

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月13日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O 兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ノムラ・ボンド＆ローン・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2019年11月12日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2 【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況
第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

（3）ファンドの仕組み

<更新後>

委託会社の概況(2020年3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

1959年12月1日 野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村
アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2 投資方針

（4）分配方針

<訂正前>

年6回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき安定的な分配を行なうことを基本とします。

分配対象額の範囲は、当期中の経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

各期の分配額は、基準価額水準にかかわらず原則として利子・配当収入等の範囲内で委託者が決定します。ただし、基準価額水準等によっては、上記 の範囲内で、売買益等を分配する場合があります。

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

利子・配当収入とは、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たるため、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。

ファンドは目標分配額を定めておりますが、各期中の利子・配当収入等が目標分配額に満たなかった場合には、目標分配額の分配ができない場合があります。

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

ファンドの決算日

原則として毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各15日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

分配金のお支払い

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

目標分配額

2019年10月9日現在の金利水準、想定されるポートフォリオのインカム収入等を基に委託会社が設定した1万口当たりの目標分配額は、以下の通りです。

	第121期 (2019年11月16日 ~ 2020年1月15日まで)	第122期 (2020年1月16日 ~ 2020年3月16日まで)	第123期 (2020年3月17日 ~ 2020年5月15日まで)
目標分配額	20円	20円	20円

（注）委託会社は各期中において上記の目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本としますが、各期末において目標分配額通りの分配が実現されることを保証するものではありません。

分配金額は分配方針に基づき、委託会社が決定します。したがって、実際の分配金額は目標分配額を上回ったり下回ったりする可能性があります。

各期の目標分配額は、あくまでも委託会社の予想に基づく分配金額の目安を示すものであり、ファンドの一定利回りを保証するものでも示唆するものではありません。目標分配額および実際の分配金額の如何に関わらず、ファンドの利回りは期中及び各期末の基準価額によって変動しますので、あらかじめ予想できるものではありません。

分配金に関する留意点

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。

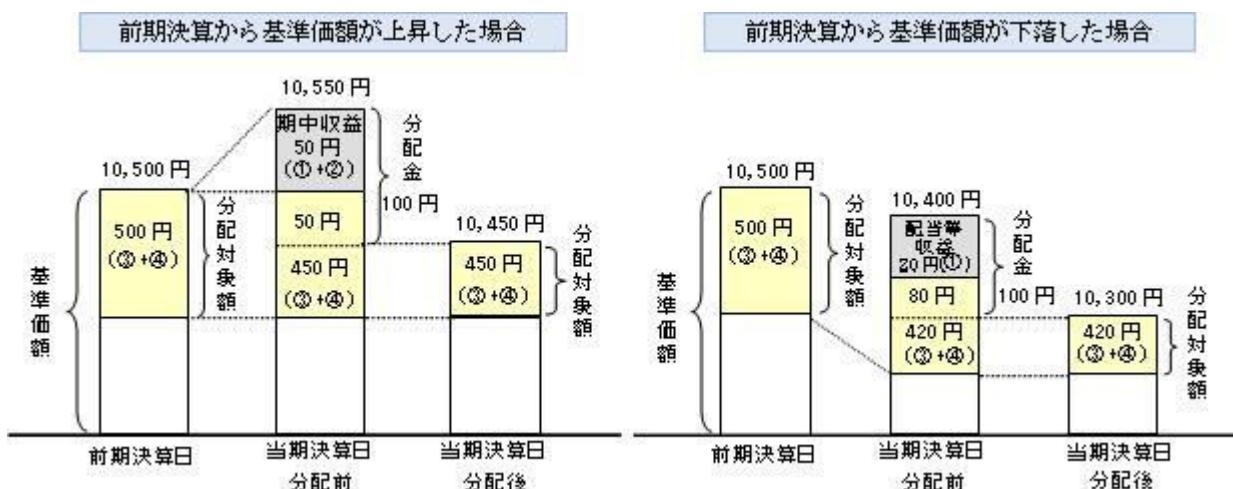


ファンダムは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンダムの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンダムの収益率を示唆するものではありません。

