

<使用開始日>
2014年11月28日

野村インデックスファンド・国内債券

愛称：Funds-i 国内債券

追加型投信 国内 債券 インデックス型

【投資信託説明書（交付目論見書）】



| 商品分類 | | | | 属性区分 | | | | |
|---------|--------|-------------------|---------|------------------------------|------|--------|----------------|-----------------------|
| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) | 補足分類 | 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 対象インデックス |
| 追加型 | 国内 | 債券 | インデックス型 | その他資産 (投資信託証券 (債券 一般)) | 年1回 | 日本 | ファミリー ファンド* | その他 (NOMURA-BPI総合) |

上記、商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧頂けます。

<委託会社> 野村アセットマネジメント株式会社 [ファンドの運用の指図を行なう者]

■金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第373号 ■設立年月日:昭和34年(1959年)12月1日

■資本金:171億円(平成26年10月末現在) ■運用する投資信託財産の合計純資産総額:22兆5974億円(平成26年9月30日現在)

<受託会社> 野村信託銀行株式会社 [ファンドの財産の保管および管理を行なう者]

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。

この目論見書により行なう野村インデックスファンド・国内債券の募集については、発行者である野村アセットマネジメント株式会社(委託会社)は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を平成26年11月27日に関東財務局長に提出しており、平成26年11月28日にその効力が生じております。

- ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下「請求目論見書」といいます。)は野村アセットマネジメント株式会社のホームページに掲載しています。なお、ファンドの投資信託約款の全文は請求目論見書に記載しています。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 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ます。
- 請求目論見書については販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの販売会社、ファンドの基準価額等については、下記の照会先までお問い合わせください。

照会先

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
<受付時間>営業日の午前9時~午後5時



★ホームページ★

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



★携帯サイト★ (基準価額等)

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



ファンドの目的・特色

ファンドの目的

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

ファンドの特色

■主要投資対象

わが国の公社債を実質的な主要投資対象[※]とします。

※「実質的な主要投資対象」とは、「国内債券NOMURA-BPI総合 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。

■投資方針

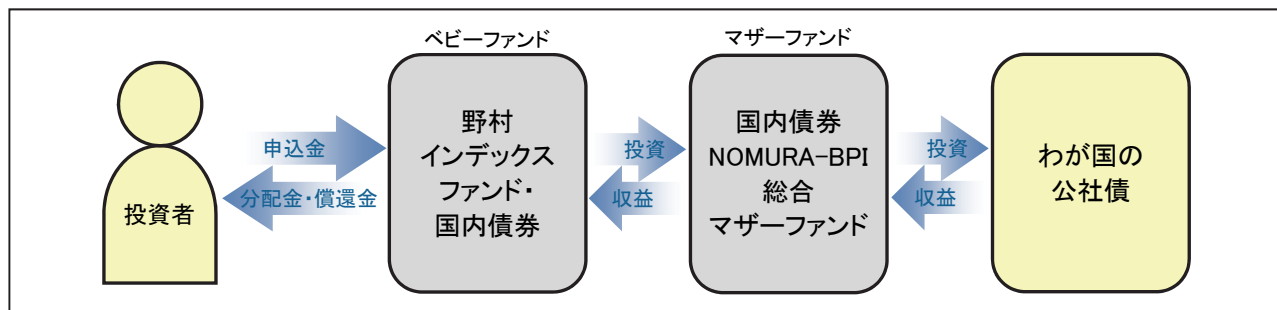
●わが国の公社債を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

■指数の著作権等について■

NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●ファンドはマザーファンドを通じて投資するファミリーファンド方式で運用します。



■主な投資制限

| | |
|-------------|--|
| 株式への投資割合 | 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したもの等に関し、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。 |
| 外貨建資産への投資割合 | 外貨建資産への投資は行いません。 |
| デリバティブの利用 | デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。 |

■分配の方針

原則、毎年9月6日(休業日の場合は翌営業日)に分配を行いません。

分配金額は、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して委託会社が決定します。



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

投資リスク

基準価額の変動要因

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

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

債券価格変動 リスク

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

* 基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- ◆ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- ファンドの基準価額と対象インデックスは、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。
投資者の個別元本(追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本)の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。
分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

リスクの管理体制

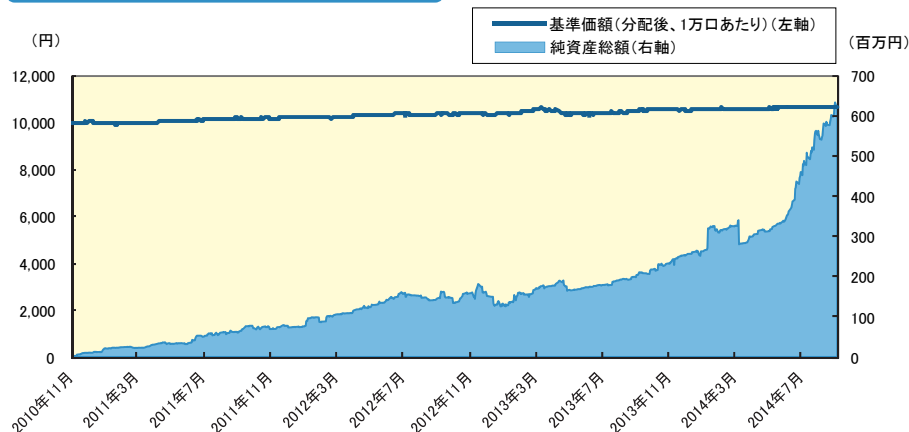
委託会社では、ファンドのパフォーマンスの考査および運用リスクの管理をリスク管理関連の委員会を設けて行なっております。

- **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。

運用実績 (2014年9月30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)

| | |
|---------|-----|
| 2014年9月 | 0 円 |
| 2013年9月 | 0 円 |
| 2012年9月 | 0 円 |
| 2011年9月 | 0 円 |
| -- | -- |
| 設定来累計 | 0 円 |

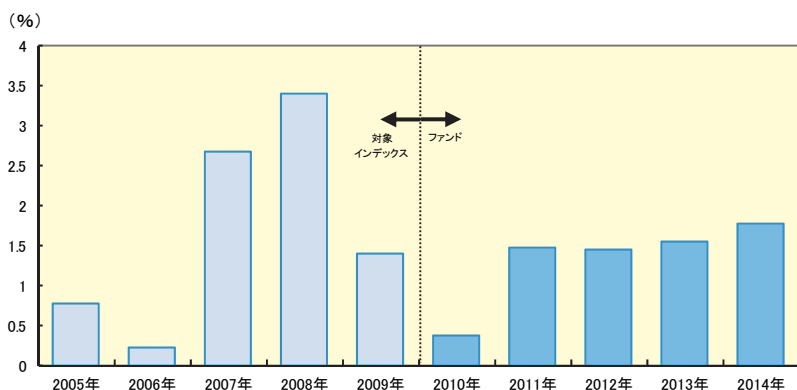
主要な資産の状況

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117回 | 国債証券 | 1.2 |
| 2 | 国庫債券 利付(5年)第116回 | 国債証券 | 1.2 |
| 3 | 国庫債券 利付(10年)第334回 | 国債証券 | 1.1 |
| 4 | 国庫債券 利付(5年)第105回 | 国債証券 | 1.0 |
| 5 | 国庫債券 利付(10年)第327回 | 国債証券 | 0.9 |
| 6 | 国庫債券 利付(5年)第106回 | 国債証券 | 0.9 |
| 7 | 国庫債券 利付(10年)第328回 | 国債証券 | 0.9 |
| 8 | 国庫債券 利付(10年)第332回 | 国債証券 | 0.9 |
| 9 | 国庫債券 利付(10年)第333回 | 国債証券 | 0.9 |
| 10 | 国庫債券 利付(10年)第329回 | 国債証券 | 0.9 |

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2005年から2009年は対象インデックスの年間収益率。
- ・2010年は設定日(2010年11月26日)から年末までのファンドの収益率。
- ・2014年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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

手続・手数料等

お申込みメモ

| | |
|-------------------|---|
| 購 入 単 位 | 1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位 |
| 購 入 価 額 | 購入申込日の基準価額 (ファンドの基準価額は1万口あたりで表示しています。) |
| 購 入 代 金 | 販売会社の定める期日までにお支払いください。 |
| 換 金 単 位 | 1万口単位、1口単位または1円単位 |
| 換 金 価 額 | 換金申込日の基準価額 |
| 換 金 代 金 | 原則、換金申込日から起算して5営業日目から、お申込みの販売会社でお支払いします。 |
| 申 込 締 切 時 間 | 午後3時まで、販売会社が受けた分を当日のお申込み分とします。 |
| 購 入 の 申 込 期 間 | 平成26年11月28日から平成27年11月26日まで * 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。 |
| 換 金 制 限 | 大口換金には制限を設ける場合があります。 |
| 購入・換金申込受付の中止及び取消し | 金融商品取引所等における取引の停止等、その他やむを得ない事情があるときは、購入、換金の各お申込みの受付を中止すること、および既に受けた購入、換金の各お申込みの受付を取消すことがあります。 |
| 信 託 期 間 | 無期限 (平成22年11月26日設定) |
| 繰 上 償 還 | 受益権口数が30億口を下回った場合等は、償還となる場合があります。 |
| 決 算 日 | 原則、毎年9月6日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収 益 分 配 | 年1回の決算時に分配を行いません。(再投資可能) |
| 信 託 金 の 限 度 額 | 1兆円 |
| 公 告 | 原則、 http://www.nomura-am.co.jp/ に電子公告を掲載します。 |
| 運 用 報 告 書 | ファンドの決算時および償還時に運用報告書(交付運用報告書を作成している場合は交付運用報告書)を作成し、知れている受益者に交付します。 |
| 課 税 関 係 | 課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 益金不算入制度、配当控除の適用はありません。 |

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

ファンドの費用・税金

■ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

| | |
|---------|--|
| 購入時手数料 | 購入価額に <u>1.08%(税抜1.0%)以内</u> で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額 (詳しくは販売会社にお問い合わせ、もしくは購入時手数料を記載した書面をご覧ください。) |
| 信託財産留保額 | ありません |

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用 (信託報酬)

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。
 ファンドの信託報酬は、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。
 信託報酬率の配分は下記の通りとします。

| 信託報酬率 | | 年0.432%(税抜年0.40%) |
|------------|------|-------------------|
| 配分 (税抜) | 委託会社 | 年0.185% |
| | 販売会社 | 年0.185% |
| | 受託会社 | 年0.03% |

その他の費用・ 手数料

その他の費用・手数料として、以下の費用等がファンドから支払われます。これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。
 ・組入価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料
 ・ファンドに関する租税、監査費用 等

■税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

| 時期 | 項目 | 税金 |
|------------------|----------------------|--|
| 分配時 | 所得税、復興特別所得税 及び地方税 | 配当所得として課税 普通分配金に対して20.315% |
| 換金(解約)時及び 償還時 | 所得税、復興特別所得税 及び地方税 | 譲渡所得として課税 換金(解約)時及び償還時の差益(譲渡益)に対して20.315% |

- * 上記は平成26年9月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
- * 少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」をご利用の場合
 少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円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5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、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。
- * 法人の場合は上記とは異なります。
- * 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。

追加的記載事項

- ファンドの名称について

「野村インデックスファンド・国内債券」を「野村Funds-i 国内債券」という場合があります。



野村インデックスファンド・国内債券

愛称：Funds-i 国内債券

追加型投信 国内 債券 インデックス型

【投資信託説明書（請求目論見書）】

（2014年11月28日）

野村アセットマネジメント

この目論見書により行なう野村インデックスファンド・国内債券の募集については、発行者である野村アセットマネジメント株式会社（委託会社）は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成26年11月27日に関東財務局長に提出しており、平成26年11月28日にその効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書であり、投資家の請求により交付される請求目論見書です。

—目次—

| | |
|---------------------|-----|
| 表紙 | 1 |
| 第一部【証券情報】 | 2 |
| 第二部【ファンド情報】 | 5 |
| 第1【ファンドの状況】 | 5 |
| 1【ファンドの性格】 | 5 |
| 2【投資方針】 | 10 |
| 3【投資リスク】 | 17 |
| 4【手数料等及び税金】 | 19 |
| 5【運用状況】 | 22 |
| 第2【管理及び運営】 | 28 |
| 1【申込(販売)手続等】 | 28 |
| 2【換金(解約)手続等】 | 28 |
| 3【資産管理等の概要】 | 29 |
| 4【受益者の権利等】 | 33 |
| 第3【ファンドの経理状況】 | 35 |
| 1【財務諸表】 | 37 |
| 2【ファンドの現況】 | 71 |
| 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】 | 71 |
| 第三部【委託会社等の情報】 | 73 |
| 第1【委託会社等の概況】 | 73 |
| 約款 | 110 |

【表紙】

| | |
|--|--|
| 【提出日】 | 平成 26 年 11 月 27 日提出 |
| 【発行者名】 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | CEO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 |
| 【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】 | 野村インデックスファンド・国内債券 |
| 【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 26 年 11 月 28 日から平成 27 年 11 月 26 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】

野村インデックスファンド・国内債券
(以下「ファンド」といいます。)

ファンドの愛称を「Funds-i 国内債券」とします。なお、「野村 Funds-i 国内債券」と称する場合があります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当り1円です。

■信用格付■

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

2兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込日の基準価額[※]とします。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時~午後5時

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

(5)【申込手数料】

①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。

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

(6)【申込単位】

1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位

(7)【申込期間】

平成26年11月28日から平成27年11月26日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時~午後5時

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

(9)【払込期日】

販売会社の定める期日までに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、上記の期日以前にお申込代金をお支払いいただく場合があります。

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

(10)【払込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時~午後5時

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

①申込みの方法

受益権の取得申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

※販売会社によっては、購入、換金の各お申込みの方法ならびに単位および分配金のお取扱い等が、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取得申込みの受付けの中止、既に受付けた取得申込みの受付けの取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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、その他やむを得ない事情等があるときは、取得申込みの受付けを中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付けを取り消す場合があります。

③振替受益権について

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

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

(参考)

◆投資信託振替制度（「振替制度」と称する場合があります。）とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

■信託金の限度額■

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

<商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に網掛け表示しております。

（野村インデックスファンド・国内債券）

《商品分類表》

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

《属性区分表》

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 対象インデックス |
|---------|------|--------|-----------|----------|
| 株式 | 年1回 | グローバル | | |
| 一般 | 年2回 | | | |
| 大型株 | 年4回 | 日本 | | 日経 225 |
| 中小型株 | 年6回 | 北米 | ファミリーファンド | |
| 債券 | (隔月) | 欧州 | | |
| 一般 | 年12回 | アジア | | TOPIX |
| 公債 | (毎月) | | | |
| 社債 | | | | |
| その他債券 | | | | |
| クレジット属性 | | | | |

| | | | | |
|---|------------------|---|--------------|---------------------------|
| () 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | 日々 その他 () | オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング | ファンド・オブ・ファンズ | その他 (NOMURA-BPI 総合) |
|---|------------------|---|--------------|---------------------------|

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

《一般社団法人投資信託協会インターネットホームページアドレス》 <http://www.toushin.or.jp/>

◆一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（平成22年7月1日現在）

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

- (1) インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

[投資形態による属性区分]

- (1) ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるもの

を除く。)を投資対象として投資するものをいう。

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

[為替ヘッジによる属性区分]

(1) 為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2) 為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1) 日経 225

(2) TOPIX

(3) その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

(1) ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(2) 条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

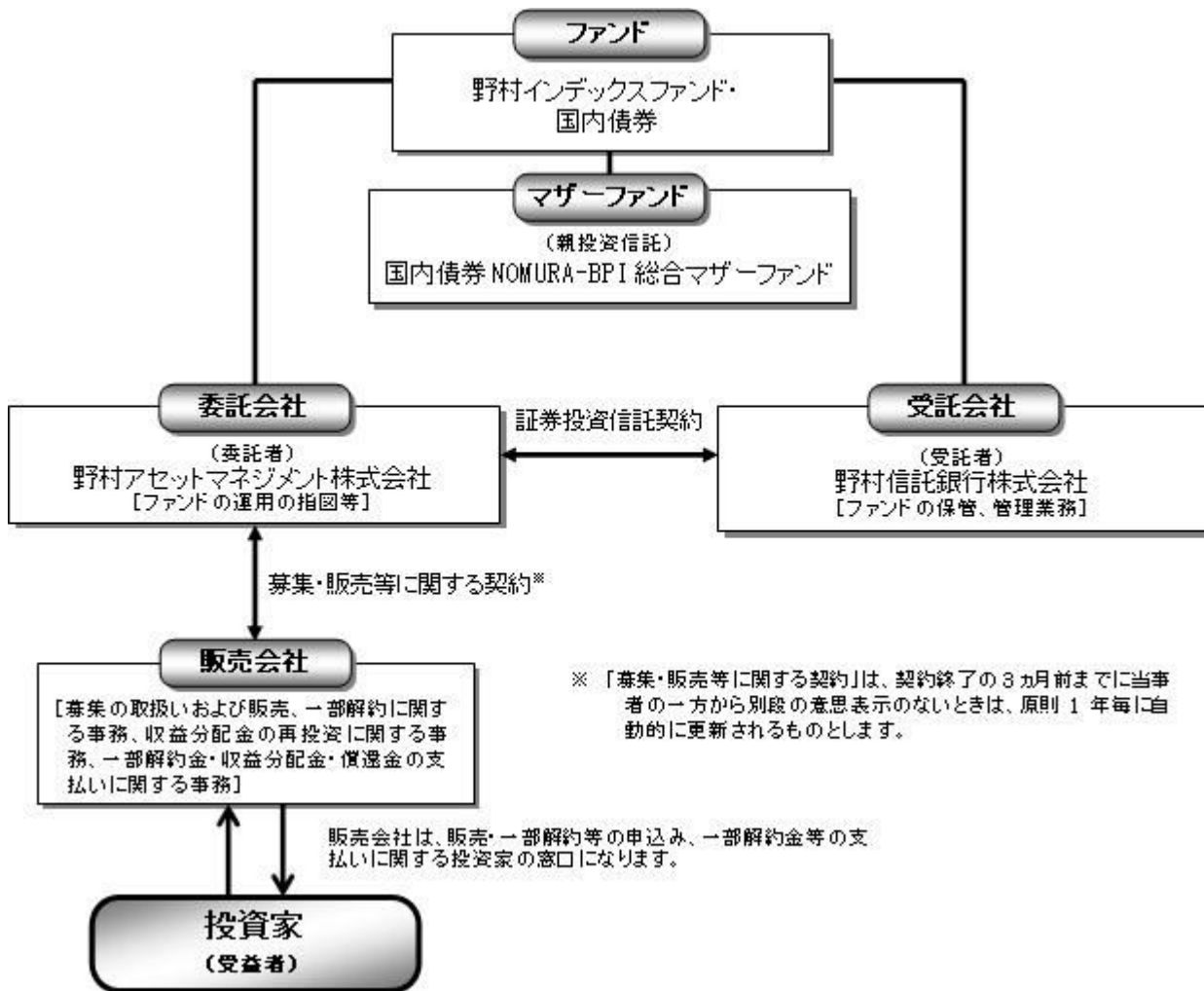
(3) ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4) その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

(2) 【ファンドの沿革】

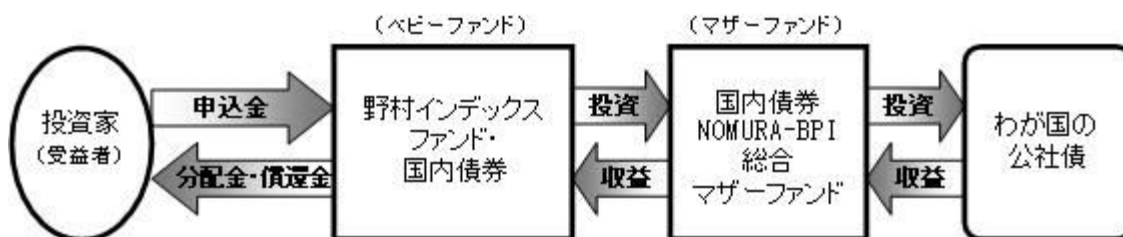
平成 22 年 11 月 26 日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

