金費用		2,689
その他		269
固定資産計		29,848
資産合計		111,736

		平成28年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
関係会社短期借入金		7,500
未払収益分配金		1
未払償還金		31
未払手数料		4,386
その他未払金	2	1,424
未払費用		7,900
未払法人税等		759
賞与引当金		2,268
その他		155
流動負債計		24,428
固定負債		
退職給付引当金		2,821
時効後支払損引当金		538
繰延税金負債		1,073
固定負債計		4,432
負債合計		28,860
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		78,415
資本剰余金		17,180
資本準備金		13,729
その他資本剰余金		11,729
利益剰余金		2,000
利益準備金		47,505
その他利益剰余金		685
別途積立金		46,820
繰越利益剰余金		24,606
繰越利益剰余金		22,213
評価・換算差額等		4,459
その他有価証券評価差額金		4,459
純資産合計		82,875

負債・純資産合計		111,736
----------	--	---------

## 中間損益計算書

区分	注記 番号	自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日
		金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		46,569
運用受託報酬		14,052
その他営業収益		112
営業収益計		60,735
営業費用		
支払手数料		19,457
調査費		13,191
その他営業費用		3,046
営業費用計		35,695
一般管理費	1	12,666
営業利益		12,373
営業外収益	2	6,027
営業外費用	3	26
経常利益		18,374
特別利益	4	76
税引前中間純利益		18,451
法人税、住民税及び事業税		2,145
法人税等調整額		2,524
中間純利益		13,781

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計	
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			利益 剰余金 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当中間期変動額									
剰余金の配当							34,973	34,973	34,973
中間純利益							13,781	13,781	13,781
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額 (純額)									
当中間期変動額合 計	-	-	-	-	-	-	21,191	21,191	21,191
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	22,213	47,505	78,415

(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	5,349	5,349	104,956
当中間期変動額			
剰余金の配当			34,973
中間純利益			13,781
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	889	889	889
当中間期変動額合計	889	889	22,081
当中間期末残高	4,459	4,459	82,875

## [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...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
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、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに平成28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、定額法によっております。  (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等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

	<p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>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中間会計期間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。</p> <p>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。</p> <p>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
5 消費税等の会計処理	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。

## [会計方針の変更]

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当中間会計期間において、中間財務諸表に与える影響額は軽微であります。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

平成28年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,889百万円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

## 中間損益計算書関係

自 平成28年4月1日	至 平成28年9月30日
-------------	--------------

1	減価償却実施額		
	有形固定資産	115百万円	
	無形固定資産	1,211百万円	
2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	4,882百万円	
	金銭信託運用益	938百万円	
3	営業外費用のうち主要なもの		
	支払利息	11百万円	
	時効後支払損引当金繰入	14百万円	
4	特別利益の内訳		
	投資有価証券等売却益	5百万円	
	関係会社清算益	41百万円	
	株式報酬受入益	30百万円	

## 中間株主資本等変動計算書関係

自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日				
1	発行済株式に関する事項			
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 5,150,693株
2	配当に関する事項			
	配当金支払額			
	平成28年5月13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			
	(1) 配当金の総額		34,973百万円	
	(2) 1株当たり配当額		6,790円	
	(3) 基準日		平成28年3月31日	
	(4) 効力発生日		平成28年6月24日	

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、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)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	231	231	-
(2)金銭の信託	54,692	54,692	-
(3)未収委託者報酬	13,740	13,740	-
(4)未収運用受託報酬	7,312	7,312	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,173	11,173	-
(6)関係会社株式	3,064	165,608	162,544



資産計	90,215	252,759	162,544
(7)未払金	5,844	5,844	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,386	4,386	-
その他未払金	1,424	1,424	-
(8)未払費用	7,900	7,900	-
(9)未払法人税等	759	759	-
負債計	22,004	22,044	-

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

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

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 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（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,202百万円、関係会社株式7,277百万円）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、「(5) 有価証券及び投資有価証券」「(6) 関係会社株式」には含めておりません。

## 有価証券関係

当中間会計期間末（平成28年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(平成28年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(平成28年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	165,608	162,544
合計	3,064	165,608	162,544

## 3．その他有価証券(平成28年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの 株式	6,773	282	6,490
小計	6,773	282	6,490
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの 譲渡性預金	4,400	4,400	-
小計	4,400	4,400	-
合計	11,173	4,682	6,490

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30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、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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、中間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。

## 1 株当たり情報

		自 平成28年 4月 1日
		至 平成28年 9月 30日
1 株当たり純資産額		16,090円12銭
1 株当たり中間純利益		2,675円66銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
	中間純利益	13,781百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	13,781百万円
	期中平均株式数	5,150千株

## [ 重要な後発事象 ]

平成28年10月27日開催の臨時株主総会において、親会社である野村ホールディングス株式会社に対して、保有する株式会社野村総合研究所、株式会社ジャフコ及び朝日火災海上保険株式会社の全株式を剰余金の配当として現物配当（適格現物分配）することを決議し、同日に配当を実施いたしました。

なお、平成28年9月30日現在における有価証券の保有目的は、株式会社野村総合研究所については関連会社株式、株式会社ジャフコ及び朝日火災海上保険株式会社についてはその他有価証券であります。

## 1. 配当財産の種類及び帳簿価額

株式会社野村総合研究所	普通株式	47,725,700株	3,064百万円
株式会社ジャフコ	普通株式	2,304,000株	282百万円
朝日火災海上保険株式会社	普通株式	124,300株	87百万円

## 2. 剰余金の配当効力発生日

平成28年10月27日（木）

## 3. 配当原資

利益剰余金

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の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。以下において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

\* 平成28年12月末現在

#### (2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村證券株式会社 第四証券株式会社	10,000百万円 600百万円	「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。

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んでいます。
------------	-----------	--------------------

\* 平成28年12月末現在

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託者

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

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

### (1) 受託者

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。
- (2) 目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。
- (3) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。
- (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

平成28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成29年2月10日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 岩部 俊夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）の平成27年12月19日から平成28年12月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）の平成28年12月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。



## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月21日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

#### 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監

査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の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。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成28年10月27日付で、親会社である野村ホールディングス株式会社に対して、保有する株式を現物配当している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 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. 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。