・計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

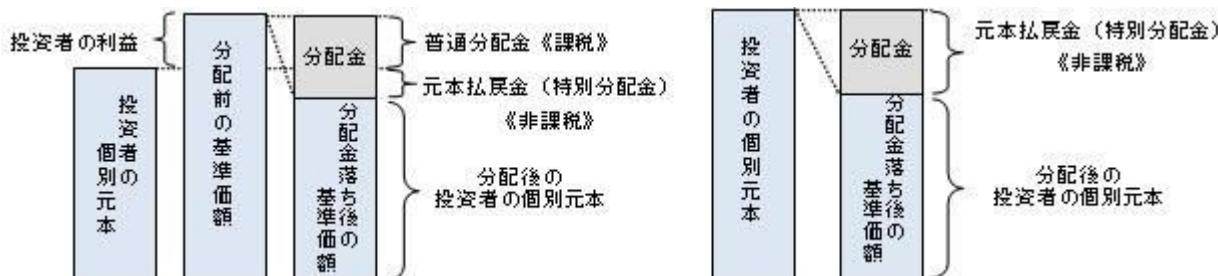
分配対象額とは、経費控除後の配当等収益 経費控除後の評価益を含む売買益 分配準備積立金 収益調整金です。



投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部戻しに相当する場合があります。ファンダム購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

普通分配金・・・ 分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本と同額の場合または投資者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。

元本戻し金・・・ 分配金落ち後の基準価額が投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本戻し金（特別分配金）となります。



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

（注）普通分配金に対する課税については、後述の「4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご覧ください。

上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額について示唆、保証するものではありません。

<訂正後>

年6回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき安定的な分配を行なうことを基本とします。

分配対象額の範囲は、当期中の経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

各期の分配額は、基準価額水準にかかわらず原則として利子・配当収入等の範囲内で委託者が決定します。ただし、基準価額水準等によっては、上記 の範囲内で、売買益等を分配する場合があります。

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

利子・配当収入とは、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。

ファンドは目標分配額を定めておりますが、各期中の利子・配当収入等が目標分配額に満たなかった場合には、目標分配額の分配ができない場合があります。

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

ファンドの決算日

原則として毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各15日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

分配金のお支払い

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

目標分配額

2020年4月8日現在の金利水準、想定されるポートフォリオのインカム収入等を基に委託会社が設定した1万口当りの目標分配額は、以下の通りです。

	第124期 (2020年5月16日～ 2020年7月15日まで)	第125期 (2020年7月16日～ 2020年9月15日まで)	第126期 (2020年9月16日～ 2020年11月16日まで)
目標分配額	40円	40円	40円

(注) 委託会社は各期中において上記の目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本としますが、各期末において目標分配額通りの分配が実現されることを保証するものではありません。

分配金額は分配方針に基づき、委託会社が決定します。したがって、実際の分配金額は目標分配額を上回ったり下回ったりする可能性があります。

各期の目標分配額は、あくまでも委託会社の予想に基づく分配金額の目安を示すものであり、ファンドの一定利回りを保証するものでも示唆するものではありません。目標分配額および実際の分配金額の如何に関わらず、ファンドの利回りは期中及び各期末の基準価額によって変動しますので、あらかじめ予想できるものではありません。