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



※マザーファンドの運用の方針等については、「第1ファンドの状況 2 投資方針(参考)マザーファンドの概要」をご参照ください。

※ファンドは、マザーファンドのほかに、公社債等に直接投資する場合があります。

■委託会社の概況(平成26年10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】

NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。

■NOMURA-BPI 総合とは■

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

■指数の著作権等について■

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

ファンドは、わが国の公社債を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、親投資信託である「国内債券 NOMURA-BPI 総合 マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

なお、公社債等に直接投資する場合があります。

なお、デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定します。

①投資の対象とする資産の種類(約款第 15 条)

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

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、下記「(5)投資制限 ④ および⑤」に定めるものに限ります。）に係る権利
 - ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲(約款第 16 条第 1 項)

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

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を含みます。）
5. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
6. 投資法人債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
7. 転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債*の新株予約権に限ります。）の行使により取得した株券
※転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。
8. コマーシャル・ペーパー
9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
11. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
12. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
13. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
14. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）

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

③金融商品の指図範囲(約款第 16 条第 2 項)

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

1. 預金

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

④その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券 NOMURA-BPI 総合 マザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

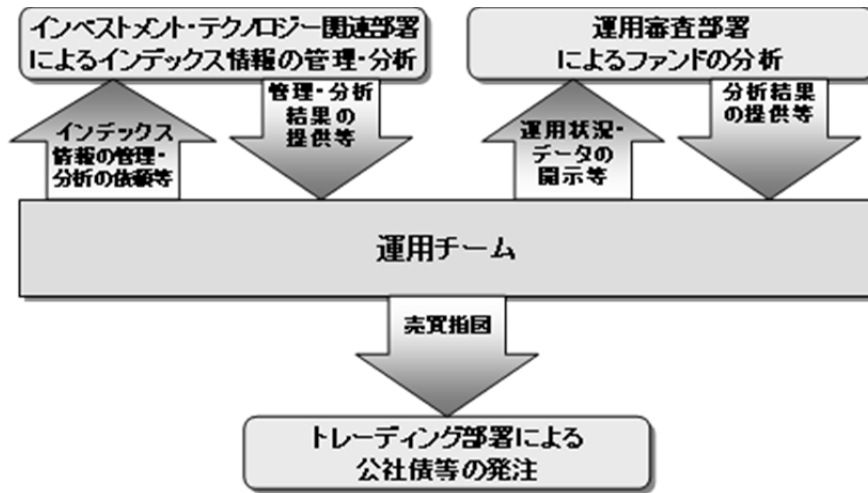
- ① 主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果を目指します。
- ② 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資は行ないません。
- ② 外貨建資産への投資は行ないません。
- ③ 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。
- ④ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

(3) 【運用体制】

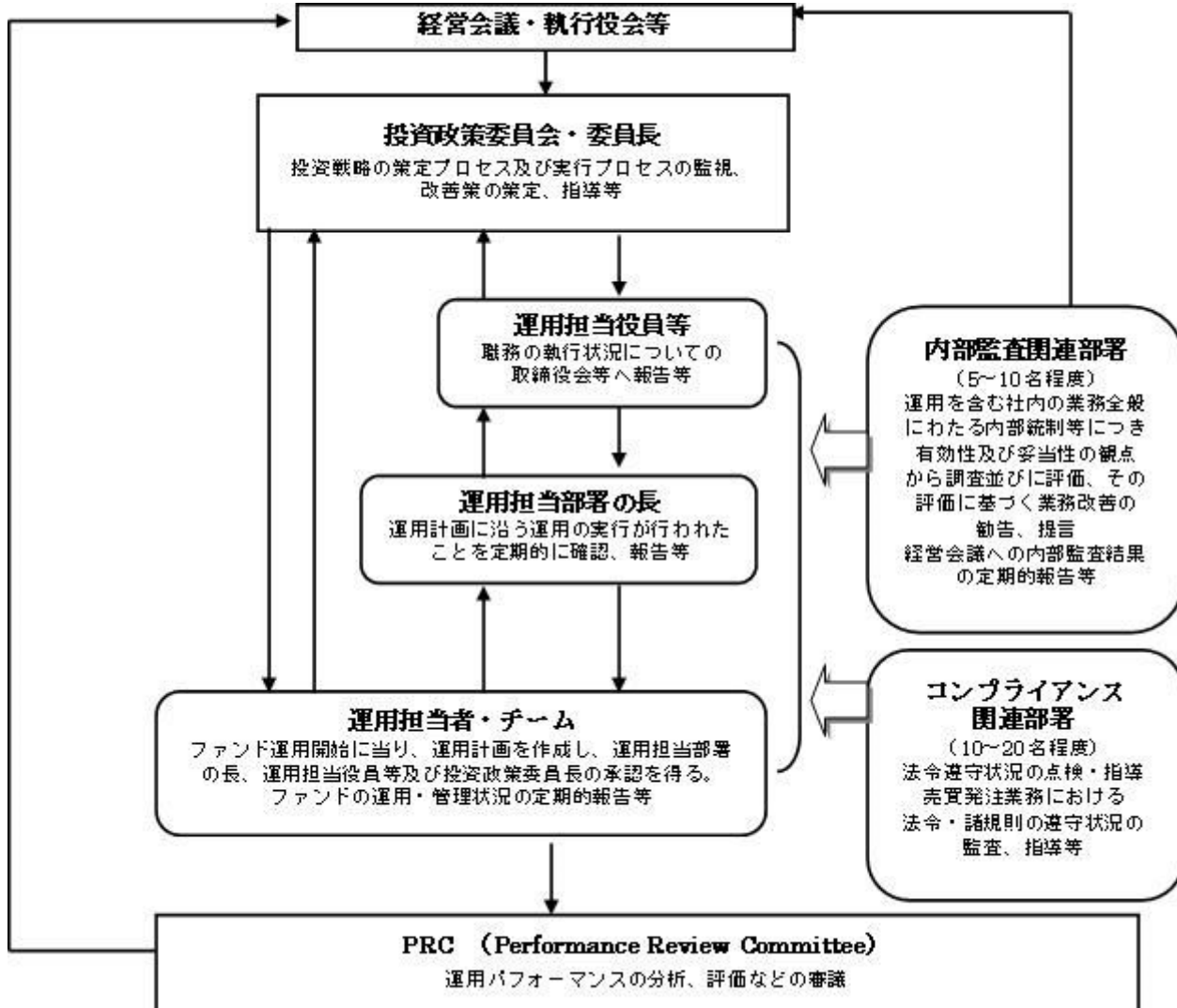
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※ 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。

- ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。
- ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

※利子・配当等収益とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

※毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

*委託会社の判断により分配を行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9月6日**（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

◆分配金のお支払い

お客様と販売会社とのご契約によって、以下の通りとなります。

＜分配金をお支払いする契約の場合＞

決算日から起算して5営業日までに支払いを開始いたします。*¹

＜分配金を再投資する契約の場合＞

分配金は税引き後無手数料で再投資されます。*²

※¹ 分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始いたします。

※2 再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

①株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

②外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への投資は行ないません。

③デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

④先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

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

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

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

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

全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5% を上回らない範囲内とします。

⑤スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第 22 条)

- (i) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- (ii) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (iii) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (iv) 上記(iii)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (v) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が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。
- (vi) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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。

⑥同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。

⑦同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

⑧投資する株式の範囲(約款第 19 条)

- (i) 委託者が投資することを指図する株式は、わが国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
- (ii) 上記(i)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

⑨有価証券の貸付の指図および範囲(約款第 24 条)

- (i) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の 50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の 50%を超えないものとします。
- (ii) 上記(i)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する

契約の一部の解約を指図するものとします。

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

⑩ 公社債の借入れ(約款第 25 条)

(i) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

(ii) 上記(i)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(iii) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ii)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑪ 資金の借入れ(約款第 31 条)

(i) 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

(ii) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

(iii) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(iv) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑫ 投資信託証券への投資割合

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への投資は行ないません。

3 【投資リスク】

《基準価額の変動要因》

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

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

[債券価格変動リスク]

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

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

《その他の留意点》

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- ファンドの基準価額と対象インデックスは、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

《委託会社におけるリスクマネジメント体制》

リスク管理関連の委員会

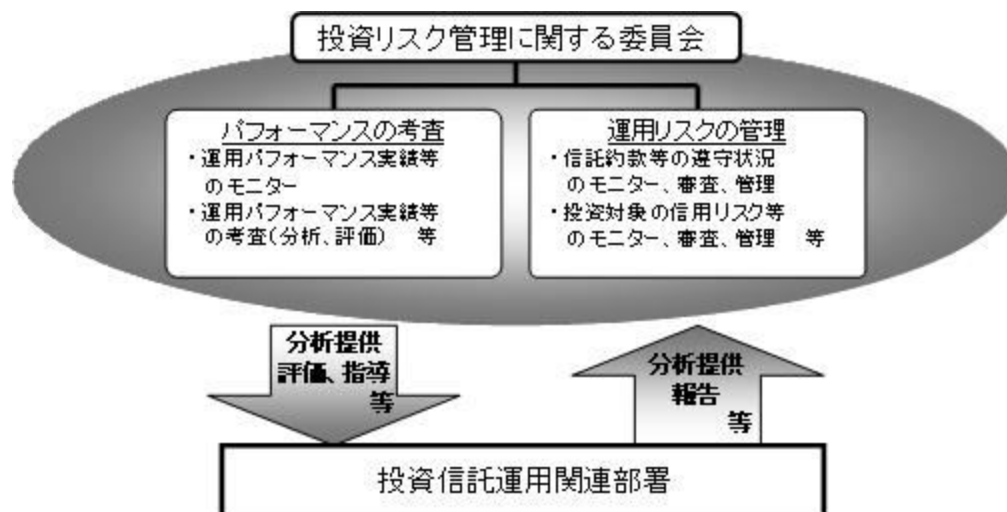
◆パフォーマンスの考査

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

◆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。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

①取得申込日の基準価額に、1.08% (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。

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年 0.432% (税抜年 0.40%) の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り (税抜) とします。

| <委託会社> | <販売会社> | <受託会社> |
|----------|----------|---------|
| 年 0.185% | 年 0.185% | 年 0.03% |

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

(4) 【その他の手数料等】

①ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。

②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負

担とし、ファンドから支払われます。

③ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用はファンドから支払われます。

④ファンドに係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときにファンドから支払われます。

※これらの費用等の中には、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。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

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

※公募株式投資信託は税法上、平成 26 年 1 月 1 日以降の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、年間 100 万円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 5 年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。ご利用になれるのは、満 20 歳以上の方で、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

なお、益金不算入制度は適用されません。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、販売会社の買取りによるご換金の場合は、税金の取扱いが異なる場合があります。買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

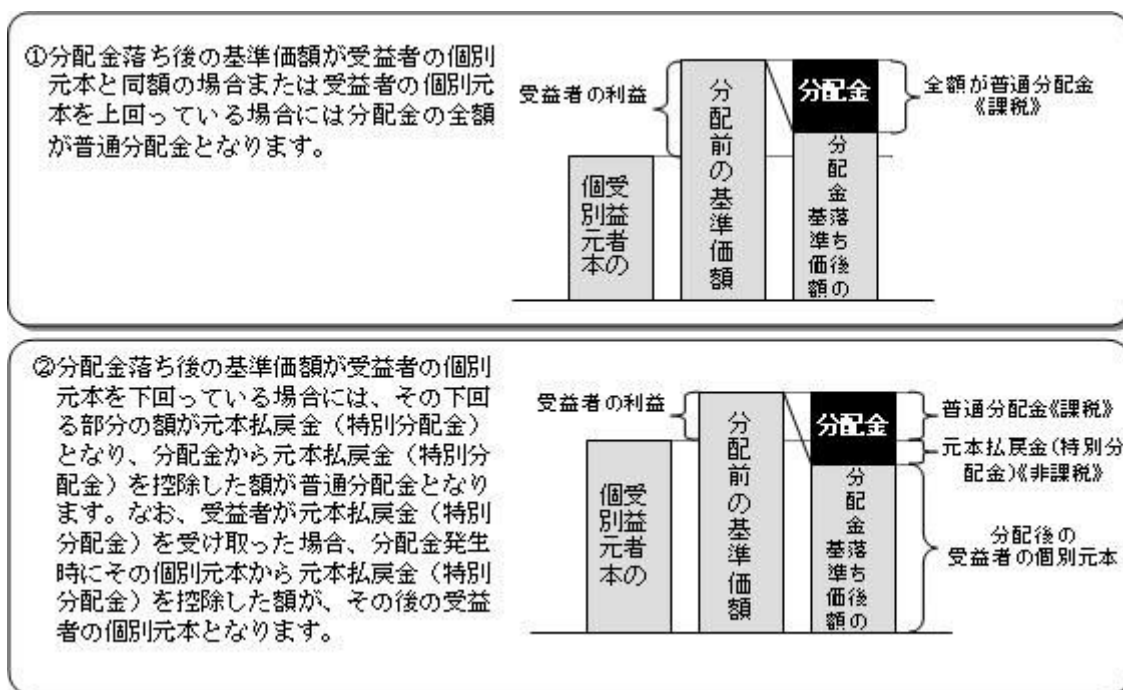
■個別元本について■

◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■分配金の課税について■

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



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

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

5 【運用状況】

以下は平成 26 年 9 月 30 日現在の運用状況であります。

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

(1) 【投資状況】

野村インデックスファンド・国内債券

| 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 | 616,137,837 | 99.99 |
| 現金・預金・その他資産 (負債控除後) | — | 54,312 | 0.00 |
| 合計 (純資産総額) | | 616,192,149 | 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 | 283,244,089,600 | 79.28 |
| 地方債証券 | 日本 | 22,095,969,779 | 6.18 |
| 特殊債券 | 日本 | 30,848,430,683 | 8.63 |
| 社債券 | 日本 | 20,061,470,820 | 5.61 |
| 現金・預金・その他資産 (負債控除後) | — | 997,920,729 | 0.27 |
| 合計 (純資産総額) | | 357,247,881,611 | 100.00 |

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

野村インデックスファンド・国内債券

| 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 | 502,272,632 | 1.2246 | 615,083,066 | 1.2267 | 616,137,837 | 99.99 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|-----------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 99.99 |
| 合計 | 99.99 |

(参考) 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資比率 (%) |
|----|------|------|--------------------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|--------|------------|----------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年) 第117回 | 4,300,000,000 | 100.14 | 4,306,132,000 | 100.24 | 4,310,449,000 | 0.2 | 2019/3/20 | 1.20 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年) 第116回 | 4,200,000,000 | 100.12 | 4,205,235,000 | 100.29 | 4,212,306,000 | 0.2 | 2018/12/20 | 1.17 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 | 4,100,000,000 | 100.65 | 4,127,000,000 | 100.97 | 4,139,893,000 | 0.6 | 2024/6/20 | 1.15 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------|---------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-----|------------|------|
| | | | (10年)第3 34回 | | | | | | | | |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第10 5回 | 3,500,000,000 | 100.28 | 3,509,836,000 | 100.31 | 3,510,885,000 | 0.2 | 2017/6/20 | 0.98 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 27回 | 3,300,000,000 | 102.73 | 3,390,111,000 | 103.38 | 3,411,771,000 | 0.8 | 2022/12/20 | 0.95 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第10 6回 | 3,400,000,000 | 100.28 | 3,409,658,000 | 100.32 | 3,411,050,000 | 0.2 | 2017/9/20 | 0.95 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 28回 | 3,200,000,000 | 100.39 | 3,212,656,000 | 101.67 | 3,253,696,000 | 0.6 | 2023/3/20 | 0.91 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 32回 | 3,200,000,000 | 99.93 | 3,197,784,000 | 101.28 | 3,241,024,000 | 0.6 | 2023/12/20 | 0.90 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 33回 | 3,200,000,000 | 99.91 | 3,197,255,000 | 101.13 | 3,236,192,000 | 0.6 | 2024/3/20 | 0.90 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 29回 | 3,100,000,000 | 102.09 | 3,165,026,000 | 103.28 | 3,201,711,000 | 0.8 | 2023/6/20 | 0.89 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 06回 | 3,000,000,000 | 106.72 | 3,201,780,000 | 106.59 | 3,197,970,000 | 1.4 | 2020/3/20 | 0.89 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第11 8回 | 3,000,000,000 | 100.18 | 3,005,469,000 | 100.21 | 3,006,300,000 | 0.2 | 2019/6/20 | 0.84 |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 25回 | 2,900,000,000 | 102.31 | 2,967,048,000 | 103.44 | 2,999,963,000 | 0.8 | 2022/9/20 | 0.83 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 05回 | 2,800,000,000 | 106.04 | 2,969,332,000 | 105.84 | 2,963,576,000 | 1.3 | 2019/12/20 | 0.82 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 12回 | 2,750,000,000 | 105.81 | 2,909,901,500 | 106.04 | 2,916,155,000 | 1.2 | 2020/12/20 | 0.81 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第10 2回 | 2,900,000,000 | 100.54 | 2,915,718,000 | 100.48 | 2,914,094,000 | 0.3 | 2016/12/20 | 0.81 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第11 5回 | 2,800,000,000 | 100.20 | 2,805,648,000 | 100.31 | 2,808,820,000 | 0.2 | 2018/9/20 | 0.78 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第2 85回 | 2,620,000,000 | 104.72 | 2,743,873,600 | 103.98 | 2,724,328,400 | 1.7 | 2017/3/20 | 0.76 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第2 96回 | 2,400,000,000 | 105.84 | 2,540,252,000 | 105.46 | 2,531,256,000 | 1.5 | 2018/9/20 | 0.70 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 45回 | 2,300,000,000 | 105.17 | 2,418,949,000 | 107.47 | 2,471,971,000 | 1.7 | 2033/6/20 | 0.69 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第11 3回 | 2,400,000,000 | 100.56 | 2,413,670,000 | 100.70 | 2,416,848,000 | 0.3 | 2018/6/20 | 0.67 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 21回 | 2,200,000,000 | 104.36 | 2,296,016,000 | 105.03 | 2,310,726,000 | 1 | 2022/3/20 | 0.64 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第10 7回 | 2,300,000,000 | 100.24 | 2,305,520,000 | 100.32 | 2,307,360,000 | 0.2 | 2017/12/20 | 0.64 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第2 84回 | 2,200,000,000 | 104.35 | 2,295,700,000 | 103.58 | 2,278,848,000 | 1.7 | 2016/12/20 | 0.63 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------|----------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-----|-----------|------|
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年) 第3 30回 | 2,100,000,000 | 101.91 | 2,140,287,000 | 103.19 | 2,167,074,000 | 0.8 | 2023/9/20 | 0.60 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年) 第1 40回 | 2,000,000,000 | 105.71 | 2,114,365,000 | 108.27 | 2,165,400,000 | 1.7 | 2032/9/20 | 0.60 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年) 第3 13回 | 2,000,000,000 | 106.54 | 2,130,885,000 | 106.81 | 2,136,280,000 | 1.3 | 2021/3/20 | 0.59 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年) 第3 15回 | 2,000,000,000 | 105.84 | 2,116,820,000 | 106.30 | 2,126,180,000 | 1.2 | 2021/6/20 | 0.59 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年) 第96 回 | 2,100,000,000 | 100.78 | 2,116,449,000 | 100.62 | 2,113,188,000 | 0.5 | 2016/3/20 | 0.59 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年) 第3 09回 | 2,000,000,000 | 105.07 | 2,101,480,000 | 105.14 | 2,102,880,000 | 1.1 | 2020/6/20 | 0.58 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 79.28 |
| 地方債証券 | 6.18 |
| 特殊債券 | 8.63 |
| 社債券 | 5.61 |
| 合 計 | 99.72 |