分配金に関する留意点

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。

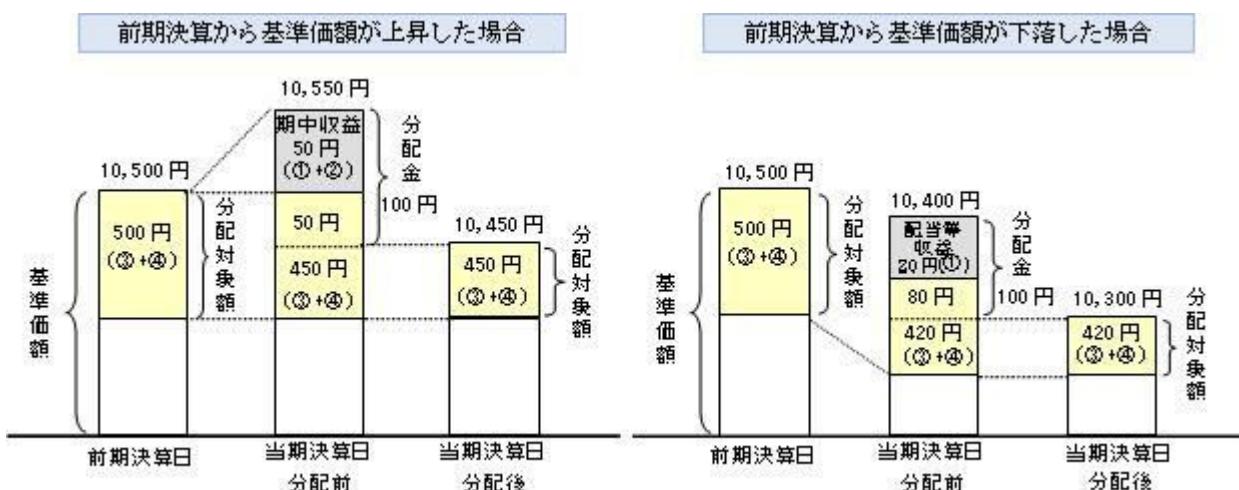


ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

・計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

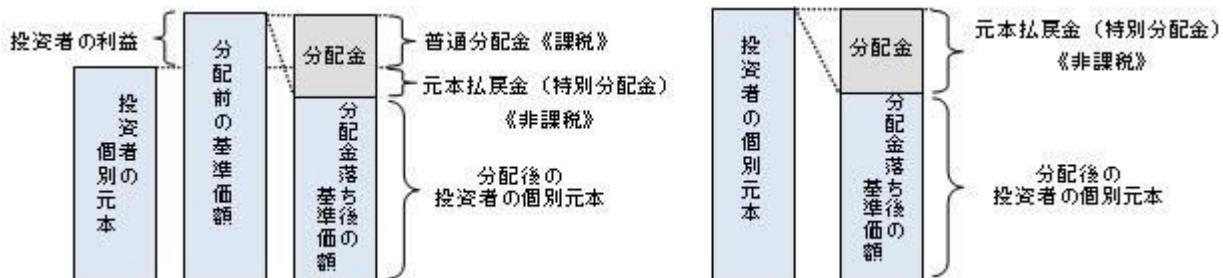
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

分配対象額とは、経費控除後の配当等収益 経費控除後の評価益を含む売買益 分配準備積立金 収益調整金です。



投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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



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

(注) 普通分配金に対する課税については、後述の「4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。

上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額について示唆、保証するものではありません。

3 投資リスク

<更新後>

■ リスクの定量的比較 (2015年4月末~2020年3月末:月次)



* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2015年4月末を10,000として指標化しております。

* 年間騰落率は、2015年4月から2020年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

* 2015年4月から2020年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

* 決算日に対応した数値とは異なります。

* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

<代表的な資産クラスの指標>

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

○先進国株：MSCI-KOKUSAI指標（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI 国債

○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）

新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指標の著作権等について ■

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

○MSCI-KOKUSAI 指標（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指標（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指標です。同指標に対する著作権、知的所有権その他の一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指標の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

○NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに問じ一切責任を負いません。

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

○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）（ここでは「指標」とよびます）についてここに提供された情報は、指標のレベルも含め、但しそれに割り切ることなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、得らかの売買の公式なコンファームーション、或いは指標に開港する何らかの商品の価値や価額を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものとと考えられます。JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JP Morgan）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は適切なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JP Morgan やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメークを行ったりすることがあります。また、発行体の引受け人、ブレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。

米国の JP Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指標スパンサー」）は、指標に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保証または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指標に達成させる或いはそれを目的とする取引の可否について、指標スパンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または承認を行なうものではありません。指標スパンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指標は信頼できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指標に付随する情報について保証するものではありません。指標は指標スパンサーが保有する財産であり、その財産はすべて指標スパンサーに帰属します。

JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPM, J.P. Morgan Securities Plc.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4 手数料等及び税金

（5）課税上の取扱い

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除は適用されません。

<換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税>

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

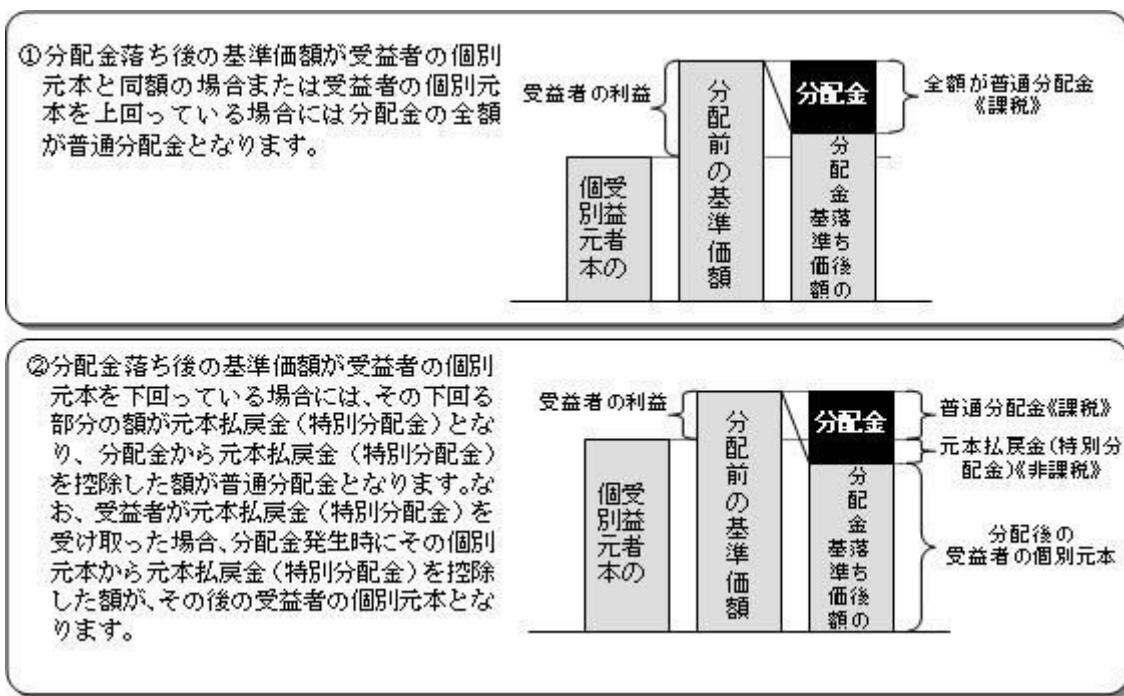
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

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



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

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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2020年3月末現在）が変更になる場合があります。

5 運用状況

以下は2020年3月31日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	12,207,489	0.33
	イギリス	1,720,237	0.04
	小計	13,927,726	0.38
社債券	アメリカ	2,168,873,224	59.29
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,475,072,755	40.32
合計（純資産総額）		3,657,873,705	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り貸付債権を組入れてあります。

なお、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。

資産の種類	国 / 地域	数量	時価（円）	投資比率（%）
貸付債権	アメリカ	16,035,168.43	1,372,557,130	37.52

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	600,000	9,869.52	59,217,124	9,906.25	59,437,505	5.5	2027/11/15	1.62
2	アメリカ	社債券	SPRINT CORP	350,000	11,817.60	41,361,622	11,903.33	41,661,675	7.875	2023/9/15	1.13
3	アメリカ	社債券	CALPINE CORP	400,000	10,479.26	41,917,071	10,338.52	41,354,094	5.5	2024/2/1	1.13
4	アメリカ	社債券	CENTENE CORP	325,000	11,135.63	36,190,813	10,861.77	35,300,779	4.625	2029/12/15	0.96
5	アメリカ	社債券	INN OF THE MOUNTAIN GODS	311,189	10,801.37	33,612,699	10,828.58	33,697,365	9.25	2020/11/30	0.92
6	アメリカ	社債券	JPMORGAN CHASE & CO	275,000	10,781.73	29,649,767	10,875.43	29,907,449	6	2049/12/29	0.81