②【投資不動産物件】

野村インデックスファンド・国内債券

該当事項はありません。

(参考) 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

野村インデックスファンド・国内債券

該当事項はありません。

(参考) 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

野村インデックスファンド・国内債券

平成 26 年 9 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 | (2011 年 9 月 6 日) | 56 | 56 | 1.0153 | 1.0153 |
| 第 2 計算期間 | (2012 年 9 月 6 日) | 148 | 148 | 1.0331 | 1.0331 |
| 第 3 計算期間 | (2013 年 9 月 6 日) | 192 | 192 | 1.0396 | 1.0396 |
| 第 4 計算期間 | (2014 年 9 月 8 日) | 577 | 577 | 1.0661 | 1.0661 |
| | 2013 年 9 月末日 | 204 | — | 1.0483 | — |
| | 10 月末日 | 218 | — | 1.0539 | — |
| | 11 月末日 | 234 | — | 1.0545 | — |
| | 12 月末日 | 256 | — | 1.0488 | — |
| | 2014 年 1 月末日 | 265 | — | 1.0566 | — |
| | 2 月末日 | 315 | — | 1.0587 | — |
| | 3 月末日 | 325 | — | 1.0559 | — |
| | 4 月末日 | 304 | — | 1.0571 | — |
| | 5 月末日 | 316 | — | 1.0599 | — |
| | 6 月末日 | 352 | — | 1.0626 | — |
| | 7 月末日 | 486 | — | 1.0640 | — |
| | 8 月末日 | 541 | — | 1.0670 | — |
| | 9 月末日 | 616 | — | 1.0674 | — |

② 【分配の推移】

野村インデックスファンド・国内債券

| | 計算期間 | 1 口当たりの分配金 |
|----------|---------------------------------|------------|
| 第 1 計算期間 | 2010 年 11 月 26 日～2011 年 9 月 6 日 | 0.0000 円 |
| 第 2 計算期間 | 2011 年 9 月 7 日～2012 年 9 月 6 日 | 0.0000 円 |
| 第 3 計算期間 | 2012 年 9 月 7 日～2013 年 9 月 6 日 | 0.0000 円 |
| 第 4 計算期間 | 2013 年 9 月 7 日～2014 年 9 月 8 日 | 0.0000 円 |

③ 【収益率の推移】

野村インデックスファンド・国内債券

| | 計算期間 | 収益率 |
|--|------|-----|
| | | |

| | | |
|--------|-----------------------|------|
| 第1計算期間 | 2010年11月26日～2011年9月6日 | 1.5% |
| 第2計算期間 | 2011年9月7日～2012年9月6日 | 1.8% |
| 第3計算期間 | 2012年9月7日～2013年9月6日 | 0.6% |
| 第4計算期間 | 2013年9月7日～2014年9月8日 | 2.5% |

※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】

野村インデックスファンド・国内債券

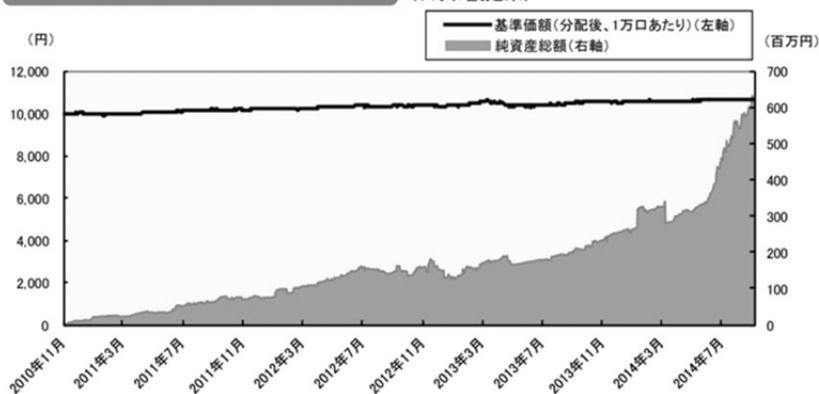
| | 計算期間 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|--------|-----------------------|---------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2010年11月26日～2011年9月6日 | 116,245,355 | 60,323,869 | 55,921,486 |
| 第2計算期間 | 2011年9月7日～2012年9月6日 | 256,789,350 | 169,375,428 | 143,335,408 |
| 第3計算期間 | 2012年9月7日～2013年9月6日 | 438,827,540 | 396,670,851 | 185,492,097 |
| 第4計算期間 | 2013年9月7日～2014年9月8日 | 1,107,505,193 | 751,773,049 | 541,224,241 |

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

運用実績 (2014年9月30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)

| | |
|---------|-----|
| 2014年9月 | 0 円 |
| 2013年9月 | 0 円 |
| 2012年9月 | 0 円 |
| 2011年9月 | 0 円 |
| -- | -- |
| 設定来累計 | 0 円 |

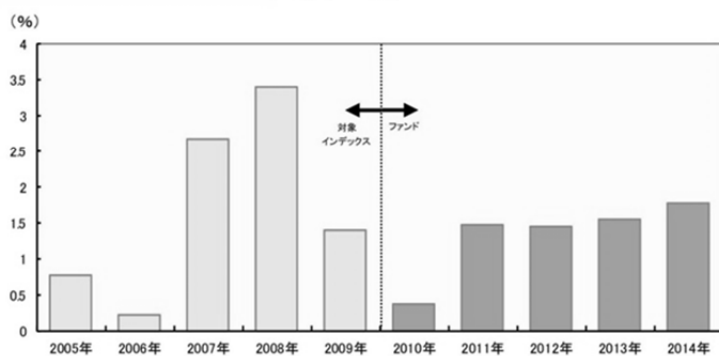
主要な資産の状況

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117回 | 国債証券 | 1.2 |
| 2 | 国庫債券 利付(5年)第116回 | 国債証券 | 1.2 |
| 3 | 国庫債券 利付(10年)第334回 | 国債証券 | 1.1 |
| 4 | 国庫債券 利付(5年)第105回 | 国債証券 | 1.0 |
| 5 | 国庫債券 利付(10年)第327回 | 国債証券 | 0.9 |
| 6 | 国庫債券 利付(5年)第106回 | 国債証券 | 0.9 |
| 7 | 国庫債券 利付(10年)第328回 | 国債証券 | 0.9 |
| 8 | 国庫債券 利付(10年)第332回 | 国債証券 | 0.9 |
| 9 | 国庫債券 利付(10年)第333回 | 国債証券 | 0.9 |
| 10 | 国庫債券 利付(10年)第329回 | 国債証券 | 0.9 |

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2005年から2009年は対象インデックスの年間収益率。
- ・2010年は設定日(2010年11月26日)から年末までのファンドの収益率。
- ・2014年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。取得申込の受付については、午後3時まで、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

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

■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によるものとします。

※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。

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

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

<申込手数料>

(i) 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。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。

(ii) 収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

2【換金（解約）手続等】

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

※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。

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については、午後 3 時までには、解約請求のお申込みが行なわれかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、解約申込みの受付日の基準価額となります。

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、大口解約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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付を中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消す場合があります。

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては 1 万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象 | 評価方法 |
|------|--|
| 公社債等 | 原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。* ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) ③価格情報会社の提供する価額 |

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時~午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

無期限とします(平成22年11月26日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

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

(b) 信託期間の終了

- (i) 委託者は、上記「(a) ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。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発します。
- (ii) 上記(i)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (iii) 上記(i)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行いません。
- (iv) 上記(i)から(iii)までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(i)から(iii)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

(v) 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

(vi) 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d) 信託約款の変更等(iv)」の書面決議が否決となる場合を除き、その委託者と受託者との間において存続します。

(c) 運用報告書

ファンドの決算時および償還時に運用報告書（交付運用報告書を作成している場合は交付運用報告書）を作成し、知っている受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更等

(i) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

(ii) 委託者は、上記(i)の事項（上記(i)の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(iii) 上記(ii)の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

(v) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

(vi) 上記(ii)から(v)までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(vii) 上記(i)から(vi)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

(i) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、

委託者は、上記「(d) 信託約款の変更等」に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(g) 反対者の買取請求権

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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。

<ファンドの信託約款の変更>

平成26年12月1日適用で下記の内容等の約款変更を予定しております。(下線部_____は変更部分を、「●」は信託約款において該当する条項の番号を示します。)

○新設

| (変更後) | (変更前) |
|---|-------------------|
| <p>(運用報告書に記載すべき事項の提供)</p> <p><u>第●条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。</u></p> <p><u>② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。</u></p> | <p><新設></p> |

○書面決議手続きの記載がある場合、以下の見出しの条文について変更を行いません。

| (変更後) | (変更前) |
|---|--|
| <p>(信託契約の解約)</p> <p><略></p> <p><略> 第●項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。</p> <p><略></p> | <p>(信託契約の解約)</p> <p><同左></p> <p><同左> 第●項の書面決議は議決権を行使することができる<u>受益者の半数以上</u>であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。</p> <p><同左></p> |

| (変更後) | (変更前) |
|--|---|
| <p>(信託約款の変更等) <略></p> <p>② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては<u>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。</u>）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發します。</p> <p>③ <略></p> <p>④ 第2項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。</p> <p>⑤～⑦ <略></p> | <p>(信託約款の変更等) <同左></p> <p>② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、<u>その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。</u>）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發します。</p> <p>③ <同左></p> <p>④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる<u>受益者の半数以上であつて、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数</u>をもって行ないます。</p> <p>⑤～⑦ <同左></p> |

| (変更後) | (変更前) |
|---|--|
| <p>(<u>反対受益者の受益権買取請求の不適用</u>)</p> <p>第●条 <u>この信託は、受益者が第●条の規定による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、第●条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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。</u></p> | <p>(<u>反対者の買取請求権</u>)</p> <p>第●条 <u>第●条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求の内容および買取請求の手續に関する事項は、第●条第●項または前条第2項に規定する書面に付記します。</u></p> |

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

①収益分配金に対する請求権

■収益分配金の支払い開始日■

<累積投資契約を結んでいない場合>

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益者にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販

売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。
<累積投資契約を結んでいる場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

②償還金に対する請求権

■償還金の支払い開始日■

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

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③換金(解約)請求権

■換金(解約)の単位■

受益者は、受益権を1万口単位、1口単位または1円単位で換金できます。

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

■換金(解約)代金の支払い開始日■

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

第3【ファンドの経理状況】

(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4期計算期間(平成25年9月7日から平成26年9月8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。

独立監査人の監査報告書

平成26年10月16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

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インデックスファンド・国内債券の平成25年9月7日から平成26年9月8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、野村インデックスファンド・国内債券の平成26年9月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

1 【財務諸表】

【野村インデックスファンド・国内債券】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第3期 (平成25年9月6日現在) | 第4期 (平成26年9月8日現在) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,284,822 | 24,181,480 |
| 親投資信託受益証券 | 192,811,990 | 576,966,492 |
| 未収入金 | 996,692 | 2,902,999 |
| 未収利息 | 2 | 41 |
| 流動資産合計 | 195,093,506 | 604,051,012 |
| 資産合計 | 195,093,506 | 604,051,012 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,892,088 | 26,221,468 |
| 未払受託者報酬 | 27,797 | 61,643 |
| 未払委託者報酬 | 342,771 | 760,216 |
| その他未払費用 | 1,791 | 4,044 |
| 流動負債合計 | 2,264,447 | 27,047,371 |
| 負債合計 | 2,264,447 | 27,047,371 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 185,492,097 | 541,224,241 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 7,336,962 | 35,779,400 |
| (分配準備積立金) | 1,583,078 | 2,805,019 |
| 元本等合計 | 192,829,059 | 577,003,641 |
| 純資産合計 | 192,829,059 | 577,003,641 |
| 負債純資産合計 | 195,093,506 | 604,051,012 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第3期 自 平成24年9月7日 至 平成25年9月6日 | 第4期 自 平成25年9月7日 至 平成26年9月8日 |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 1,884 | 4,680 |
| 有価証券売買等損益 | 961,633 | 8,058,411 |
| 営業収益合計 | 963,517 | 8,063,091 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 50,928 | 99,889 |
| 委託者報酬 | 627,927 | 1,231,848 |
| その他費用 | 3,281 | 6,539 |
| 営業費用合計 | 682,136 | 1,338,276 |

| | | |
|--|------------|------------|
| 営業利益又は営業損失 (△) | 281,381 | 6,724,815 |
| 経常利益又は経常損失 (△) | 281,381 | 6,724,815 |
| 当期純利益又は当期純損失 (△) | 281,381 | 6,724,815 |
| 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 (△) | 560,858 | 4,927,528 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 (△) | 4,737,353 | 7,336,962 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 17,217,325 | 68,362,532 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 17,217,325 | 68,362,532 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 14,338,239 | 41,717,381 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 14,338,239 | 41,717,381 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 7,336,962 | 35,779,400 |

(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25年9月7日から平成26年9月8日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 第3期 平成25年9月6日現在 | 第4期 平成26年9月8日現在 |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 185,492,097口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 541,224,241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 1.0396円 (10,000口当たり純資産額) (10,396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 1.0661円 (10,000口当たり純資産額) (10,661円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第3期 自平成24年9月7日 至平成25年9月6日 | 第4期 自平成25年9月7日 至平成26年9月8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>1,503,561円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>5,753,884円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>79,517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>7,336,962円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>185,492,097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>395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 | 1,503,561円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | 収益調整金額 | C | 5,753,884円 | 分配準備積立金額 | D | 79,517円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 7,336,962円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 185,492,097口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 395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>2,600,846円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>32,974,381円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>204,173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>35,779,400円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>541,224,241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>661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 | 2,600,846円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | 収益調整金額 | C | 32,974,381円 | 分配準備積立金額 | D | 204,173円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 35,779,400円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 541,224,241口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 661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 | 1,503,561円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 5,753,884円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 79,517円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 7,336,962円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 185,492,097口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 395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 | 2,600,846円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 32,974,381円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 204,173円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 35,779,400円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 541,224,241口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 661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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(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3期 自 平成24年9月7日 至 平成25年9月6日 | 第4期 自 平成25年9月7日 至 平成26年9月8日 |
|---|--|
| <p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> | <p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第3期 平成25年9月6日現在 | 第4期 平成26年9月8日現在 |
|---|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第3期 自 平成24年9月7日 至 平成25年9月6日 | 第4期 自 平成25年9月7日 至 平成26年9月8日 |
|--|-----------------------------------|
| <p>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。</p> | 同左 |

(その他の注記)

1 元本の移動

| 第3期 自 平成24年9月7日 至 平成25年9月6日 | 第4期 自 平成25年9月7日 至 平成26年9月8日 |
|-----------------------------------|-----------------------------------|
| | |

| | | | |
|-----------|---------------|-----------|-----------------|
| 期首元本額 | 143,335,408 円 | 期首元本額 | 185,492,097 円 |
| 期中追加設定元本額 | 438,827,540 円 | 期中追加設定元本額 | 1,107,505,193 円 |
| 期中一部解約元本額 | 396,670,851 円 | 期中一部解約元本額 | 751,773,049 円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 第3期 自平成24年9月7日 至平成25年9月6日 | 第4期 自平成25年9月7日 至平成26年9月8日 |
|-----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 損益に含まれた評価差額(円) | |
| 親投資信託受益証券 | 713,337 | 6,076,305 |
| 合計 | 713,337 | 6,076,305 |

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26年9月8日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成26年9月8日現在)

(単位:円)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|-----|-------------------------|------|-----------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | | 576,966,492 | |
| | 小計 | 銘柄数:1 組入時価比率:100.0% | | 576,966,492 100.0% | |
| 合計 | | | | 576,966,492 | |

(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。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成26年9月8日現在)

| | |
|---------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,066,283,194 |

| | |
|-----------------|-----------------|
| 国債証券 | 275,312,894,460 |
| 地方債証券 | 21,988,694,797 |
| 特殊債証券 | 29,977,836,298 |
| 社債証券 | 19,764,715,890 |
| 未収利息 | 1,261,157,981 |
| 前払費用 | 106,707,212 |
| 流動資産合計 | 351,478,289,832 |
| 資産合計 | 351,478,289,832 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 2,528,390,250 |
| 未払解約金 | 230,714,266 |
| 流動負債合計 | 2,759,104,516 |
| 負債合計 | 2,759,104,516 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 284,680,375,895 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 64,038,809,421 |
| 元本等合計 | 348,719,185,316 |
| 純資産合計 | 348,719,185,316 |
| 負債純資産合計 | 351,478,289,832 |

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、特殊債証券、社債証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る場合、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26年9月8日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 1.2249円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (12,249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25年9月7日 至平成26年9月8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 26 年 9 月 8 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 26 年 9 月 8 日現在

| 期首 | 平成 25 年 9 月 7 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 | 216,509,595,390 円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 111,368,189,623 円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 43,197,409,118 円 |
| 期末元本額 | 284,680,375,895 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 | 350,558,848 円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (安定コース) | 18,706,138,574 円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (分配コース) | 26,835,190,692 円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (成長コース) | 3,258,585,282 円 |
| 野村資産設計ファンド 2015 | 950,248,346 円 |
| 野村資産設計ファンド 2020 | 401,475,097 円 |
| 野村資産設計ファンド 2025 | 268,090,047 円 |
| 野村資産設計ファンド 2030 | 154,017,889 円 |
| 野村資産設計ファンド 2035 | 84,602,541 円 |
| 野村資産設計ファンド 2040 | 210,391,063 円 |
| 野村日本債券インデックスファンド | 1,969,545,962 円 |
| 野村日本債券インデックス (野村投資一任口座向け) | 55,933,065,493 円 |
| のむラップ・ファンド (保守型) | 4,192,553,212 円 |
| のむラップ・ファンド (普通型) | 1,401,905,620 円 |
| のむラップ・ファンド (積極型) | 366,424,099 円 |
| 野村日本債券インデックス (野村 SMA 向け) | 19,466,954,808 円 |
| 野村資産設計ファンド 2045 | 9,220,851 円 |
| 野村円債投資インデックスファンド | 1,697,959,630 円 |
| 野村インデックスファンド・国内債券 | 471,031,507 円 |
| マイ・ロード | 22,235,732,862 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 | 58,104,925 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) | 3,734,744,341 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) | 424,574,156 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) | 18,428,704,158 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) | 2,847,904,336 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) | 61,393,352 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) | 51,185,488 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) | 12,833,411 円 |

| | |
|---|-----------------|
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 9,386,045,779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） | 558,350,063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） | 2,993,617,514円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 1,482,683,897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） | 253,257,121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） | 492,895,302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） | 1,084,804,866円 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 2,206,725,033円 |
| ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 1,825,100,575円 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け） | 9,855,820,332円 |
| マイバランス50（確定拠出年金向け） | 14,534,469,708円 |
| マイバランス70（確定拠出年金向け） | 6,794,023,962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） | 34,485,013,384円 |
| マイバランスDC30 | 4,888,837,405円 |
| マイバランスDC50 | 2,907,956,346円 |
| マイバランスDC70 | 855,956,438円 |
| 野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合 | 5,491,681,580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26年9月8日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成26年9月8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333回 | 2,100,000,000 | 2,101,029,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第334回 | 2,100,000,000 | 2,101,113,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第335回 | 1,500,000,000 | 1,500,840,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第336回 | 1,000,000,000 | 1,000,530,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第337回 | 1,200,000,000 | 1,200,600,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第338回 | 1,400,000,000 | 1,400,728,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第339回 | 300,000,000 | 300,165,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第340回 | 1,000,000,000 | 1,000,580,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第341回 | 1,100,000,000 | 1,100,671,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第342回 | 1,200,000,000 | 1,200,768,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第343回 | 1,200,000,000 | 1,200,576,000 | |
| | | 国庫債券 利付(5年)第93回 | 1,700,000,000 | 1,709,537,000 | |
| | | 国庫債券 利付(5年)第94回 | 1,500,000,000 | 1,510,320,000 | |
| | | 国庫債券 利付(5年)第95回 | 1,000,000,000 | 1,008,140,000 | |
| | | 国庫債券 利付(5年)第96回 | 2,100,000,000 | 2,113,881,000 | |