7	アメリカ	社債券	INTL LEASE FINANCE CORP	300,000	11,102.52	33,307,585	9,892.55	29,677,650	5.875	2022/8/15	0.81
8	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	275,000	10,687.62	29,390,962	10,617.72	29,198,748	4.5	2032/5/1	0.79
9	アメリカ	社債券	CLEARWAY ENERGY OP LLC	275,000	10,870.88	29,894,921	10,567.85	29,061,602	5	2026/9/15	0.79
10	アメリカ	社債券	GENWORTH HOLDINGS INC	300,000	10,202.64	30,607,946	9,658.66	28,975,987	4.8	2024/2/15	0.79
11	アメリカ	社債券	SBA COMMUNICATIONS CORP	250,000	10,666.46	26,666,171	10,801.37	27,003,444	3.875	2027/2/15	0.73
12	アメリカ	社債券	VODAFONE GROUP PLC	225,000	11,082.69	24,936,054	11,549.83	25,987,123	7	2079/4/4	0.71
13	アメリカ	社債券	ICAHN ENTERPRISES/FIN	250,000	10,199.54	25,498,868	9,985.15	24,962,881	5.25	2027/5/15	0.68
14	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	225,000	10,902.27	24,530,121	11,005.48	24,762,348	6	2023/3/1	0.67
15	アメリカ	社債券	LEVEL 3 FINANCING INC	225,000	10,753.79	24,196,030	10,747.28	24,181,400	5.625	2023/2/1	0.66
16	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000	10,729.27	24,140,874	10,617.72	23,889,885	4.5	2030/8/15	0.65
17	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000	10,729.27	24,140,874	10,617.72	23,889,885	4.5	2030/8/15	0.65
18	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,658.25	23,316,501	11,786.56	23,573,122	6.5	2029/2/1	0.64
19	アメリカ	社債券	YPSO FINANCE BIS	200,000	11,672.26	23,344,525	11,542.78	23,085,564	10.5	2027/5/15	0.63
20	アメリカ	社債券	BAUSCH HEALTH COS INC	200,000	11,495.16	22,990,338	11,479.17	22,958,342	9	2025/12/15	0.62
21	アメリカ	社債券	KRAFT HEINZ FOODS CO	225,000	9,850.49	22,163,621	9,689.16	21,800,617	4.375	2046/6/1	0.59
22	アメリカ	社債券	CENTENE CORP	200,000	10,749.95	21,499,910	10,896.65	21,793,316	4.75	2025/1/15	0.59
23	アメリカ	社債券	BANK OF AMERICA CORP	200,000	11,266.02	22,532,054	10,781.73	21,563,467	6.25	2049/9/29	0.58
24	アメリカ	社債券	LENNAR CORP	200,000	10,925.36	21,850,724	10,718.01	21,436,027	4.125	2022/1/15	0.58
25	アメリカ	社債券	CENTENE CORP	200,000	11,120.08	22,240,172	10,671.32	21,342,651	4.25	2027/12/15	0.58
26	アメリカ	社債券	AMC NETWORKS INC	200,000	10,370.17	20,740,343	10,641.39	21,282,795	5	2024/4/1	0.58
27	アメリカ	社債券	1011778 BC / NEW RED FIN	200,000	10,651.73	21,303,472	10,570.16	21,140,336	5	2025/10/15	0.57
28	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	200,000	10,453.01	20,906,025	10,235.35	20,470,705	5.95	2049/12/29	0.55
29	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FINANCE CORP	200,000	11,012.23	22,024,471	10,181.59	20,363,181	6.625	2028/1/15	0.55
30	アメリカ	社債券	FRESENIUS MED CARE II	175,000	11,556.18	20,223,320	11,498.93	20,123,140	5.875	2022/1/31	0.55

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー設備・サービス	0.16
		自動車部品	0.04
		ソフトウェア	0.00
		その他の業種	0.17
社債券			59.29
合 計			59.67

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

その他の資産として、下記の通り貸付債権を組み入れております。
なお、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。

資産の名称	国 / 地域	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
貸付債権	アメリカ	16,035,168.43	1,523,601,917	1,372,557,130	37.52

(3) 運用実績

純資産の推移

2020年3月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第22特定期間	(2010年 9月15日)	9,692	9,763	0.8900	0.8965
第23特定期間	(2011年 3月15日)	9,389	9,460	0.9332	0.9402
第24特定期間	(2011年 9月15日)	8,133	8,202	0.8845	0.8920
第25特定期間	(2012年 3月15日)	7,855	7,910	0.9313	0.9378
第26特定期間	(2012年 9月18日)	7,489	7,544	0.9575	0.9645
第27特定期間	(2013年 3月15日)	7,298	7,350	0.9766	0.9836
第28特定期間	(2013年 9月17日)	6,911	6,954	0.9647	0.9707

第29特定期間	(2014年 3月17日)	6,680	6,721	0.9835	0.9895
第30特定期間	(2014年 9月16日)	6,714	6,755	0.9820	0.9880
第31特定期間	(2015年 3月16日)	6,019	6,050	0.9683	0.9733
第32特定期間	(2015年 9月15日)	5,631	5,661	0.9411	0.9461
第33特定期間	(2016年 3月15日)	5,075	5,103	0.9058	0.9108
第34特定期間	(2016年 9月15日)	4,997	5,018	0.9484	0.9524
第35特定期間	(2017年 3月15日)	4,809	4,824	0.9595	0.9625
第36特定期間	(2017年 9月15日)	5,189	5,205	0.9659	0.9689
第37特定期間	(2018年 3月15日)	4,945	4,955	0.9570	0.9590
第38特定期間	(2018年 9月18日)	4,772	4,782	0.9549	0.9569
第39特定期間	(2019年 3月15日)	4,560	4,565	0.9387	0.9397
第40特定期間	(2019年 9月17日)	4,421	4,430	0.9421	0.9441
第41特定期間	(2020年 3月16日)	3,932	3,941	0.8637	0.8657
	2019年 3月末日	4,546		0.9370	
	4月末日	4,529		0.9470	
	5月末日	4,468		0.9393	
	6月末日	4,465		0.9433	
	7月末日	4,451		0.9438	
	8月末日	4,435		0.9425	
	9月末日	4,389		0.9377	
	10月末日	4,338		0.9363	
	11月末日	4,333		0.9364	
	12月末日	4,362		0.9479	
	2020年 1月末日	4,344		0.9463	
	2月末日	4,276		0.9365	
	3月末日	3,657		0.8051	