| | | | |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（５年）第 9 7 回 | 1,700,000,000 | 1,710,098,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 9 8 回 | 900,000,000 | 903,744,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 9 9 回 | 1,900,000,000 | 1,912,692,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 0 回 | 1,000,000,000 | 1,004,650,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 1 回 | 1,600,000,000 | 1,612,000,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 2 回 | 2,900,000,000 | 2,915,138,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 3 回 | 2,000,000,000 | 2,011,320,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 4 回 | 1,000,000,000 | 1,003,140,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 5 回 | 3,500,000,000 | 3,511,620,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 6 回 | 3,400,000,000 | 3,411,798,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 7 回 | 2,300,000,000 | 2,308,257,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 8 回 | 1,000,000,000 | 1,000,320,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 0 9 回 | 1,100,000,000 | 1,100,000,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 0 回 | 1,000,000,000 | 1,007,020,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 1 回 | 1,000,000,000 | 1,010,530,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 2 回 | 1,500,000,000 | 1,516,350,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 3 回 | 2,300,000,000 | 2,316,422,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 4 回 | 1,100,000,000 | 1,107,711,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 5 回 | 2,300,000,000 | 2,306,900,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 6 回 | 4,200,000,000 | 4,211,592,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 7 回 | 3,800,000,000 | 3,809,386,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 8 回 | 3,000,000,000 | 3,006,390,000 | |
| 国庫債券 利付（５年）第 1 1 9 回 | 1,300,000,000 | 1,296,607,000 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 1 回 | 560,000,000 | 657,031,200 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 2 回 | 500,000,000 | 561,100,000 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 3 回 | 540,000,000 | 605,836,800 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 4 回 | 710,000,000 | 796,265,000 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 5 回 | 700,000,000 | 746,396,000 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 6 回 | 900,000,000 | 933,210,000 | |
| 国庫債券 利付（４ 0 年）第 7 回 | 350,000,000 | 342,310,500 | |
| 国庫債券 利付（１ 0 年）第 2 7 4 回 | 600,000,000 | 611,022,000 | |
| 国庫債券 利付（１ 0 年）第 2 7 5 回 | 1,500,000,000 | 1,525,635,000 | |
| 国庫債券 利付（１ 0 年）第 2 7 6 回 | 100,000,000 | 101,964,000 | |
| 国庫債券 利付（１ 0 年）第 2 7 7 回 | 750,000,000 | 767,512,500 | |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 回 | | | |
| 国庫債券 利付（10年）第278回 | 550,000,000 | 564,520,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第279回 | 920,000,000 | 947,084,800 | |
| 国庫債券 利付（10年）第280回 | 1,350,000,000 | 1,393,794,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第281回 | 800,000,000 | 827,376,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第282回 | 1,300,000,000 | 1,343,030,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第283回 | 1,400,000,000 | 1,449,028,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第284回 | 2,200,000,000 | 2,281,510,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第285回 | 2,620,000,000 | 2,727,210,400 | |
| 国庫債券 利付（10年）第286回 | 800,000,000 | 838,104,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第287回 | 1,550,000,000 | 1,628,104,500 | |
| 国庫債券 利付（10年）第288回 | 1,850,000,000 | 1,940,502,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第289回 | 2,000,000,000 | 2,092,800,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第290回 | 1,250,000,000 | 1,307,500,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第291回 | 1,400,000,000 | 1,459,486,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第292回 | 1,600,000,000 | 1,690,464,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第293回 | 750,000,000 | 797,797,500 | |
| 国庫債券 利付（10年）第294回 | 500,000,000 | 529,985,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第295回 | 1,600,000,000 | 1,683,920,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第296回 | 2,400,000,000 | 2,532,744,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第297回 | 1,100,000,000 | 1,159,411,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第298回 | 1,500,000,000 | 1,574,640,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第299回 | 1,400,000,000 | 1,472,982,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第300回 | 1,000,000,000 | 1,061,120,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第301回 | 1,500,000,000 | 1,596,000,000 | |

| | | |
|-------------------|---------------|---------------|
| 国庫債券 利付（10年）第302回 | 700,000,000 | 741,482,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第303回 | 1,600,000,000 | 1,699,792,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第304回 | 1,000,000,000 | 1,057,380,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第305回 | 2,800,000,000 | 2,967,020,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第306回 | 3,000,000,000 | 3,201,900,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第307回 | 1,000,000,000 | 1,061,830,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第308回 | 900,000,000 | 957,609,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第309回 | 2,000,000,000 | 2,105,160,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第310回 | 1,700,000,000 | 1,781,515,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第311回 | 1,050,000,000 | 1,087,842,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第312回 | 2,750,000,000 | 2,918,657,500 |
| 国庫債券 利付（10年）第313回 | 2,000,000,000 | 2,138,220,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第314回 | 1,000,000,000 | 1,056,250,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第315回 | 1,700,000,000 | 1,808,188,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第316回 | 900,000,000 | 951,282,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第317回 | 1,000,000,000 | 1,057,600,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第318回 | 1,600,000,000 | 1,681,120,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第319回 | 1,150,000,000 | 1,216,378,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第320回 | 1,900,000,000 | 1,996,121,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第321回 | 2,200,000,000 | 2,310,748,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第322回 | 900,000,000 | 938,691,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第323回 | 1,100,000,000 | 1,147,091,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第324回 | 1,900,000,000 | 1,966,937,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第325回 | 2,900,000,000 | 3,000,717,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第326回 | 1,600,000,000 | 1,641,728,000 |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 回 | | | |
| 国庫債券 利付（10年）第327回 | 3,300,000,000 | 3,412,563,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第328回 | 3,200,000,000 | 3,252,736,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第329回 | 3,100,000,000 | 3,201,029,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第330回 | 2,100,000,000 | 2,166,570,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第331回 | 1,100,000,000 | 1,115,279,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第332回 | 3,200,000,000 | 3,239,840,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第333回 | 3,200,000,000 | 3,234,944,000 | |
| 国庫債券 利付（10年）第334回 | 3,900,000,000 | 3,936,309,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第1回 | 100,000,000 | 125,984,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第2回 | 100,000,000 | 120,260,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第3回 | 160,000,000 | 190,012,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第4回 | 120,000,000 | 153,056,400 | |
| 国庫債券 利付（30年）第5回 | 150,000,000 | 175,368,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第6回 | 130,000,000 | 155,673,700 | |
| 国庫債券 利付（30年）第7回 | 155,000,000 | 182,814,750 | |
| 国庫債券 利付（30年）第8回 | 100,000,000 | 109,535,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第9回 | 65,000,000 | 66,847,950 | |
| 国庫債券 利付（30年）第10回 | 250,000,000 | 244,175,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第11回 | 160,000,000 | 171,600,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第12回 | 220,000,000 | 250,089,400 | |
| 国庫債券 利付（30年）第13回 | 290,000,000 | 324,037,300 | |
| 国庫債券 利付（30年）第14回 | 380,000,000 | 449,992,200 | |
| 国庫債券 利付（30年）第15回 | 450,000,000 | 540,045,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第16回 | 315,000,000 | 377,461,350 | |
| 国庫債券 利付（30年）第17回 | 400,000,000 | 471,740,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第18回 | 380,000,000 | 441,202,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第19回 | 300,000,000 | 347,934,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第20回 | 290,000,000 | 346,605,100 | |
| 国庫債券 利付（30年）第21回 | 270,000,000 | 312,654,600 | |
| 国庫債券 利付（30年）第22回 | 400,000,000 | 477,512,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第23回 | 540,000,000 | 644,500,800 | |

| | | | |
|------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（30年）第24回 | 300,000,000 | 357,966,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第25回 | 390,000,000 | 450,364,200 | |
| 国庫債券 利付（30年）第26回 | 850,000,000 | 997,254,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第27回 | 550,000,000 | 655,919,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第28回 | 700,000,000 | 835,513,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第29回 | 800,000,000 | 938,768,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第30回 | 900,000,000 | 1,038,384,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第31回 | 900,000,000 | 1,019,268,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第32回 | 1,100,000,000 | 1,268,267,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第33回 | 1,170,000,000 | 1,274,726,700 | |
| 国庫債券 利付（30年）第34回 | 1,300,000,000 | 1,471,262,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第35回 | 1,200,000,000 | 1,305,336,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第36回 | 1,200,000,000 | 1,304,172,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第37回 | 1,300,000,000 | 1,380,808,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第38回 | 900,000,000 | 935,253,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第39回 | 700,000,000 | 742,840,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第40回 | 700,000,000 | 725,592,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第41回 | 700,000,000 | 708,302,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第42回 | 800,000,000 | 808,736,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第43回 | 800,000,000 | 807,176,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第31回 | 110,000,000 | 115,759,600 | |
| 国庫債券 利付（20年）第32回 | 41,000,000 | 43,271,810 | |
| 国庫債券 利付（20年）第33回 | 410,000,000 | 441,004,200 | |
| 国庫債券 利付（20年）第34回 | 190,000,000 | 206,414,100 | |
| 国庫債券 利付（20年）第35回 | 228,000,000 | 246,547,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第36回 | 380,000,000 | 413,508,400 | |
| 国庫債券 利付（20年）第37回 | 320,000,000 | 349,184,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第38回 | 170,000,000 | 185,549,900 | |
| 国庫債券 利付（20年）第39回 | 511,000,000 | 555,947,560 | |
| 国庫債券 利付（20年）第40回 | 525,000,000 | 570,984,750 | |
| 国庫債券 利付（20年）第41回 | 255,000,000 | 270,585,600 | |
| 国庫債券 利付（20年）第42回 | 483,000,000 | 536,526,060 | |
| 国庫債券 利付（20年）第43回 | 400,000,000 | 454,884,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第44回 | 150,000,000 | 169,170,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第45回 | 242,000,000 | 271,603,860 | |

| | | | |
|------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（20年）第46回 | 90,000,000 | 100,429,200 | |
| 国庫債券 利付（20年）第47回 | 230,000,000 | 257,560,900 | |
| 国庫債券 利付（20年）第48回 | 200,000,000 | 228,526,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第49回 | 200,000,000 | 224,200,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第50回 | 183,000,000 | 202,787,790 | |
| 国庫債券 利付（20年）第51回 | 310,000,000 | 346,502,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第52回 | 100,000,000 | 112,703,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第53回 | 250,000,000 | 282,447,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第54回 | 250,000,000 | 284,230,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第55回 | 231,000,000 | 259,997,430 | |
| 国庫債券 利付（20年）第56回 | 120,000,000 | 135,345,600 | |
| 国庫債券 利付（20年）第57回 | 210,000,000 | 235,260,900 | |
| 国庫債券 利付（20年）第58回 | 180,000,000 | 201,862,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第59回 | 230,000,000 | 254,768,700 | |
| 国庫債券 利付（20年）第60回 | 380,000,000 | 411,597,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第61回 | 300,000,000 | 314,964,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第62回 | 440,000,000 | 454,339,600 | |
| 国庫債券 利付（20年）第63回 | 300,000,000 | 335,604,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第64回 | 400,000,000 | 451,684,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第65回 | 455,000,000 | 514,436,650 | |
| 国庫債券 利付（20年）第66回 | 300,000,000 | 336,363,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第67回 | 310,000,000 | 350,724,700 | |
| 国庫債券 利付（20年）第68回 | 290,000,000 | 336,188,300 | |
| 国庫債券 利付（20年）第69回 | 560,000,000 | 644,084,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第70回 | 540,000,000 | 637,399,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第71回 | 200,000,000 | 232,228,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第72回 | 670,000,000 | 772,724,400 | |
| 国庫債券 利付（20年）第73回 | 350,000,000 | 400,725,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第74回 | 320,000,000 | 369,500,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第75回 | 400,000,000 | 462,592,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第76回 | 430,000,000 | 488,471,400 | |
| 国庫債券 利付（20年）第77回 | 320,000,000 | 366,700,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第78回 | 310,000,000 | 352,392,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第79回 | 360,000,000 | 412,887,600 | |
| 国庫債券 利付（20年）第80回 | 320,000,000 | 370,454,400 | |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（20年）第81回 | 360,000,000 | 413,197,200 | |
| 国庫債券 利付（20年）第82回 | 620,000,000 | 718,418,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第83回 | 370,000,000 | 429,070,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第84回 | 700,000,000 | 803,929,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第85回 | 400,000,000 | 464,168,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第86回 | 450,000,000 | 532,165,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第87回 | 390,000,000 | 456,760,200 | |
| 国庫債券 利付（20年）第88回 | 300,000,000 | 355,113,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第89回 | 470,000,000 | 551,187,800 | |
| 国庫債券 利付（20年）第90回 | 710,000,000 | 833,227,600 | |
| 国庫債券 利付（20年）第91回 | 250,000,000 | 296,345,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第92回 | 650,000,000 | 755,865,500 | |
| 国庫債券 利付（20年）第93回 | 300,000,000 | 345,300,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第94回 | 200,000,000 | 232,640,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第95回 | 700,000,000 | 831,334,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第96回 | 400,000,000 | 465,396,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第97回 | 1,000,000,000 | 1,176,270,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第98回 | 300,000,000 | 349,098,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第99回 | 1,100,000,000 | 1,280,070,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第100回 | 720,000,000 | 846,619,200 | |
| 国庫債券 利付（20年）第101回 | 250,000,000 | 300,460,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第102回 | 500,000,000 | 601,125,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第103回 | 300,000,000 | 356,721,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第104回 | 400,000,000 | 465,384,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第105回 | 600,000,000 | 697,932,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第106回 | 400,000,000 | 470,624,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第107回 | 300,000,000 | 348,852,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第108回 | 700,000,000 | 795,095,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第109回 | 600,000,000 | 680,562,000 | |
| 国庫債券 利付（20年）第110回 | 700,000,000 | 813,113,000 | |

| | | |
|-------------------|---------------|---------------|
| 国庫債券 利付（20年）第111回 | 500,000,000 | 587,445,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第112回 | 800,000,000 | 928,824,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第113回 | 1,800,000,000 | 2,088,684,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第114回 | 1,300,000,000 | 1,507,480,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第115回 | 500,000,000 | 586,900,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第116回 | 500,000,000 | 586,535,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第117回 | 1,400,000,000 | 1,622,194,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第118回 | 500,000,000 | 571,630,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第119回 | 500,000,000 | 557,160,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第120回 | 500,000,000 | 542,725,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第121回 | 1,100,000,000 | 1,240,173,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第122回 | 700,000,000 | 778,967,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第123回 | 1,100,000,000 | 1,271,149,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第124回 | 600,000,000 | 684,468,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第125回 | 600,000,000 | 701,598,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第126回 | 600,000,000 | 683,622,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第127回 | 500,000,000 | 562,215,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第128回 | 1,000,000,000 | 1,122,830,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第129回 | 500,000,000 | 553,880,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第130回 | 1,200,000,000 | 1,327,128,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第131回 | 300,000,000 | 326,985,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第132回 | 500,000,000 | 543,550,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第133回 | 1,400,000,000 | 1,544,508,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第134回 | 400,000,000 | 440,488,000 |
| 国庫債券 利付（20年）第135回 | 400,000,000 | 433,984,000 |

| | | | | |
|-------|-----|-------------------------|-----------------|--------------------------|
| | | 回 | | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第136回 | 500,000,000 | 534,760,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第137回 | 400,000,000 | 433,104,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第138回 | 600,000,000 | 630,522,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第139回 | 400,000,000 | 426,564,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第140回 | 2,000,000,000 | 2,159,400,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第141回 | 1,700,000,000 | 1,830,135,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第142回 | 1,000,000,000 | 1,094,030,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第143回 | 1,000,000,000 | 1,058,210,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第144回 | 600,000,000 | 625,380,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第145回 | 2,300,000,000 | 2,464,864,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第146回 | 1,400,000,000 | 1,496,838,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第147回 | 1,600,000,000 | 1,679,152,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第148回 | 1,900,000,000 | 1,956,107,000 |
| | | 国庫債券 利付（20年）第149回 | 1,500,000,000 | 1,539,915,000 |
| | | ポーランド共和国 第12回円貨債券（2012） | 100,000,000 | 101,990,000 |
| | | ポーランド共和国 第15回円貨債券（2013） | 100,000,000 | 101,035,000 |
| | 小計 | 銘柄数：270 組入時価比率：78.9% | 259,779,000,000 | 275,312,894,460 79.4% |
| | 合計 | | | 275,312,894,460 |
| 地方債証券 | 日本円 | 東京都 公募第639回 | 100,000,000 | 103,524,000 |
| | | 東京都 公募第640回 | 100,000,000 | 103,847,000 |
| | | 東京都 公募第644回 | 60,000,000 | 62,518,800 |
| | | 東京都 公募第660回 | 100,000,000 | 105,454,000 |
| | | 東京都 公募第671回 | 100,000,000 | 105,879,000 |
| | | 東京都 公募第685回 | 100,000,000 | 105,250,000 |
| | | 東京都 公募第703回 | 100,000,000 | 104,692,000 |
| | | 東京都 公募第707回 | 100,000,000 | 103,773,000 |

| | | | |
|------|--------------|-------------|-------------|
| 東京都 | 公募第708回 | 100,000,000 | 103,932,000 |
| 東京都 | 公募第710回 | 100,000,000 | 103,327,000 |
| 東京都 | 公募第712回 | 100,000,000 | 102,919,000 |
| 東京都 | 公募第715回 | 100,000,000 | 102,762,000 |
| 東京都 | 公募第716回 | 200,000,000 | 205,766,000 |
| 東京都 | 公募(30年)第7回 | 100,000,000 | 115,784,000 |
| 東京都 | 公募第10回 | 200,000,000 | 223,204,000 |
| 東京都 | 公募第1回 | 300,000,000 | 327,615,000 |
| 東京都 | 公募第7回 | 100,000,000 | 115,716,000 |
| 東京都 | 公募第23回 | 100,000,000 | 114,719,000 |
| 北海道 | 公募平成18年度第6回 | 100,000,000 | 103,849,000 |
| 北海道 | 公募平成19年度第4回 | 100,000,000 | 105,097,000 |
| 北海道 | 公募平成21年度第6回 | 100,000,000 | 106,707,000 |
| 北海道 | 公募平成21年度第10回 | 100,000,000 | 106,494,000 |
| 北海道 | 公募平成24年度第6回 | 100,000,000 | 103,162,000 |
| 北海道 | 公募平成24年度第9回 | 100,000,000 | 102,752,000 |
| 神奈川県 | 公募第184回 | 100,000,000 | 104,919,000 |
| 神奈川県 | 公募第188回 | 200,000,000 | 210,260,000 |
| 神奈川県 | 公募第200回 | 100,000,000 | 102,987,000 |
| 神奈川県 | 公募第205回 | 100,000,000 | 101,308,000 |
| 神奈川県 | 公募(30年)第3回 | 100,000,000 | 117,776,000 |
| 神奈川県 | 公募第7回 | 200,000,000 | 233,534,000 |
| 神奈川県 | 公募第47回 | 100,000,000 | 100,569,000 |
| 大阪府 | 公募第285回 | 150,000,000 | 152,640,000 |
| 大阪府 | 公募第291回 | 100,000,000 | 103,350,000 |
| 大阪府 | 公募第303回 | 300,000,000 | 314,901,000 |
| 大阪府 | 公募第337回 | 200,000,000 | 213,248,000 |
| 大阪府 | 公募第346回 | 100,000,000 | 106,022,000 |
| 大阪府 | 公募第356回 | 100,000,000 | 104,904,000 |
| 大阪府 | 公募第5回 | 100,000,000 | 114,666,000 |
| 大阪府 | 公募第8回 | 100,000,000 | 108,932,000 |
| 大阪府 | 公募第98回 | 100,000,000 | 100,466,000 |
| 大阪府 | 公募第102回 | 100,000,000 | 100,101,000 |
| 京都府 | 公募平成18年度第1回 | 160,000,000 | 165,822,400 |
| 京都府 | 公募平成24年度第2回 | 100,000,000 | 104,044,000 |

| | | | |
|-----|--------------|-------------|-------------|
| 京都府 | 公募平成24年度第6回 | 100,000,000 | 103,104,000 |
| 京都府 | 公募平成26年度第5回 | 100,000,000 | 100,777,000 |
| 兵庫県 | 公募平成21年度第13回 | 100,000,000 | 106,079,000 |
| 兵庫県 | 公募平成22年度第1回 | 100,000,000 | 106,752,000 |
| 兵庫県 | 公募(30年)第2回 | 100,000,000 | 111,340,000 |
| 兵庫県 | 公募(15年)第3回 | 100,000,000 | 105,920,000 |
| 兵庫県 | 公募第2回 | 100,000,000 | 118,312,000 |
| 兵庫県 | 公募第9回 | 100,000,000 | 116,341,000 |
| 静岡県 | 公募平成19年度第4回 | 200,000,000 | 210,832,000 |
| 静岡県 | 公募平成21年度第2回 | 100,000,000 | 106,964,000 |
| 静岡県 | 公募平成21年度第7回 | 100,000,000 | 106,941,000 |
| 静岡県 | 公募平成24年度第10回 | 100,000,000 | 101,958,000 |
| 静岡県 | 公募平成26年度第3回 | 165,000,000 | 167,196,150 |
| 静岡県 | 公募(20年)第11回 | 100,000,000 | 110,520,000 |
| 愛知県 | 公募平成19年度第3回 | 111,000,000 | 116,788,650 |
| 愛知県 | 公募平成19年度第4回 | 100,000,000 | 105,453,000 |
| 愛知県 | 公募平成20年度第8回 | 100,000,000 | 114,361,000 |
| 愛知県 | 公募平成21年度第3回 | 114,000,000 | 121,997,100 |
| 愛知県 | 公募平成21年度第17回 | 100,000,000 | 106,515,000 |
| 愛知県 | 公募平成22年度第3回 | 100,000,000 | 106,511,000 |
| 愛知県 | 公募平成22年度第9回 | 100,000,000 | 105,515,000 |
| 愛知県 | 公募平成23年度第19回 | 100,000,000 | 104,815,000 |
| 愛知県 | 公募平成24年度第2回 | 100,000,000 | 104,620,000 |
| 愛知県 | 公募平成24年度第17回 | 100,000,000 | 108,501,000 |
| 広島県 | 公募平成22年度第6回 | 200,000,000 | 212,552,000 |
| 広島県 | 公募平成24年度第4回 | 100,000,000 | 103,099,000 |
| 埼玉県 | 公募平成19年度第7回 | 200,000,000 | 210,540,000 |
| 埼玉県 | 公募平成21年度第5回 | 100,000,000 | 106,126,000 |
| 埼玉県 | 公募平成22年度第2回 | 200,000,000 | 213,076,000 |
| 埼玉県 | 公募平成24年度第4回 | 100,000,000 | 103,517,000 |
| 埼玉県 | 公募平成25年度第6回 | 148,000,000 | 152,185,440 |
| 埼玉県 | 公募平成25年度第11回 | 100,000,000 | 101,183,000 |
| 福岡県 | 公募平成18年度第1回 | 200,000,000 | 207,892,000 |
| 福岡県 | 公募平成19年度第6回 | 100,000,000 | 104,850,000 |
| 福岡県 | 公募平成20年度第3回 | 100,000,000 | 105,472,000 |

| | | | |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 福岡県 公募平成23年度第5回 | 100,000,000 | 104,916,000 | |
| 福岡県 公募平成23年度第1回 | 100,000,000 | 108,294,000 | |
| 福岡県 公募(30年)平成19年度第1回 | 100,000,000 | 117,748,000 | |
| 千葉県 公募平成20年度第6回 | 100,000,000 | 106,116,000 | |
| 千葉県 公募平成21年度第11回 | 180,000,000 | 191,682,000 | |
| 千葉県 公募平成24年度第1回 | 100,000,000 | 105,121,000 | |
| 千葉県 公募平成24年度第2回 | 100,000,000 | 104,086,000 | |
| 千葉県 公募平成24年度第8回 | 100,000,000 | 103,358,000 | |
| 千葉県 公募(20年)第8回 | 100,000,000 | 115,699,000 | |
| 新潟県 公募平成21年度第2回 | 150,000,000 | 160,417,500 | |
| 群馬県 公募第8回 | 100,000,000 | 104,969,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第31回 | 200,000,000 | 203,164,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第32回 | 100,000,000 | 101,825,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第34回 | 383,500,000 | 390,383,825 | |
| 共同発行市場地方債 公募第35回 | 100,000,000 | 102,200,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第42回 | 100,000,000 | 103,456,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第56回 | 400,000,000 | 420,536,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第62回 | 100,000,000 | 105,923,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第64回 | 100,000,000 | 106,324,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第82回 | 300,000,000 | 319,470,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第84回 | 500,000,000 | 532,200,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第85回 | 100,000,000 | 106,847,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第88回 | 100,000,000 | 105,508,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第93回 | 300,000,000 | 318,591,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第94回 | 300,000,000 | 318,552,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第102回 | 150,000,000 | 157,447,500 | |
| 共同発行市場地方債 公募第110回 | 100,000,000 | 103,936,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第111回 | 200,000,000 | 207,874,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第113回 | 200,000,000 | 205,948,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第115回 | 100,000,000 | 103,149,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第116回 | 200,000,000 | 206,280,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第118回 | 100,000,000 | 103,358,000 | |

| | | | |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 共同発行市場地方債 公募第119回 | 200,000,000 | 205,958,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第120回 | 300,000,000 | 305,925,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第122回 | 100,000,000 | 101,383,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第126回 | 100,000,000 | 102,861,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第130回 | 100,000,000 | 102,284,000 | |
| 共同発行市場地方債 公募第132回 | 100,000,000 | 101,228,000 | |
| 堺市 公募平成22年度第1回 | 100,000,000 | 112,193,000 | |
| 滋賀県 公募平成25年度第1回 | 100,000,000 | 101,324,000 | |
| 栃木県 公募平成25年度第1回 | 100,000,000 | 101,324,000 | |
| 熊本県 公募平成18年度第2回 | 173,000,000 | 179,217,620 | |
| 静岡市 公募平成17年度第1回 | 100,000,000 | 101,812,000 | |
| 大阪市 公募平成21年度第6回 | 100,000,000 | 106,958,000 | |
| 大阪市 公募平成25年度第6回 | 100,000,000 | 101,529,000 | |
| 大阪市 公募(15年)第1回 | 100,000,000 | 110,983,000 | |
| 大阪市 公募(20年)第5回 | 100,000,000 | 119,709,000 | |
| 大阪市 公募(20年)第6回 | 100,000,000 | 116,289,000 | |
| 名古屋市 公募第460回 | 100,000,000 | 104,911,000 | |
| 名古屋市 公募第464回 | 100,000,000 | 105,856,000 | |
| 名古屋市 公募第469回 | 100,000,000 | 105,985,000 | |
| 名古屋市 公募第478回 | 100,000,000 | 105,187,000 | |
| 京都市 公募平成19年度第4回 | 190,000,000 | 199,705,200 | |
| 神戸市 公募平成17年度13回 | 100,000,000 | 102,147,000 | |
| 神戸市 公募平成21年度第7回 | 100,000,000 | 107,057,000 | |
| 横浜市 公募平成21年度第4回 | 200,000,000 | 211,622,000 | |
| 横浜市 公募平成22年度第5回 | 100,000,000 | 106,284,000 | |
| 横浜市 公募公債平成24年度2回 | 200,000,000 | 206,436,000 | |
| 横浜市 公募公債平成25年度1回 | 200,000,000 | 203,412,000 | |
| 札幌市 公募平成19年度第3回 | 100,000,000 | 105,001,000 | |
| 札幌市 公募平成22年度第4回 | 100,000,000 | 104,704,000 | |
| 川崎市 公募第82回 | 100,000,000 | 106,632,000 | |
| 川崎市 公募第85回 | 100,000,000 | 102,401,000 | |
| 川崎市 公募第32回 | 150,000,000 | 150,415,500 | |
| 北九州市 公募平成18年度第2回 | 170,000,000 | 176,460,000 | |

| | | | | | |
|------|-----|----------------------------|----------------|----------------|------|
| | | 北九州市 公募（20年）第14回 | 100,000,000 | 106,749,000 | |
| | | 福岡市 公募平成20年度第3回 | 100,000,000 | 105,150,000 | |
| | | 福岡市 公募平成24年度第5回 | 100,000,000 | 100,213,000 | |
| | | 広島市 公募平成21年度第3回 | 100,000,000 | 105,890,000 | |
| | | 千葉県 公募平成24年度第1回 | 100,000,000 | 105,004,000 | |
| | | さいたま市 公募第3回 | 100,000,000 | 101,801,000 | |
| | | 鹿児島県 公募平成18年度第1回 | 178,200,000 | 185,000,112 | |
| | | 福井県 公募平成24年度第4回 | 100,000,000 | 100,001,000 | |
| | | 山梨県 公募平成19年度第1回 | 200,000,000 | 210,926,000 | |
| | | 岡山県 公募平成21年度第2回 | 100,000,000 | 106,428,000 | |
| | | 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 | 116,971,000 | |
| | | 福岡北九州高速道路債券 第117回 | 100,000,000 | 115,897,000 | |
| | | 東京都住宅供給公社債券 第4回 | 300,000,000 | 310,305,000 | |
| | | 東京都住宅供給公社債券 第5回 | 200,000,000 | 209,990,000 | |
| | 小計 | 銘柄数：157 組入時価比率：6.3% | 20,832,700,000 | 21,988,694,797 | 6.3% |
| | 合計 | | | 21,988,694,797 | |
| 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 | 100,442,000 | |
| | | 新関西国際空港社債 財投機関債第12回 | 100,000,000 | 100,159,000 | |
| | | 原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回 | 300,000,000 | 299,964,000 | |
| | | 韓国産業銀行 第45回円貨社債（2014） | 100,000,000 | 100,296,000 | |
| | | 日本政策投資銀行債券 政府保証第18回 | 100,000,000 | 105,255,000 | |
| | | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第25回 | 100,000,000 | 100,747,000 | |
| | | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回 | 100,000,000 | 101,600,000 | |
| | | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回 | 100,000,000 | 100,030,000 | |
| | | 日本政策投資銀行社債 政府保証第5回 | 100,000,000 | 105,614,000 | |
| | | 日本政策投資銀行社債 政府保証第9回 | 100,000,000 | 104,599,000 | |
| | | 日本政策投資銀行社債 政府保証第10回 | 100,000,000 | 101,084,000 | |
| | | 日本政策投資銀行債券 財投機関債第29回 | 200,000,000 | 207,824,000 | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第3 4 4回 | 200,000,000 | 215,996,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第3回 | 100,000,000 | 101,905,000 | |
| 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 | 116,652,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第6回 | 200,000,000 | 203,836,000 | |
| 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 | 236,704,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第2 3回 | 200,000,000 | 236,256,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第3 3回 | 200,000,000 | 235,322,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第3 8回 | 100,000,000 | 106,286,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8 6回 | 200,000,000 | 207,344,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1 0 2回 | 100,000,000 | 101,193,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1 3 4回 | 200,000,000 | 199,060,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証債第1回 | 115,000,000 | 117,106,800 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3回 | 200,000,000 | 203,940,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回 | 100,000,000 | 102,219,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回 | 100,000,000 | 110,468,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回 | 100,000,000 | 110,555,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 4回 | 180,000,000 | 185,794,200 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第1 7回 | 100,000,000 | 103,764,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1回 | 200,000,000 | 207,576,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第4 2回 | 100,000,000 | 105,296,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5 6回 | 100,000,000 | 104,586,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5 8回 | 136,000,000 | 143,911,120 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6 0回 | 139,000,000 | 147,788,970 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6 7回 | 200,000,000 | 211,952,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 230,306,000 | |

| | | | |
|----------------------------------|-------------|-------------|--|
| 券 政府保証債第92回 | | | |
| 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 | 230,130,000 | |
| 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 | 317,703,000 | |
| 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 | 232,962,000 | |
| 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 | 426,100,000 | |
| 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 | 229,912,000 | |
| 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 | 223,918,000 | |
| 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 | 109,427,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第137回 | 300,000,000 | 318,435,000 | |
| 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 | 103,514,000 | |
| 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 | 106,241,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第170回 | 200,000,000 | 206,360,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第171回 | 100,000,000 | 104,944,000 | |
| 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 | 206,624,000 | |
| 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 | 206,168,000 | |
| 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 | 205,122,000 | |
| 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 | 413,432,000 | |
| 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 | 107,197,000 | |
| 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 | 405,208,000 | |
| 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 | 207,232,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第197回 | 254,000,000 | 261,985,760 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第224回 | 100,000,000 | 100,491,000 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承 継 財投機関債第33回 | 100,000,000 | 124,238,000 | |
| 公営企業債券 政府保証第856回 | 355,000,000 | 360,616,100 | |
| 公営企業債券 政府保証第857回 | 200,000,000 | 203,704,000 | |
| 公営企業債券 政府保証第858回 | 200,000,000 | 203,678,000 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 公営企業債券 政府保証第8 6 4回 | 135,000,000 | 139,333,500 | |
| 公営企業債券 政府保証第8 7 5回 | 100,000,000 | 104,296,000 | |
| 公営企業債券 政府保証第8 8 1回 | 200,000,000 | 209,348,000 | |
| 公営企業債券 政府保証第8 8 6回 | 103,000,000 | 109,466,340 | |
| 公営企業債券 3 0 年第4回財投機 関債 | 100,000,000 | 125,202,000 | |
| 公営企業債券 政府保証1 5 年第1 回 | 300,000,000 | 323,925,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第1回 | 100,000,000 | 106,788,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 政府保 証第5回 | 200,000,000 | 210,330,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 2 0 年 第4回 | 100,000,000 | 114,266,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 2 0 年 第6回 | 300,000,000 | 347,802,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 F 2 4 回 | 100,000,000 | 109,918,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第1 3 回 | 200,000,000 | 211,686,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 政府保 証第1 6 回 | 100,000,000 | 104,599,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第1 6 回 | 100,000,000 | 105,262,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第2 7 回 | 200,000,000 | 209,308,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6 回 | 100,000,000 | 106,321,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第3 7 回 | 300,000,000 | 309,672,000 | |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第3 9 回 | 100,000,000 | 103,202,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第4 1 回 | 100,000,000 | 102,755,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4 回 | 200,000,000 | 203,280,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第4 2 回 | 100,000,000 | 102,742,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第4 4 回 | 100,000,000 | 102,590,000 | |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第4 5 回 | 100,000,000 | 103,179,000 | |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第5 0 回 | 100,000,000 | 103,878,000 | |
| 地方公共団体金融機構債券 第5 2 回 | 300,000,000 | 308,460,000 | |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第5 9 回 | 116,000,000 | 117,526,560 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 地方公共団体金融機構債券（20年）第38回 | 100,000,000 | 101,195,000 | |
| 公営企業債券 20年第2回財投機関債 | 100,000,000 | 107,983,000 | |
| 公営企業債券 第24回財投機関債 | 100,000,000 | 104,094,000 | |
| 中小企業債券 第6回財投機関債 | 100,000,000 | 102,138,000 | |
| 国際協力銀行債券 第27回財投機関債 | 200,000,000 | 208,160,000 | |
| 都市再生債券 財投機関債第21回 | 300,000,000 | 318,189,000 | |
| 都市再生債券 財投機関債第97回 | 100,000,000 | 100,030,000 | |
| 本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回 | 100,000,000 | 115,699,000 | |
| 民間都市開発推進機構 政府保証第16回 | 120,000,000 | 122,295,600 | |
| 東京交通債券 第342回 | 200,000,000 | 229,752,000 | |
| 東京交通債券 第347回 | 157,000,000 | 177,606,250 | |
| 福祉医療機構債券 第31回財投機関債 | 100,000,000 | 103,647,000 | |
| 預金保険機構債券 政府保証第191回 | 100,000,000 | 100,008,000 | |
| 預金保険機構債券 政府保証第194回 | 300,000,000 | 299,901,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回 | 200,000,000 | 211,818,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回 | 100,000,000 | 106,460,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回 | 100,000,000 | 112,540,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回 | 100,000,000 | 110,957,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回 | 100,000,000 | 112,316,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回 | 100,000,000 | 112,144,000 | |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回 | 100,000,000 | 107,600,000 | |
| 国民生活債券 政府保証第17回 | 200,000,000 | 204,582,000 | |
| 商工債券 利付第734回い号 | 100,000,000 | 100,743,000 | |
| 商工債券 利付第739回い号 | 100,000,000 | 100,791,000 | |
| 商工債券 利付第740回い号 | 100,000,000 | 100,701,000 | |
| 商工債券 利付第742回い号 | 100,000,000 | 100,608,000 | |
| 商工債券 利付第753回い号 | 100,000,000 | 100,258,000 | |
| 農林債券 利付第729回い号 | 100,000,000 | 100,847,000 | |
| 農林債券 利付第741回い号 | 150,000,000 | 151,161,000 | |

| | | | |
|---------------------------------|-------------|-------------|--|
| 農林債券 利付第743回い号 | 100,000,000 | 100,681,000 | |
| 農林債券 利付第745回い号 | 100,000,000 | 100,431,000 | |
| 農林債券 利付第751回い号 | 200,000,000 | 200,622,000 | |
| 農林債券 利付第752回い号 | 100,000,000 | 100,302,000 | |
| 農林債券 利付第756回い号 | 100,000,000 | 100,275,000 | |
| 農林債券 利付第759回い号 | 100,000,000 | 100,651,000 | |
| 農林債券 利付第760回い号 | 100,000,000 | 100,645,000 | |
| 農林債券 利付第764回い号 | 100,000,000 | 100,391,000 | |
| しんきん中金債券 利付第259回 | 100,000,000 | 100,719,000 | |
| しんきん中金債券 利付第271回 | 200,000,000 | 201,058,000 | |
| しんきん中金債券 利付第284回 | 100,000,000 | 100,810,000 | |
| しんきん中金債券 利付第286回 | 100,000,000 | 100,627,000 | |
| しんきん中金債券 利付第287回 | 100,000,000 | 100,413,000 | |
| しんきん中金債券 利付第290回 | 100,000,000 | 100,370,000 | |
| 商工債券 利付(3年)第174回 | 200,000,000 | 199,912,000 | |
| 商工債券 利付(10年)第5回 | 500,000,000 | 526,770,000 | |
| 韓国ガス公社 第6回円貨債券(支配権変更プットオプション条項) | 100,000,000 | 101,688,000 | |
| 国際協力機構債券 第6回財投機関債 | 100,000,000 | 113,534,000 | |
| 東日本高速道路債券 政府保証第2回 | 120,000,000 | 122,180,400 | |
| 東日本高速道路 第26回 | 100,000,000 | 100,144,000 | |
| 中日本高速道路債券 政府保証第2回 | 100,000,000 | 101,821,000 | |
| 中日本高速道路債券 政府保証第13回 | 138,000,000 | 143,910,540 | |
| 中日本高速道路債券 政府保証第14回 | 100,000,000 | 104,957,000 | |
| 中日本高速道路債券 財投機関債第3回 | 100,000,000 | 105,216,000 | |
| 中日本高速道路社債 第32回 | 200,000,000 | 203,242,000 | |
| 中日本高速道路社債 第44回 | 100,000,000 | 101,247,000 | |
| 中日本高速道路社債 第47回 | 100,000,000 | 100,234,000 | |
| 西日本高速道路債券 政府保証第1回 | 215,000,000 | 218,949,550 | |
| 西日本高速道路債券 政府保証第2回 | 176,000,000 | 182,367,680 | |
| 西日本高速道路債券 政府保証第3回 | 151,000,000 | 156,704,780 | |
| 西日本高速道路債券 政府保証第8回 | 100,000,000 | 104,283,000 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 回 | | | |
| 西日本高速道路 第23回 | 100,000,000 | 99,836,000 | |
| 銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第24回 | 300,000,000 | 300,033,000 | |
| 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 | 210,426,000 | |
| 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 | 100,403,000 | |
| 貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券 | 18,780,000 | 19,765,762 | |
| 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券 | 69,870,000 | 73,254,502 | |
| 貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券 | 128,065,000 | 135,235,359 | |
| 貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券 | 77,451,000 | 82,145,305 | |
| 貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券 | 110,634,000 | 120,578,890 | |
| 貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券 | 26,819,000 | 29,020,571 | |
| 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券 | 76,220,000 | 81,104,177 | |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券 | 39,245,000 | 41,970,172 | |
| 貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券 | 74,829,000 | 78,693,917 | |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券 | 168,908,000 | 178,456,369 | |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券 | 133,520,000 | 142,707,511 | |
| 貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券 | 137,852,000 | 150,162,183 | |
| 貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券 | 80,126,000 | 85,733,217 | |
| 貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券 | 41,334,000 | 44,504,731 | |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券 | 50,965,000 | 55,308,237 | |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券 | 173,154,000 | 185,456,591 | |
| 貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券 | 45,952,000 | 48,285,902 | |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券 | 163,530,000 | 170,453,860 | |
| 貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券 | 93,672,000 | 98,733,098 | |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券 | 244,155,000 | 260,108,087 | |