分配の推移

	計算期間	1口当たりの分配金
第22特定期間	2010年 3月16日 ~ 2010年 9月15日	0.0195円
第23特定期間	2010年 9月16日 ~ 2011年 3月15日	0.0210円
第24特定期間	2011年 3月16日 ~ 2011年 9月15日	0.0220円
第25特定期間	2011年 9月16日 ~ 2012年 3月15日	0.0210円
第26特定期間	2012年 3月16日 ~ 2012年 9月18日	0.0215円
第27特定期間	2012年 9月19日 ~ 2013年 3月15日	0.0210円
第28特定期間	2013年 3月16日 ~ 2013年 9月17日	0.0195円
第29特定期間	2013年 9月18日 ~ 2014年 3月17日	0.0180円
第30特定期間	2014年 3月18日 ~ 2014年 9月16日	0.0180円
第31特定期間	2014年 9月17日 ~ 2015年 3月16日	0.0160円
第32特定期間	2015年 3月17日 ~ 2015年 9月15日	0.0150円

第33特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	0.0150円
第34特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	0.0130円
第35特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	0.0100円
第36特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	0.0090円
第37特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.0070円
第38特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.0060円
第39特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	0.0040円
第40特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.0050円
第41特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	0.0060円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

収益率の推移

	計算期間	収益率
第22特定期間	2010年 3月16日～2010年 9月15日	3.3%
第23特定期間	2010年 9月16日～2011年 3月15日	7.2%
第24特定期間	2011年 3月16日～2011年 9月15日	2.9%
第25特定期間	2011年 9月16日～2012年 3月15日	7.7%
第26特定期間	2012年 3月16日～2012年 9月18日	5.1%
第27特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月15日	4.2%
第28特定期間	2013年 3月16日～2013年 9月17日	0.8%
第29特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	3.8%
第30特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月16日	1.7%
第31特定期間	2014年 9月17日～2015年 3月16日	0.2%
第32特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	1.3%
第33特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	2.2%
第34特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	6.1%
第35特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	2.2%
第36特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	1.6%
第37特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.2%
第38特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.4%
第39特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	1.3%
第40特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.9%
第41特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	7.7%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

（4）設定及び解約の実績

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数

第22特定期間	2010年 3月16日 ~ 2010年 9月15日	59,332,640	1,417,141,899	10,890,605,634
第23特定期間	2010年 9月16日 ~ 2011年 3月15日	55,676,717	883,824,155	10,062,458,196
第24特定期間	2011年 3月16日 ~ 2011年 9月15日	57,692,470	925,020,823	9,195,129,843
第25特定期間	2011年 9月16日 ~ 2012年 3月15日	49,745,563	810,160,595	8,434,714,811
第26特定期間	2012年 3月16日 ~ 2012年 9月18日	48,498,213	661,825,857	7,821,387,167
第27特定期間	2012年 9月19日 ~ 2013年 3月15日	57,686,133	406,063,072	7,473,010,228
第28特定期間	2013年 3月16日 ~ 2013年 9月17日	74,184,618	382,732,053	7,164,462,793
第29特定期間	2013年 9月18日 ~ 2014年 3月17日	58,536,031	430,351,609	6,792,647,215
第30特定期間	2014年 3月18日 ~ 2014年 9月16日	340,763,279	295,329,170	6,838,081,324
第31特定期間	2014年 9月17日 ~ 2015年 3月16日	45,987,230	667,858,505	6,216,210,049
第32特定期間	2015年 3月17日 ~ 2015年 9月15日	29,342,790	261,309,678	5,984,243,161
第33特定期間	2015年 9月16日 ~ 2016年 3月15日	23,885,076	405,378,135	5,602,750,102
第34特定期間	2016年 3月16日 ~ 2016年 9月15日	21,858,178	355,065,058	5,269,543,222
第35特定期間	2016年 9月16日 ~ 2017年 3月15日	16,657,076	274,385,251	5,011,815,047
第36特定期間	2017年 3月16日 ~ 2017年 9月15日	529,512,374	168,038,923	5,373,288,498
第37特定期間	2017年 9月16日 ~ 2018年 3月15日	15,494,439	221,452,708	5,167,330,229
第38特定期間	2018年 3月16日 ~ 2018年 9月18日	7,436,390	177,379,984	4,997,386,635
第39特定期間	2018年 9月19日 ~ 2019年 3月15日	7,130,025	145,993,324	4,858,523,336
第40特定期間	2019年 3月16日 ~ 2019年 9月17日	4,757,975	170,443,484	4,692,837,827
第41特定期間	2019年 9月18日 ~ 2020年 3月16日	9,116,608	148,747,022	4,553,207,413