| | | | |
|-------------------------|----------------|----------------|--|
| 貸付債権担保第5 2回住宅金融支援機構債券 | 171,320,000 | 179,459,413 | |
| 貸付債権担保第2 4回住宅金融支援機構債券 | 102,448,000 | 111,520,794 | |
| 貸付債権担保第4 8回住宅金融支援機構債券 | 244,149,000 | 261,608,094 | |
| 貸付債権担保第4 0回住宅金融支援機構債券 | 237,717,000 | 246,586,221 | |
| 貸付債権担保第6 2回住宅金融支援機構債券 | 271,995,000 | 279,442,223 | |
| 貸付債権担保第6 0回住宅金融支援機構債券 | 266,784,000 | 276,761,721 | |
| 貸付債権担保第6 1回住宅金融支援機構債券 | 179,158,000 | 184,713,689 | |
| 貸付債権担保第5 1回住宅金融支援機構債券 | 84,417,000 | 89,143,507 | |
| 貸付債権担保第4 3回住宅金融支援機構債券 | 165,342,000 | 174,153,075 | |
| 貸付債権担保第7 9回住宅金融支援機構債券 | 96,983,000 | 98,493,025 | |
| 貸付債権担保第7 2回住宅金融支援機構債券 | 93,876,000 | 95,502,871 | |
| 貸付債権担保第2 2回住宅金融公庫債券 | 55,252,000 | 58,536,731 | |
| 貸付債権担保第7 0回住宅金融支援機構債券 | 93,487,000 | 96,346,767 | |
| 貸付債権担保第3 3回住宅金融支援機構債券 | 64,882,000 | 69,117,496 | |
| 貸付債権担保第3 4回住宅金融支援機構債券 | 64,747,000 | 68,910,879 | |
| 貸付債権担保第3 5回住宅金融支援機構債券 | 70,536,000 | 75,153,286 | |
| 貸付債権担保第4 6回住宅金融支援機構債券 | 81,246,000 | 86,882,035 | |
| 貸付債権担保第5 5回住宅金融支援機構債券 | 175,736,000 | 183,076,492 | |
| 貸付債権担保第5 6回住宅金融支援機構債券 | 174,476,000 | 181,870,292 | |
| 貸付債権担保第5 7回住宅金融支援機構債券 | 87,934,000 | 91,783,750 | |
| 貸付債権担保第7 6回住宅金融支援機構債券 | 191,484,000 | 196,730,661 | |
| 貸付債権担保S種第1 5回住宅金融支援機構債券 | 87,704,000 | 91,971,676 | |
| 貸付債権担保第5 8回住宅金融支援機構債券 | 176,976,000 | 184,209,009 | |
| 貸付債権担保第8 8回住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,198,000 | |
| 小計 | 28,553,730,000 | 29,977,836,298 | |
| 銘柄数：196 | | | |

| | | | | |
|-----------------------|-------------|---------------------------------|-------------|----------------|
| | | 組入時価比率：8.6% | | 8.6% |
| | 合計 | | | 29,977,836,298 |
| 社債券 | 日本円 | フランス相互信用連合銀行（BF C M） 第11回円貨社債 | 100,000,000 | 100,377,000 |
| | | 成田国際空港 第13回一般担保付 | 200,000,000 | 204,550,000 |
| | | 韓国輸出入銀行 第13回円貨債券（2014） | 100,000,000 | 100,106,000 |
| | | GEキャピタルコーポレーション 第23回円貨社債 | 100,000,000 | 100,402,000 |
| | | J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー 第9回円貨社債 | 100,000,000 | 102,567,000 |
| | | J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー 第10回円貨社債 | 100,000,000 | 100,390,000 |
| | | 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 | 107,401,000 |
| | | ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク 第9回円貨社債 | 100,000,000 | 104,103,000 |
| | | バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション 第6回円貨社債 | 200,000,000 | 203,392,000 |
| | | 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 | 100,199,000 |
| | | ビー・エヌ・ビー・パリバ 第4回円貨社債（2013） | 100,000,000 | 100,376,000 |
| | | ナショナル・オーストラリア銀行 第6回円貨社債（2011） | 100,000,000 | 101,461,000 |
| | | オーストラリア・コモンウェルス銀行 第5回円貨社債（2011） | 200,000,000 | 202,310,000 |
| | | ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第9回円貨社債 | 200,000,000 | 204,766,000 |
| | | オーストラリア・ニュージーランド銀行 第7回円貨社債 | 100,000,000 | 102,460,000 |
| | | ラボバンク・ネダーランド 第16回円貨社債（2012）（コー | 100,000,000 | 102,224,000 |
| | | ラボバンク・ネダーランド 第17回円貨社債（2012）（コー | 100,000,000 | 100,393,000 |
| | | ラボバンク・ネダーランド 第18回円貨社債（2012）（コー | 100,000,000 | 101,384,000 |
| | | ラボバンク・ネダーランド 第25回円貨社債（2014）（コー | 100,000,000 | 100,294,000 |
| | | 清水建設 第18回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,597,000 |
| | | 森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,051,000 |
| | | サッポロホールディングス 第26回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,967,000 |
| キッコーマン 第5回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,598,000 | | |
| ニチレイ 第19回社債間限定同順位 | 100,000,000 | 100,573,000 | | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 位特約付 | | | |
| 森ビル 第13回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,071,000 | |
| 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 | 100,127,000 | |
| 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 | 106,389,000 | |
| 日本製紙グループ本社 第8回日本製紙株式会社保証付 | 100,000,000 | 104,256,000 | |
| レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 99,821,000 | |
| 住友化学 第36回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 104,181,000 | |
| 三菱化学 第33回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,609,000 | |
| 三井化学 第34回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,333,000 | |
| 宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,000,000 | |
| 花王 第4回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,851,000 | |
| 武田薬品工業 第11回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,276,000 | |
| JXホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,687,000 | |
| 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 | 100,753,000 | |
| 新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 108,779,000 | |
| 新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 105,560,000 | |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第16回(JFE保証) | 100,000,000 | 101,633,000 | |
| 小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,167,000 | |
| 東芝 第50回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,848,000 | |
| 三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,430,000 | |
| 日本電産 第3回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,749,000 | |
| 富士通 第34回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,183,000 | |
| パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 107,654,000 | |
| パナソニック 第10回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 201,618,000 | |
| ソニー 第26回 | 100,000,000 | 105,914,000 | |

| | | | |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,407,000 | |
| 川崎重工業 第32回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,240,000 | |
| 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 | 300,666,000 | |
| 日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 201,222,000 | |
| トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付 | 100,000,000 | 103,829,000 | |
| 伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 106,049,000 | |
| 丸紅 第72回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,395,000 | |
| 豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,409,000 | |
| 三井物産 第58回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,976,000 | |
| 三井物産 第71回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,670,000 | |
| 住友商事 第30回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,225,000 | |
| 三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無 | 100,000,000 | 105,358,000 | |
| 三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無 | 100,000,000 | 106,542,000 | |
| 丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,234,000 | |
| イオン 第16回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,013,000 | |
| 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 | 118,646,000 | |
| みずほコーポレート銀行 第29回特定社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 201,342,000 | |
| 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 | 300,549,000 | |
| 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 | 113,107,000 | |
| 三菱東京UFJ銀行 第93回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 105,641,000 | |
| 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 | 104,403,000 | |
| 三菱東京UFJ銀行 第11回(劣後特約付) | 100,000,000 | 104,450,000 | |
| 三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付) | 300,000,000 | 316,728,000 | |
| 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 | 300,192,000 | |
| りそな銀行 第4回社債間限定同順位 | 100,000,000 | 111,051,000 | |

| | | | |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 位特約付 | | | |
| 三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付 | 100,000,000 | 108,010,000 | |
| 住友信託銀行 第5回劣後特約付 | 100,000,000 | 103,270,000 | |
| 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 | 100,137,000 | |
| みずほ信託銀行 第1回劣後特約付 | 100,000,000 | 102,147,000 | |
| セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,292,000 | |
| みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付 | 100,000,000 | 100,570,000 | |
| 三井住友銀行 第52回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 201,134,000 | |
| 三井住友銀行 第57回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,338,000 | |
| 三井住友銀行 第24回劣後特約付 | 100,000,000 | 107,596,000 | |
| みずほ銀行 第6回劣後特約付 | 200,000,000 | 208,606,000 | |
| みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,089,000 | |
| 興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,167,000 | |
| NTTファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,023,000 | |
| NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,123,000 | |
| 日産フィナンシャルサービス 第20回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,778,000 | |
| 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 | 100,076,000 | |
| トヨタファイナンス 第27回社債間限定同等特約付 | 200,000,000 | 208,360,000 | |
| オリックス 第144回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 104,005,000 | |
| オリックス 第148回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 102,428,000 | |
| オリックス 第164回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,650,000 | |
| 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 | 100,646,000 | |
| 三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,744,000 | |
| 三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 99,788,000 | |
| 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 | 99,778,000 | |
| 野村ホールディングス 第6回 | 100,000,000 | 103,961,000 | |
| 野村ホールディングス 第21回 | 100,000,000 | 107,489,000 | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 野村ホールディングス 第41回 | 100,000,000 | 101,577,000 | |
| 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 | 104,569,000 | |
| 三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 108,148,000 | |
| 三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無 | 100,000,000 | 114,829,000 | |
| 三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無 | 100,000,000 | 101,471,000 | |
| 三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無 | 100,000,000 | 103,407,000 | |
| 住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,524,000 | |
| 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 | 104,026,000 | |
| 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 | 103,388,000 | |
| 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 | 101,486,000 | |
| 東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,769,000 | |
| 京成電鉄 第42回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 104,540,000 | |
| 東日本旅客鉄道 第15回 | 100,000,000 | 113,827,000 | |
| 東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 114,163,000 | |
| 東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 212,100,000 | |
| 東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 110,682,000 | |
| 西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 116,408,000 | |
| 西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 106,828,000 | |
| 東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 108,078,000 | |
| 東海旅客鉄道 第25回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,277,000 | |
| 東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 230,262,000 | |
| 日本電信電話 第51回 | 300,000,000 | 310,179,000 | |
| 日本電信電話 第60回 | 100,000,000 | 106,155,000 | |
| KDDI 第5回2号 | 100,000,000 | 107,817,000 | |
| NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 106,543,000 | |
| 東京電力 第455回 | 100,000,000 | 101,782,000 | |
| 東京電力 第459回 | 100,000,000 | 104,258,000 | |

| | | | |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 東京電力 第524回 | 100,000,000 | 100,775,000 | |
| 東京電力 第525回 | 100,000,000 | 100,627,000 | |
| 東京電力 第542回 | 100,000,000 | 100,161,000 | |
| 東京電力 第559回 | 100,000,000 | 98,615,000 | |
| 東京電力 第560回 | 100,000,000 | 96,016,000 | |
| 東京電力 第565回 | 300,000,000 | 293,808,000 | |
| 中部電力 第482回 | 200,000,000 | 217,218,000 | |
| 中部電力 第500回 | 100,000,000 | 100,859,000 | |
| 関西電力 第448回 | 200,000,000 | 212,476,000 | |
| 関西電力 第469回 | 100,000,000 | 104,836,000 | |
| 関西電力 第482回 | 100,000,000 | 102,788,000 | |
| 関西電力 第484回 | 100,000,000 | 101,531,000 | |
| 中国電力 第314回 | 100,000,000 | 109,337,000 | |
| 中国電力 第330回 | 100,000,000 | 110,452,000 | |
| 中国電力 第378回 | 100,000,000 | 102,390,000 | |
| 北陸電力 第248回 | 100,000,000 | 106,319,000 | |
| 北陸電力 第308回 | 100,000,000 | 99,854,000 | |
| 東北電力 第431回 | 400,000,000 | 424,496,000 | |
| 四国電力 第281回 | 200,000,000 | 206,380,000 | |
| 九州電力 第389回 | 200,000,000 | 206,244,000 | |
| 九州電力 第400回 | 100,000,000 | 107,348,000 | |
| 九州電力 第409回 | 100,000,000 | 105,342,000 | |
| 九州電力 第424回 | 200,000,000 | 206,988,000 | |
| 北海道電力 第285回 | 100,000,000 | 102,405,000 | |
| 北海道電力 第296回 | 100,000,000 | 105,843,000 | |
| 北海道電力 第316回 | 107,000,000 | 110,131,890 | |
| 電源開発 第37回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 103,361,000 | |
| 電源開発 第39回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,248,000 | |
| 電源開発 第41回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 99,677,000 | |
| 東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 109,080,000 | |
| 東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 101,405,000 | |
| 大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 109,194,000 | |
| 東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 112,039,000 | |

| | | | | |
|--|----|------------------------|----------------|------------------------|
| | | 位特約付 | | |
| | 小計 | 銘柄数：159 組入時価比率：5.7% | 19,107,000,000 | 19,764,715,890 5.7% |
| | 合計 | | | 19,764,715,890 |
| | 合計 | | | 347,044,141,445 |

(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】

野村インデックスファンド・国内債券

平成26年9月30日現在

| | |
|------------------------|--------------|
| I 資産総額 | 689,668,066円 |
| II 負債総額 | 73,475,917円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 616,192,149円 |
| IV 発行済口数 | 577,282,893口 |
| V 1口当たり純資産額 (III / IV) | 1.0674円 |

(参考) 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

平成26年9月30日現在

| | |
|------------------------|------------------|
| I 資産総額 | 364,550,161,929円 |
| II 負債総額 | 7,302,280,318円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 357,247,881,611円 |
| IV 発行済口数 | 291,222,286,592口 |
| V 1口当たり純資産額 (III / IV) | 1.2267円 |

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記

名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

- ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 上記①の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、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26年10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

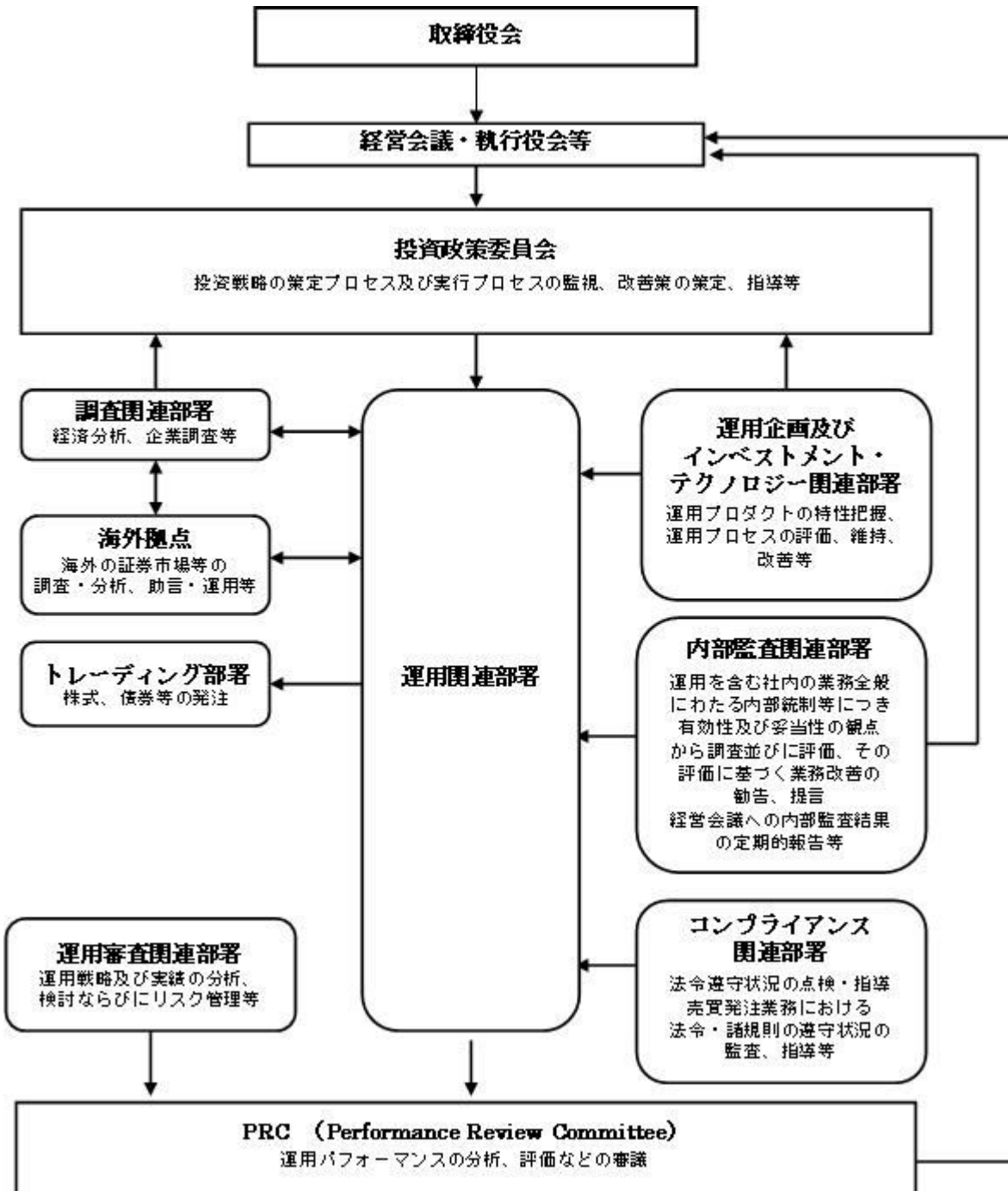
代表執行役・執行役

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

委員会

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

(b) 投資信託の運用体制



2 【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成 26 年 9 月 30 日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

| 種類 | 本数 | 純資産総額(百万円) |
|------------|-----|------------|
| 追加型株式投資信託 | 847 | 15,156,941 |
| 単位型株式投資信託 | 46 | 228,824 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 6,555,587 |
| 単位型公社債投資信託 | 68 | 656,040 |
| 合計 | 979 | 22,597,392 |

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。

なお、当事業年度(平成25年4月1日から平成26年3月31日まで)の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」(平成24年9月21日内閣府令第61号)附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(平成25年4月1日から平成26年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 26 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 湯原尚

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 25 年 4 月 1 日から平成 26 年 3 月 31 日までの第 55 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26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。

(1) 【貸借対照表】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (平成25年3月31日) | | 当事業年度 (平成26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 | | | 333 | | 247 |
| 金銭の信託 | | | 51,061 | | 51,758 |
| 有価証券 | | | 4,500 | | 11,800 |
| 前払金 | | | - | | 0 |
| 前払費用 | | | 29 | | 28 |
| 未収入金 | | | 271 | | 287 |
| 未収委託者報酬 | | | 8,651 | | 10,741 |
| 未収収益 | | | 4,224 | | 5,999 |
| 繰延税金資産 | | | 1,504 | | 2,010 |
| その他 | | | 12 | | 159 |
| 貸倒引当金 | | | △6 | | △8 |
| 流動資産計 | | | 70,582 | | 83,026 |
| 固定資産 | | | | | |
| 有形固定資産 | | | 1,470 | | 1,508 |
| 建物 | ※2 | 485 | | 442 | |
| 器具備品 | ※2 | 985 | | 1,065 | |
| 無形固定資産 | | | 8,458 | | 8,249 |
| ソフトウェア | | 8,457 | | 8,248 | |
| 電話加入権 | | 1 | | 1 | |
| その他 | | 0 | | 0 | |
| 投資その他の資産 | | | 21,443 | | 22,052 |
| 投資有価証券 | | 9,061 | | 11,747 | |
| 関係会社株式 | | 12,092 | | 9,609 | |
| 従業員長期貸付金 | | 29 | | 35 | |
| 長期差入保証金 | | 55 | | 50 | |
| 長期前払費用 | | 19 | | 80 | |
| 前払年金費用 | | - | | 347 | |
| その他 | | 184 | | 181 | |
| 貸倒引当金 | | △0 | | △0 | |
| 固定資産計 | | | 31,373 | | 31,810 |
| 資産合計 | | | 101,956 | | 114,837 |

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (平成25年3月31日) | | 当事業年度 (平成26年3月31日) | |
|--------------|----------|-----------------------|---------|-----------------------|---------|
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| (負債の部) | | | | | |
| 流動負債 | | | | | |
| 短期借入金 | | | 3,000 | | - |
| 関係会社短期借入金 | | | 2,000 | | - |
| 預り金 | | | 102 | | 106 |
| 未払金 | ※1 | | 6,481 | | 9,720 |
| 未払収益分配金 | | 3 | | 2 | |
| 未払償還金 | | 42 | | 33 | |
| 未払手数料 | | 3,764 | | 4,493 | |
| その他未払金 | | 2,671 | | 5,191 | |
| 未払費用 | ※1 | | 6,979 | | 8,420 |
| 未払法人税等 | | | 763 | | 1,960 |
| 賞与引当金 | | | 3,109 | | 3,984 |
| 流動負債計 | | | 22,436 | | 24,191 |
| 固定負債 | | | | | |
| 退職給付引当金 | | | 813 | | - |
| 時効後支払損引当金 | | | 495 | | 505 |
| 繰延税金負債 | | | 1,640 | | 3,211 |
| 固定負債計 | | | 2,948 | | 3,716 |
| 負債合計 | | | 25,385 | | 27,907 |
| (純資産の部) | | | | | |
| 株主資本 | | | | | |
| 資本金 | | | 71,942 | | 80,249 |
| 資本剰余金 | | | 17,180 | | 17,180 |
| 資本剰余金 | | | 11,729 | | 11,729 |
| 資本準備金 | | 11,729 | | 11,729 | |
| 利益剰余金 | | | 43,032 | | 51,339 |
| 利益準備金 | | 685 | | 685 | |
| その他利益剰余金 | | 42,347 | | 50,654 | |
| 別途積立金 | | 24,606 | | 24,606 | |
| 繰越利益剰余金 | | 17,740 | | 26,048 | |
| 評価・換算差額等 | | | 4,628 | | 6,679 |
| その他有価証券評価差額金 | | | 4,659 | | 6,679 |
| 繰延ヘッジ損益 | | | △30 | | - |
| 純資産合計 | | | 76,570 | | 86,929 |
| 負債・純資産合計 | | | 101,956 | | 114,837 |

(2) 【損益計算書】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日) | | 当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日) | |
|-----------|----------|---|--------|---|---------|
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| 営業収益 | | | | | |
| 委託者報酬 | | | 74,067 | | 87,258 |
| 運用受託報酬 | | | 17,516 | | 24,589 |
| その他営業収益 | | | 163 | | 188 |
| 営業収益計 | | | 91,747 | | 112,036 |
| 営業費用 | | | | | |
| 支払手数料 | | | 37,925 | | 44,194 |
| 広告宣伝費 | | | 768 | | 793 |
| 公告費 | | | 0 | | 0 |
| 受益証券発行費 | | | 5 | | 6 |
| 調査費 | | | 16,591 | | 20,794 |
| 調査費 | | 1,138 | | 1,250 | |
| 委託調査費 | | 15,453 | | 19,544 | |
| 委託計算費 | | | 903 | | 941 |
| 営業雑経費 | | | 2,616 | | 2,926 |
| 通信費 | | 199 | | 188 | |
| 印刷費 | | 1,057 | | 948 | |
| 協会費 | | 76 | | 76 | |
| 諸経費 | | 1,282 | | 1,712 | |
| 営業費用計 | | | 58,810 | | 69,656 |
| 一般管理費 | | | | | |
| 給料 | | | 10,039 | | 11,091 |
| 役員報酬 | ※2 | 229 | | 292 | |
| 給料・手当 | | 6,696 | | 6,823 | |
| 賞与 | | 3,114 | | 3,975 | |
| 交際費 | | | 122 | | 131 |
| 旅費交通費 | | | 446 | | 454 |
| 租税公課 | | | 289 | | 387 |
| 不動産賃借料 | | | 1,242 | | 1,212 |
| 退職給付費用 | | | 1,067 | | 1,069 |
| 固定資産減価償却費 | | | 4,106 | | 3,518 |
| 諸経費 | | | 6,273 | | 6,596 |
| 一般管理費計 | | | 23,589 | | 24,460 |
| 営業利益 | | | 9,347 | | 17,919 |

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月 31 日) | | 当事業年度 (自 平成25年 4 月 1 日 至 平成26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 | 3,002 | | 3,680 | |
| 収益分配金 | | 0 | | 0 | |
| 受取利息 | | 2 | | 3 | |
| 金銭の信託運用益 | | 1,016 | | 379 | |
| 為替差益 | | 43 | | - | |
| その他 | | 331 | | 336 | |
| 営業外収益計 | | | 4,396 | | 4,400 |
| 営業外費用 | | | | | |
| 支払利息 | ※ 1 | 56 | | 11 | |
| 時効後支払損引当金繰入額 | | 9 | | 24 | |
| その他 | | 78 | | 132 | |
| 営業外費用計 | | | 145 | | 169 |
| 経常利益 | | | 13,598 | | 22,151 |
| 特別利益 | | | | | |
| 投資有価証券等売却益 | | 59 | | - | |
| 株式報酬受入益 | | 160 | | 203 | |
| 固定資産売却益 | | 10 | | - | |
| 特別利益計 | | | 230 | | 203 |
| 特別損失 | | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 60 | | - | |
| 投資有価証券償還損 | | - | | 51 | |
| 投資有価証券評価損 | | 9 | | 2 | |
| 関係会社株式評価損 | | 2,916 | | 2,491 | |
| 固定資産除却損 | ※ 3 | 118 | | 17 | |
| 特別損失計 | | | 3,105 | | 2,562 |
| 税引前当期純利益 | | | 10,723 | | 19,792 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | | 3,765 | | 7,608 |
| 法人税等調整額 | | | 446 | | △90 |
| 当期純利益 | | | 6,510 | | 12,273 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

(単位：百万円)

| | 株主資本 | | | | | | | |
|-------------------------|--------|-----------|-----------------|-----------|------------|------------------|-----------------|----------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益 準備金 | 利益剰余金 | | | 株主 資本 合計 |
| | | 資本 準備金 | 資本 剰余金 合計 | | その他利益剰余金 | | 利益 剰余金 合計 | |
| | | | | | 別 途 積立金 | 繰 越 利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 11,729 | 11,729 | 685 | 24,606 | 14,320 | 39,611 | 68,521 |
| 当期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | △3,090 | △3,090 | △3,090 |
| 当期純利益 | | | | | | 6,510 | 6,510 | 6,510 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | — | — | — | — | — | 3,420 | 3,420 | 3,420 |
| 当期末残高 | 17,180 | 11,729 | 11,729 | 685 | 24,606 | 17,740 | 43,032 | 71,942 |

(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 | 繰延ヘッジ 損 益 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 2,693 | 12 | 2,705 | 71,227 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | △3,090 |
| 当期純利益 | | | | 6,510 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 1,965 | △43 | 1,922 | 1,922 |
| 当期変動額合計 | 1,965 | △43 | 1,922 | 5,342 |
| 当期末残高 | 4,659 | △30 | 4,628 | 76,570 |

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位：百万円)

| | 株主資本 | | | | | | | |
|---------------------|--------|--------|---------|-------|----------|---------|--------|---------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | | 株主資本合計 | |
| | | 資本準備金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | 利益剰余金合計 |
| | | | | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 11,729 | 11,729 | 685 | 24,606 | 17,740 | 43,032 | 71,942 |
| 当期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | △3,966 | △3,966 | △3,966 |
| 当期純利益 | | | | | | 12,273 | 12,273 | 12,273 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | — | — | — | — | — | 8,307 | 8,307 | 8,307 |
| 当期末残高 | 17,180 | 11,729 | 11,729 | 685 | 24,606 | 26,048 | 51,339 | 80,249 |

(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 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 4,659 | △30 | 4,628 | 76,570 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | △3,966 |
| 当期純利益 | | | | 12,273 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 2,020 | 30 | 2,051 | 2,051 |
| 当期変動額合計 | 2,020 | 30 | 2,051 | 10,358 |
| 当期末残高 | 6,679 | — | 6,679 | 86,929 |

[重要な会計方針]

| | | | | | | | | | |
|----------------------------|--|----|--------|------|-------|-----|-----|------|-------|
| <p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの … 移動平均法による原価法</p> | | | | | | | | |
| <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p> | <p>時価法</p> | | | | | | | | |
| <p>3. 固定資産の減価償却の方法</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、定額法によって おります。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0" data-bbox="751 701 1050 824"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェア については社内における利用可能期間に基づく定額法によっ ております。</p> | 建物 | 38～50年 | 附属設備 | 8～15年 | 構築物 | 20年 | 器具備品 | 4～15年 |
| 建物 | 38～50年 | | | | | | | | |
| 附属設備 | 8～15年 | | | | | | | | |
| 構築物 | 20年 | | | | | | | | |
| 器具備品 | 4～15年 | | | | | | | | |
| <p>4. 引当金の計上基準</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 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企 業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資 産の見込額に基づき計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付の算定にあたり、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、期間定額基準によって おります。</p> <p>② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の 従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法によ り、発生した事業年度の翌期から費用処理することとして おります。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事 業年度の翌期に一括して費用処理することとして おります。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その 発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額 法により、発生した事業年度から費用処理することとして おります。</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. 消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によって おり、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として 処理して おります。</p> | | | | | | | | |

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。

[未適用の会計基準等]

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

(1) 概要

未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充等について改正されました。

(2) 適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用します。

なお、当該会計基準等には経過的な取り扱いが定められているため、過去の期間の財務諸表に対しては遡及適用しません。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

[注記事項]

◇ 貸借対照表関係

| 前事業年度末 (平成25年3月31日) | 当事業年度末 (平成26年3月31日) | | | | | | | | | | | | |
|--|------------------------|----------|------|-------|--|-------|--|------|--------|------|-------|----|-------|
| <p>※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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払金</td> <td style="text-align: right;">2,368百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,584</td> </tr> </table> | 未払金 | 2,368百万円 | 未払費用 | 1,584 | <p>※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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払金</td> <td style="text-align: right;">4,601百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,607</td> </tr> </table> | 未払金 | 4,601百万円 | 未払費用 | 1,607 | | | | |
| 未払金 | 2,368百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 未払費用 | 1,584 | | | | | | | | | | | | |
| 未払金 | 4,601百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 未払費用 | 1,607 | | | | | | | | | | | | |
| <p>※2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">518百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,524</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,043</td> </tr> </table> | 建物 | 518百万円 | 器具備品 | 2,524 | 合計 | 3,043 | <p>※2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">565百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,849</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,414</td> </tr> </table> | 建物 | 565百万円 | 器具備品 | 2,849 | 合計 | 3,414 |
| 建物 | 518百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 器具備品 | 2,524 | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 3,043 | | | | | | | | | | | | |
| 建物 | 565百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 器具備品 | 2,849 | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 3,414 | | | | | | | | | | | | |

◇ 損益計算書関係

| 前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | 当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) |
|---|--|
| ※1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 2,922百万円 支払利息 44 | ※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 3,568百万円 支払利息 5 |
| ※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 建物 5百万円 器具備品 23 ソフトウェア 89 合計 118 | ※3. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 6 ソフトウェア 11 合計 17 |

◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25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24年5月16日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 3,090百万円

1株当たり配当額 600円

基準日 平成24年3月31日

効力発生日 平成24年6月1日

(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25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 3,966百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 770円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月21日

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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25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 3,966百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 770円

基準日 平成25年3月31日

効力発生日 平成25年6月21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

◇ 金融商品関係

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成25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 | 333 | 333 | - |
| (2)金銭の信託 | 51,061 | 51,061 | - |
| (3)未収委託者報酬 | 8,651 | 8,651 | - |
| (4)有価証券及び投資有価証券 | | | |
| その他有価証券 | 12,678 | 12,678 | - |
| (5)関係会社株式 | 3,064 | 104,822 | 101,758 |
| 資産計 | 75,789 | 177,548 | 101,758 |
| (6)短期借入金 | 3,000 | 3,000 | - |
| (7)関係会社短期借入金 | 2,000 | 2,000 | - |
| (8)未払金 | 6,481 | 6,481 | - |
| 未払収益分配金 | 3 | 3 | - |
| 未払償還金 | 42 | 42 | - |
| 未払手数料 | 3,764 | 3,764 | - |
| その他未払金 | 2,671 | 2,671 | - |
| (9)未払費用 | 6,979 | 6,979 | - |
| (10)未払法人税等 | 763 | 763 | - |
| 負債計 | 19,224 | 19,224 | - |
| (11)デリバティブ取引(*) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | - | - | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | 3 | 3 | - |
| デリバティブ取引計 | 3 | 3 | - |

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

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

(1) 現金・預金、(3)未収委託者報酬

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

(2) 金銭の信託

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

(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、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

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

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

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券883百万円、関係会社株式9,028百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について2,916百万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 | 333 | - | - | - |
| 金銭の信託 | 51,061 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 8,651 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | 4,500 | - | - | - |
| 合計 | 64,547 | - | - | - |

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銭信託を通じ保有しております。特定金銭信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26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 | 247 | 247 | - |
| (2) 金銭の信託 | 51,758 | 51,758 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 10,741 | 10,741 | - |
| (4) 有価証券及び投資有価証券 | | | |
| その他有価証券 | 22,467 | 22,467 | - |
| (5) 関係会社株式 | 3,064 | 141,441 | 138,377 |
| 資産計 | 88,278 | 226,656 | 138,377 |
| (6) 未払金 | 9,720 | 9,720 | - |
| 未払収益分配金 | 2 | 2 | - |
| 未払償還金 | 33 | 33 | - |
| 未払手数料 | 4,493 | 4,493 | - |
| その他未払金 | 5,191 | 5,191 | - |
| (7) 未払費用 | 8,420 | 8,420 | - |
| (8) 未払法人税等 | 1,960 | 1,960 | - |
| 負債計 | 20,100 | 20,100 | - |

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、(3) 未収委託者報酬

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

(2) 金銭の信託

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

(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ります。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

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

(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1,080百万円、関係会社株式6,545百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について2,494百万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 | 247 | - | - | - |
| 金銭の信託 | 51,758 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 10,741 | - | - | - |
| 有価証券 | 11,800 | - | - | - |
| 合計 | 74,547 | - | - | - |

◇ 有価証券関係

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 売買目的有価証券(平成25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25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25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 | 104,822 | 101,758 |
| 合計 | 3,064 | 104,822 | 101,758 |

4. その他有価証券(平成25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 | 7,534 | 282 | 7,251 |
| 小計 | 7,534 | 282 | 7,251 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託(※1) | 644 | 645 | △0 |
| 譲渡性預金 | 4,500 | 4,500 | — |
| 小計 | 5,144 | 5,145 | △0 |
| 合計 | 12,678 | 5,427 | 7,250 |

(※1) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ損失は30百万円（税効果会計適用後）であり、貸借対照表に計上しております。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成24年4月1日 至 平成25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 | 21 | 6 | — |
| 投資信託 | 708 | — | 60 |
| 合計 | 730 | 6 | 60 |

当事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 売買目的有価証券(平成26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26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26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 | 141,441 | 138,377 |
| 合計 | 3,064 | 141,441 | 138,377 |

4. その他有価証券(平成26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 | 10,667 | 282 | 10,384 |
| 小計 | 10,667 | 282 | 10,384 |
| 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 | 11,800 | 11,800 | — |
| 小計 | 11,800 | 11,800 | — |
| 合計 | 22,467 | 12,082 | 10,384 |

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自平成25年4月1日 至平成26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 | — | — | — |
| 投資信託 | 761 | — | 51 |
| 合計 | 761 | — | 51 |

(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。

◇ 退職給付関係

| 前事業年度(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日) | |
|---|---|
| 1. 採用している退職給付制度の概要 | |
| 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。 | |
| 2. 退職給付債務に関する事項(平成25年 3 月31日) | |
| イ. 退職給付債務 | △15,209百万円 |
| ロ. 年金資産 | 12,456 |
| ハ. 未積立退職給付債務(イ+ロ) | △2,752 |
| ニ. 会計基準変更時差異の未処理額 | — |
| ホ. 未認識数理計算上の差異 | 2,471 |
| ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額) | △532 |
| ト. 貸借対照表計上額純額(ハ+ニ+ホ+ヘ) | △813 |
| チ. 前払年金費用 | — |
| リ. 退職給付引当金(ト-チ) | △813 |
| 3. 退職給付費用に関する事項(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日) | |
| イ. 勤務費用 | 608百万円 |
| ロ. 利息費用 | 251 |
| ハ. 期待運用収益 | △237 |
| ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額 | — |
| ホ. 数理計算上の差異の費用処理額 | 304 |
| ヘ. 過去勤務債務の費用処理額 | △40 |
| ト. 退職給付費用(イ+ロ+ハ+ニ+ホ+ヘ) | 885 |
| チ. その他(注) | 170 |
| 計 | 1,055 |
| (注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。 | |
| 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 | |
| イ. 退職給付見込額の期間配分方法 | 期間定額基準 |
| ロ. 割引率 | 1.5% |
| ハ. 期待運用収益率 | 2.5% |
| ニ. 過去勤務債務の額の処理年数 | 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。) |
| ホ. 数理計算上の差異の処理年数 | (1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。) |
| ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数 | 該当はありません。 |

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | |
|--------------------|---------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 15,209 百万円 |
| 勤務費用 | 750 |
| 利息費用 | 228 |
| 数理計算上の差異の発生額 | △25 |
| 退職給付の支払額 | △494 |
| その他 | 11 |
| <u>退職給付債務の期末残高</u> | <u>15,680</u> |

(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 | 12,456 百万円 |
| 期待運用収益 | 311 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 428 |
| 事業主からの拠出額 | 2,065 |
| 退職給付の支払額 | △475 |
| <u>年金資産の期末残高</u> | <u>14,786</u> |

(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 | 13,485 百万円 |
| 年金資産 | △14,786 |
| | △1,301 |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 2,194 |
| 未積立退職給付債務 | 893 |
| 未認識数理計算上の差異 | △1,733 |
| 未認識過去勤務費用 | 492 |
| <u>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</u> | <u>△347</u> |
| 前払年金費用 | △347 |
| <u>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</u> | <u>△347</u> |

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | |
|------------------------|------------|
| 勤務費用 | 750 百万円 |
| 利息費用 | 228 |
| 期待運用収益 | △311 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 284 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | △40 |
| その他 | △12 |
| <u>確定給付制度に係る退職給付費用</u> | <u>899</u> |

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

| | |
|--------|------|
| 債券 | 30% |
| 株式 | 18% |
| 受益証券等 | 14% |
| 生保一般勘定 | 19% |
| その他 | 19% |
| 合計 | 100% |

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | |
|-----------|------|
| 割引率 | 1.6% |
| 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、170百万円でした。