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

<更新後>



運用実績 (2020年3月31日現在)

■ 基準価額・純資産の推移 (日次)



■ 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2020年3月	20 円
2020年1月	20 円
2019年11月	20 円
2019年9月	20 円
2019年7月	20 円
直近1年間累計	110 円
設定来累計	5,935 円

■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率 (上位)

順位	銘柄	投資比率 (%)
1	TRANSIGM INC	1.6
2	SPRINT CORP	1.1
3	CALPINE CORP	1.1
4	CENTENE CORP	1.0
5	INN OF THE MOUNTAIN GODS	0.9
6	JPMORGAN CHASE & CO	0.8
7	INTL LEASE FINANCE CORP	0.8
8	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	0.8
9	CLEARWAY ENERGY OP LLC	0.8
10	GENWORTH HOLDINGS INC	0.8

■ 年間收益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間收益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの收益率。

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

第3【ファンドの経理状況】

ノムラ・ボンド＆ローン・ファンド

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

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2019年9月18日から2020年3月16日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	前期 (2019年 9月17日現在)	当期 (2020年 3月16日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	317,046,911	120,014,164
コール・ローン	43,204,374	41,356,440
株式	35,727,009	14,254,507
社債券	2,246,997,354	2,178,396,321
貸付債権	1,833,567,029	1,531,501,441
派生商品評価勘定	812,409	84,925,757
未収入金	38,659,498	62,755,785
未収配当金	29,322	-
未収利息	38,707,805	43,189,324
前払費用	1,993,998	1,899,921
その他未収収益	1,611,499	4,403,567
流動資産合計	4,558,357,208	4,082,697,227
資産合計	4,558,357,208	4,082,697,227
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	57,624,239	19,258,786
未払金	51,857,018	101,149,401
未払収益分配金	9,385,675	9,106,414
未払解約金	6,209,940	8,917,539
未払受託者報酬	578,961	552,228
未払委託者報酬	11,413,793	10,886,733
未払利息	74	83
その他未払費用	16,525	15,757
流動負債合計	137,086,225	149,886,941
負債合計	137,086,225	149,886,941
純資産の部		
元本等		
元本	4,692,837,827	4,553,207,413
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	271,566,844	620,397,127
(分配準備積立金)	1,346,648,889	1,367,916,788
元本等合計	4,421,270,983	3,932,810,286
純資産合計	4,421,270,983	3,932,810,286
負債純資産合計	4,558,357,208	4,082,697,227

(2) 損益及び剩余金計算書

(単位 : 円)

	前期 自 2019年 3月16日 至 2019年 9月17日	当期 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月16日
営業収益		
受取配当金	470,036	81,871
受取利息	127,718,958	119,183,686
有価証券売買等損益	12,481,544	374,159,399
為替差損益	64,432,969	41,225,250
その他収益	3,178,324	3,508,163
営業収益合計	79,415,893	292,610,929
営業費用		
支払利息	14,854	7,221
受託者報酬	1,727,719	1,652,520
委託者報酬	34,060,818	32,578,175
その他費用	3,705,384	3,667,118
営業費用合計	39,508,775	37,905,034
営業利益又は営業損失()	39,907,118	330,515,963
経常利益又は経常損失()	39,907,118	330,515,963
当期純利益又は当期純損失()	39,907,118	330,515,963
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()	434,246	933,434
期首剩余金又は期首次損金()	297,771,670	271,566,844
剩余金増加額又は欠損金減少額	10,634,860	8,864,848
当期一部解約に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	10,634,860	8,864,848
剩余金減少額又は欠損金増加額	278,650	549,663
当期追加信託に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額	278,650	549,663
分配金	23,624,256	27,562,939
期末剩余金又は期末欠損金()	271,566,844	620,397,127