◇ 税効果会計関係

| 前事業年度末 (平成25年3月31日) | 当事業年度末 (平成26年3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---|-------|--------------------|-------|----------------------|--------|--------------|------|------------|------|--------|-------|----------------------|-----|-----------|-------|----------|-------|-------------------|-------|---|------------|---------|--------------------|---------|----------------------|-------|---------|----------|------------|--------|--------|---------|----------------------|--------|-----------|-----------|-------|--------|-------------------|---------|-------|------------|-----|--|--------|-----|-----------|-------|-------|-------|--------------|-----|-----------|-----|-------|-----|-----------|-----|---------|-----|----------|-----|----------|-----|---------|-----|---------|---|---------|---|-----|-----|----------|-------|--------|--------|---------|-------|--------|--|-----------|-------|--------|-----|---------|-------|------------|-------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">百万円</td> </tr> <tr> <td> 関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">1,050</td> </tr> <tr> <td> 賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">1,181</td> </tr> <tr> <td> 所有株式税務簿価通算差異</td> <td style="text-align: right;">776</td> </tr> <tr> <td> 投資有価証券評価減</td> <td style="text-align: right;">501</td> </tr> <tr> <td> 未払事業税</td> <td style="text-align: right;">184</td> </tr> <tr> <td> ゴルフ会員権評価減</td> <td style="text-align: right;">408</td> </tr> <tr> <td> 減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">208</td> </tr> <tr> <td> 時効後支払引当金</td> <td style="text-align: right;">178</td> </tr> <tr> <td> 子会社株式売却損</td> <td style="text-align: right;">172</td> </tr> <tr> <td> 未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">90</td> </tr> <tr> <td> 退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">292</td> </tr> <tr> <td> 繰延ヘッジ損失</td> <td style="text-align: right;">18</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">124</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">5,189</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">△2,704</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,485</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td> 有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">2,620</td> </tr> <tr> <td> 前払年金費用</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,620</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債(純額)</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">135</td> </tr> </table> | 繰延税金資産 | 百万円 | 関係会社株式評価減 | 1,050 | 賞与引当金 | 1,181 | 所有株式税務簿価通算差異 | 776 | 投資有価証券評価減 | 501 | 未払事業税 | 184 | ゴルフ会員権評価減 | 408 | 減価償却超過額 | 208 | 時効後支払引当金 | 178 | 子会社株式売却損 | 172 | 未払社会保険料 | 90 | 退職給付引当金 | 292 | 繰延ヘッジ損失 | 18 | その他 | 124 | 繰延税金資産小計 | 5,189 | 評価性引当金 | △2,704 | 繰延税金資産計 | 2,485 | 繰延税金負債 | | 有価証券評価差額金 | 2,620 | 前払年金費用 | - | 繰延税金負債計 | 2,620 | 繰延税金負債(純額) | 135 | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">百万円</td> </tr> <tr> <td> 関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">1,947</td> </tr> <tr> <td> 賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">1,434</td> </tr> <tr> <td> 所有株式税務簿価通算差異</td> <td style="text-align: right;">776</td> </tr> <tr> <td> 投資有価証券評価減</td> <td style="text-align: right;">502</td> </tr> <tr> <td> 未払事業税</td> <td style="text-align: right;">425</td> </tr> <tr> <td> ゴルフ会員権評価減</td> <td style="text-align: right;">408</td> </tr> <tr> <td> 減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">206</td> </tr> <tr> <td> 時効後支払引当金</td> <td style="text-align: right;">181</td> </tr> <tr> <td> 子会社株式売却損</td> <td style="text-align: right;">172</td> </tr> <tr> <td> 未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">100</td> </tr> <tr> <td> 退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td> 繰延ヘッジ損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">126</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">6,284</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">△3,602</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,681</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td> 有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">3,757</td> </tr> <tr> <td> 前払年金費用</td> <td style="text-align: right;">125</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,882</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債(純額)</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,200</td> </tr> </table> | 繰延税金資産 | 百万円 | 関係会社株式評価減 | 1,947 | 賞与引当金 | 1,434 | 所有株式税務簿価通算差異 | 776 | 投資有価証券評価減 | 502 | 未払事業税 | 425 | ゴルフ会員権評価減 | 408 | 減価償却超過額 | 206 | 時効後支払引当金 | 181 | 子会社株式売却損 | 172 | 未払社会保険料 | 100 | 退職給付引当金 | - | 繰延ヘッジ損失 | - | その他 | 126 | 繰延税金資産小計 | 6,284 | 評価性引当金 | △3,602 | 繰延税金資産計 | 2,681 | 繰延税金負債 | | 有価証券評価差額金 | 3,757 | 前払年金費用 | 125 | 繰延税金負債計 | 3,882 | 繰延税金負債(純額) | 1,200 |
| 繰延税金資産 | 百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 関係会社株式評価減 | 1,050 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金 | 1,181 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 所有株式税務簿価通算差異 | 776 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券評価減 | 501 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 184 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ゴルフ会員権評価減 | 408 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減価償却超過額 | 208 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 時効後支払引当金 | 178 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 子会社株式売却損 | 172 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払社会保険料 | 90 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 292 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延ヘッジ損失 | 18 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 124 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産小計 | 5,189 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当金 | △2,704 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産計 | 2,485 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券評価差額金 | 2,620 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 前払年金費用 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債計 | 2,620 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債(純額) | 135 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産 | 百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 関係会社株式評価減 | 1,947 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金 | 1,434 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 所有株式税務簿価通算差異 | 776 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券評価減 | 502 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 425 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ゴルフ会員権評価減 | 408 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減価償却超過額 | 206 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 時効後支払引当金 | 181 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 子会社株式売却損 | 172 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払社会保険料 | 100 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延ヘッジ損失 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 126 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産小計 | 6,284 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当金 | △3,602 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産計 | 2,681 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券評価差額金 | 3,757 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 前払年金費用 | 125 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債計 | 3,882 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債(純額) | 1,200 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率(調整)</td> <td style="text-align: right;">38.0%</td> </tr> <tr> <td> 交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.5%</td> </tr> <tr> <td> 受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">△10.1%</td> </tr> <tr> <td> 住民税等均等割</td> <td style="text-align: right;">0.0%</td> </tr> <tr> <td> タックスヘイブン税制</td> <td style="text-align: right;">2.1%</td> </tr> <tr> <td> 外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">△0.0%</td> </tr> <tr> <td> 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td> 関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">10.3%</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">△1.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">39.2%</td> </tr> </table> | 法定実効税率(調整) | 38.0% | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.5% | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | △10.1% | 住民税等均等割 | 0.0% | タックスヘイブン税制 | 2.1% | 外国税額控除 | △0.0% | 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | - | 関係会社株式評価減 | 10.3% | その他 | △1.6% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 39.2% | <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率(調整)</td> <td style="text-align: right;">38.0%</td> </tr> <tr> <td> 交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.4%</td> </tr> <tr> <td> 受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">△6.7%</td> </tr> <tr> <td> 住民税等均等割</td> <td style="text-align: right;">0.0%</td> </tr> <tr> <td> タックスヘイブン税制</td> <td style="text-align: right;">1.4%</td> </tr> <tr> <td> 外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">△0.3%</td> </tr> <tr> <td> 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">0.5%</td> </tr> <tr> <td> 関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">4.7%</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">△0.1%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">37.9%</td> </tr> </table> | 法定実効税率(調整) | 38.0% | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.4% | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | △6.7% | 住民税等均等割 | 0.0% | タックスヘイブン税制 | 1.4% | 外国税額控除 | △0.3% | 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | 0.5% | 関係会社株式評価減 | 4.7% | その他 | △0.1% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 37.9% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 法定実効税率(調整) | 38.0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.5% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | △10.1% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 住民税等均等割 | 0.0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| タックスヘイブン税制 | 2.1% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外国税額控除 | △0.0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 関係会社株式評価減 | 10.3% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | △1.6% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 39.2% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 法定実効税率(調整) | 38.0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.4% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | △6.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 住民税等均等割 | 0.0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| タックスヘイブン税制 | 1.4% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外国税額控除 | △0.3% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | 0.5% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 関係会社株式評価減 | 4.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | △0.1% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 37.9% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | <p>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</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26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、前事業年度の38%から36%に変更されております。</p> <p>この変更により、繰延税金負債の純額が111百万円増加し、法人税等調整額(貸方)は111百万円減少しております。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

◇ セグメント情報等

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

◇ 関連当事者情報

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|----------------|--------|------------------|-----------|-------------------|----------------------|-----------|-----------|-------|-----------|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492 (百万円) | 持株会社 | (被所有)直接 100.0% | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の借入(*1) | 59,500 | 短期借入金 | 2,000 |
| | | | | | | | 資金の返済 | 66,000 | | |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 44 | 未払費用 | 0 |

(イ) 子会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|------|-------------|---------|-----------------|-----------|-----------------|------------|-----------------------|-----------|------|-----------|
| 関連会社 | 株式会社野村総合研究所 | 東京都千代田区 | 18,600 (百万円) | 情報サービス業 | (所有)直接 21.6% | サービス・製品の購入 | 自社利用のソフトウェア開発の委託等(*2) | 4,433 | 未払費用 | 706 |

(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 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3) | 30,983 | 未払手数料 | 3,105 |
| 親会社の子会社 | 野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 400 (百万円) | 投資顧問業 | — | 当社投資信託の運用委託 役員の兼任 | 投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*4) | 1,941 | 未払費用 | 827 |
| 親会社の子会社 | 野村信託銀行株式会社 | 東京都千代田区 | 30,000 (百万円) | 信託銀行業 | — | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の借入(*1) | 3,000 | 短期借入金 | 3,000 |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 12 | 未払費用 | — |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
- (*2) 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。
- (*3) 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。
- (*4) 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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は㈱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 | 173,289 |
| 固定資産合計 | 239,585 |
| 流動負債合計 | 119,860 |
| 固定負債合計 | 20,742 |
| 純資産合計 | 272,272 |
| 売上高 | 337,340 |
| 税引前当期純利益 | 34,116 |
| 当期純利益 | 21,546 |

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|----------------|--------|------------------|-----------|-------------------|----------------------|-----------|-----------|-------|-----------|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492 (百万円) | 持株会社 | (被所有)直接 100.0% | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の借入(*1) | 8,000 | 短期借入金 | - |
| | | | | | | | 資金の返済 | 10,000 | | |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 5 | 未払費用 | - |

(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 21.5% | 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(*2) | 5,073 | 未払費用 | 716 |

(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(*3) | 36,867 | 未払手数料 | 3,854 |
| 親会社の子会社 | 野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 400 (百万円) | 投資顧問業 | — | 当社投資信託の運用委託 役員の兼任 | 投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*4) | 1,959 | 未払費用 | 760 |
| 親会社の子会社 | 野村信託銀行株式会社 | 東京都千代田区 | 30,000 (百万円) | 信託銀行業 | — | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の返済 | 3,000 | 短期借入金 | - |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 6 | 未払費用 | - |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
- (*2) 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。
- (*3) 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。
- (*4) 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 | 191,892 |
| 固定資産合計 | 249,548 |
| 流動負債合計 | 84,950 |
| 固定負債合計 | 55,262 |
| 純資産合計 | 301,227 |
| 売上高 | 355,777 |
| 税引前当期純利益 | 47,854 |
| 当期純利益 | 28,759 |

◇ 1株当たり情報

| 前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | | 当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | |
|--|------------|--|------------|
| 1株当たり純資産額 | 14,866円12銭 | 1株当たり純資産額 | 16,877円25銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 1,264円08銭 | 1株当たり当期純利益 | 2,382円87銭 |
| <p>潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。</p> <p>1株当たり当期純利益の算定上の基礎</p> <p>損益計算書上の当期純利益 6,510百万円</p> <p>普通株式に係る当期純利益 6,510百万円</p> <p>普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。</p> <p>普通株式の期中平均株式数 5,150,693株</p> | | <p>潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。</p> <p>1株当たり当期純利益の算定上の基礎</p> <p>損益計算書上の当期純利益 12,273百万円</p> <p>普通株式に係る当期純利益 12,273百万円</p> <p>普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。</p> <p>普通株式の期中平均株式数 5,150,693株</p> | |

4【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

(野村インデックスファンド・国内債券)

運用の基本方針

約款第18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いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内債券 NOMURA-BPI 総合 マザーファンド (以下「マザーファンド」といいます。) 受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。

(2) 投資態度

- ① マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ② 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換および新株予約権 (転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り) を行使したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ② 外貨建資産への投資は行いません。
- ③ 有価証券先物取引等は約款第21条の範囲で行いません。
- ④ スワップ取引は約款第22条の範囲で行いません。
- ⑤ 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑥ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

3. 収益分配方針

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。

- ① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。
- ③ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

追加型証券投資信託
野村インデックスファンド・国内債券
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。

(信託の目的と金額)

第2条 委託者は、金1,000万円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金1兆円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第43条第1項、第44条第1項、第45条第1項および第47条第2項の規定による解約の日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については1,000万口を上限とし、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第25条に規定する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従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（以下「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た金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、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、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。

③ 委託者は、第7条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、第2条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 販売会社（委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および委託者の指定する登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）をいいます。以下同じ。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口単位もしくは1口の整数倍となる販売会社が定める単位をもって取得申込に応じることができるものとします。

② 前項の場合の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、販売会社がそれぞれ独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1口につき1円に、販売会社がそれぞれ独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

③ 前項の規定にかかわらず、受益者が第39条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、取得申込日の基準価額とします。

④ 第1項の取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金（第2項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該

取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込の受け付けを取り消すことができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による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。

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条及び第22条に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第16条 委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式

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

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を含みます。なお、社債券のうち、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、ならびに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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
5. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
6. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
7. 転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得した株券
8. コマーシャル・ペーパー
9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
10. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
11. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
12. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
13. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
14. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

② 委託者は、信託金を、前項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(前項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

③ 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えること

となる投資の指図をしません。

(利害関係人等との取引等)

第 17 条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であつて、受託者が当該第三者の代理人となつて行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第 26 条において同じ。））、第 26 条第 1 項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前 2 条に掲げる資産への投資等ならびに第 24 条、第 25 条および第 31 条に掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第 31 条の 4 第 3 項および同条第 4 項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、前 2 条に掲げる資産への投資等ならびに第 24 条、第 25 条および第 31 条に掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

④ 前 3 項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第 31 条第 3 項および同法第 32 条第 3 項の通知は行ないません。

(運用の基本方針)

第 18 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。

(投資する株式の範囲)

第 19 条 委託者が投資することを指図する株式は、わが国の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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

(同一銘柄の株式への投資制限)

第 20 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第 21 条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。））、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるも

のをいいます。以下同じ。) および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利に係るこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額がヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

② 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、原則として第4条に定める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。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額と

の合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤ 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。

⑥ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第 23 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第 24 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の 50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の 50%を超えないものとします。

② 前項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。

③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(公社債の借入れ)

第 25 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

② 前項の指図は、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。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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。

④ 第 1 項の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

(信託業務の委託等)

第 26 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含み

ます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第27条 金融機関または第一種金融商品取引業者等(外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者を含みます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第28条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第29条 委託者は、信託財産に属する親投資信託の受益証券にかかる信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第30条 委託者は、前条の規定による親投資信託の受益証券の一部解約金、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収

入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第31条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

② 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

③ 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。

④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第32条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第33条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第34条 この信託の計算期間は、毎年9月7日から翌年9月6日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は、信託契約締結日から平成23年9月6日までとします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第35条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③ 受託者は、前2項の報告を行なうことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行なわないこととします。

④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査費用)

第36条 信託財産に関する租税、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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額)

第37条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第34条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の40の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、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信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第38条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第39条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記

載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。)に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、販売会社との累積投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行ないます。当該売付けにより増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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(信託終了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、当該信託終了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します。)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

④ 一部解約金(第42条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。)は、第42条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項(第2項を除きます。)に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとしします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしします。

(収益分配金および償還金の時効)

第40条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第41条 受託者は、収益分配金については第39条第1項に規定する支払開始日までに、償還金については第39条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第39条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(信託の一部解約)

第42条 受益者(販売会社を含みます。以下本条において同じ。)は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位もしくは1口の整数倍となる販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して

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

③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。

④ 一部解約の実行の請求を受益者がするとき、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。

⑤ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による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ことができます。

⑥ 前項により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第3項の規定に準じて計算された価額とします。

(信託契約の解約)

第43条 委託者は、信託期間中において、信託契約締結日から3年を経過した日以降において、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またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③ 前項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。以下本項において同じ。）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。

④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

⑤ 第2項から前項までの規定は、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、第2項から前項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。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第44条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第48条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第45条 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。

② 前項の規定にかかわらず、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を引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第48条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。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第46条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第47条 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、第48条の規定にしたがい、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。

② 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。

(信託約款の変更等)

第48条 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。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知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。

③ 前項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。以下本項において同じ。）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。

④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であつて、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

- ⑤ 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。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、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。
- ⑦ 前各項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。

(反対者の買取請求権)

第49条 第43条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求の内容および買取請求の手續に関する事項は、第43条第2項または前条第2項に規定する書面に付記します。

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第50条 この信託の受益者は、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

(公告)

第51条 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/>

② 前項の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。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第52条 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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第53条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付則)

第1条 第39条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成 22 年 11 月 26 日

東京都中央区日本橋一丁目 12 番 1 号
委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目 2 番 2 号
受託者 野村信託銀行株式会社

(国内債券 NOMURA-BPI 総合 マザーファンド)

運用の基本方針

約款第 13 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果を目指します。

② 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資は行ないません。

② 外貨建資産への投資は行ないません。

③ 有価証券先物取引等は約款第 14 条の範囲で行ないます。

④ スワップ取引は約款第 15 条の範囲で行ないます。

親投資信託
国内債券 NOMURA-BPI 総合 マザーファンド
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下特段の記載があるものを除き「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金50億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、金1兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第33条第1項、第33条第2項、第36条第1項、第37条第1項および第39条第2項の規定による解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第4条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第2号イに掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第4条第2項第12号で定める適格機関投資家私募により行なわれます。

(受益者)

第5条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする野村アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項による受益権については、50億円を上限に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 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ます。

(追加信託金の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用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従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（以下「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た金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

- ② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。
- ③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

- ② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行ないます。

(投資の対象とする資産の種類)

第11条 この信託において投資の対象とする資産(本邦通貨表示のものに限るものとし、かつ、株式、出資証券、投資証券およびその他の資産でこれらの性質を有するものを除きます。)の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

- イ. 有価証券
- ロ. デリバティブ取引(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条及び第15条に定めるものに限ります。)に係る権利
- ハ. 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)
- ニ. 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ. (削除)
- ロ. 為替手形
- ハ. (削除)

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第12条 委託者は、信託金を、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

- 1. 国債証券
- 2. 地方債証券
- 3. 特別の法律により法人の発行する債券
- 4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債券については、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、ならびに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(総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))に限ります。)
- 5. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

7. コマーシャル・ペーパー

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券の性質を有するもの

9. 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。）

10. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第13条第2号イ（3）に定めるものに限る）

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

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

13. 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号から第6号までの証券および第8号の証券のうち第1号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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（前項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

(運用の基本方針)

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。なお、この信託約款において、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以下「金融商品取引所」といい、また、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以下「証券取引所」という場合があります。

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第14条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利に係るこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第15条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

② 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、原則として第3条に定める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。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ 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。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第16条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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。

② 前項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。

③ 委託者は、公社債の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(保管業務の委任)

第17条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第18条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第19条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマースヤル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第20条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第21条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第22条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第23条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第24条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第25条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第26条 この信託の計算期間は、毎年4月1日から翌年3月31日までとするを原則とします。ただし、第1計算期間は平成14年7月25日から平成15年3月31日までとします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下本項において「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、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第27条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第28条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬)

第29条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第30条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、中には分配を行ないません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第31条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託金にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(信託の一部解約)

第32条 委託者は受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

② 解約金は、一部解約を行なう日の前営業日の基準価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた金額とします。

(信託契約の解約)

第33条 委託者は、信託期間中において、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。

② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③ 委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託を解約する場合には適用しません。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第34条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払いの時期)

第35条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第36条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第40条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第 37 条 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。

② 前項の規定にかかわらず、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、第 40 条第 4 項の規定に該当する場合を除き、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。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 38 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 39 条 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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、第 40 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

② 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。

(信託約款の変更)

第 40 条 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ができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第 41 条 第 33 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第 33 条第 4 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第 33 条第 3 項または前条第 2 項に規定する公告または書面に付記します。

(利益相反のおそれがある場合の受益者への書面の交付)

第 42 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 13 条第 1 項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第 43 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条に定める運用報告書を交付しません。

(公告)

第 44 条 委託者が行なう公告は、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/>

② 前項の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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第 45 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成 14 年 7 月 25 日

東京都中央区日本橋一丁目 12 番 1 号

委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目 2 番 2 号

受託者 野村信託銀行株式会社