(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	株式 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 貸付債権 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。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金

	<p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
5. その他	当該財務諸表の特定期間は、2019年 9月18日から2020年 3月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2019年 9月17日現在	当期 2020年 3月16日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 4,692,837,827口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 4,553,207,413口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 271,566,844円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 620,397,127円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9421円 (10,000口当たり純資産額) (9,421円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8637円 (10,000口当たり純資産額) (8,637円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年 3月16日 至 2019年 9月17日	当期 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月16日																		
<p>1. 運用の外部委託費用 信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 支払金額 10,259,501円</p> <p>2. 分配金の計算過程 2019年 3月16日から2019年 5月15日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>30,167,619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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	30,167,619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	<p>1. 運用の外部委託費用 信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用 支払金額 9,556,827円</p> <p>2. 分配金の計算過程 2019年 9月18日から2019年11月15日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>27,960,909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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	27,960,909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
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	30,167,619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																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	27,960,909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	934,352,682円
分配準備積立金額	D	1,302,035,042円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,266,555,343円
当ファンドの期末残存口数	F	4,772,558,214口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,749円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	I=F × H/10,000	4,772,558円

2019年 5月16日から2019年 7月16日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	30,449,019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	926,938,171円
分配準備積立金額	D	1,316,215,568円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,273,602,758円
当ファンドの期末残存口数	F	4,733,011,939口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,803円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	I=F × H/10,000	9,466,023円

2019年 7月17日から2019年 9月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	30,730,495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	919,732,142円
分配準備積立金額	D	1,325,304,069円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,275,766,706円
当ファンドの期末残存口数	F	4,692,837,827口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,849円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	I=F × H/10,000	9,385,675円

収益調整金額	C	908,114,992円
分配準備積立金額	D	1,328,178,647円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,264,254,548円
当ファンドの期末残存口数	F	4,630,171,058口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,890円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	I=F × H/10,000	9,260,342円

2019年11月16日から2020年 1月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,681,557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	902,502,162円
分配準備積立金額	D	1,336,961,433円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,276,145,152円
当ファンドの期末残存口数	F	4,598,091,529口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,950円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	I=F × H/10,000	9,196,183円

2020年 1月16日から2020年 3月16日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	27,063,585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	895,004,129円
分配準備積立金額	D	1,349,959,617円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,272,027,331円
当ファンドの期末残存口数	F	4,553,207,413口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,989円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	I=F × H/10,000	9,106,414円

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

前期 自 2019年 3月16日 至 2019年 9月17日	当期 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月16日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1. 金融商品に対する取組方針 同左

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用してあります。	2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制 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查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。	3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2) 金融商品の時価等に関する事項

前期 2019年 9月17日現在	当期 2020年 3月16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。	1 . 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2 . 時価の算定方法	2 . 時価の算定方法

株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 貸付債権 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載まして おります。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務(貸付債権は除く) これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。	同左
---	----

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2019年 3月16日 至 2019年 9月17日	当期 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月16日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般的の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

前期 自 2019年 3月16日 至 2019年 9月17日	当期 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月16日
期首元本額 4,858,523,336円	期首元本額 4,692,837,827円
期中追加設定元本額 4,757,975円	期中追加設定元本額 9,116,608円
期中一部解約元本額 170,443,484円	期中一部解約元本額 148,747,022円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年 3月16日 至 2019年 9月17日	当期 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月16日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,549,224	9,747,794

社債券	12,409,535	225,240,112
合計	6,860,311	234,987,906

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	前期(2019年 9月17日現在)			当期(2020年 3月16日現在)		
	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
				うち1年 超	うち1年 超	
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売建	4,353,435,312	-	4,410,247,142	56,811,830	3,869,472,164	-
米ドル	4,353,435,312	-	4,410,247,142	56,811,830	3,869,472,164	-
合計	4,353,435,312	-	4,410,247,142	56,811,830	3,869,472,164	-
					3,803,805,193	65,666,971
					3,803,805,193	65,666,971

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年3月16日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	DAVID'S BRIDAL COM	916	0.01	9.16	
		GYMBOREE HOLDING CORP	1,017	0.00	5.08	

MOOD MEDIA CORP COMMON STOCK	30,625	0.65	19,906.25	
MOOD MEDIA CORP RESTRICTED COMMON STOCK	25,000	0.65	16,250.00	
RUE21 CLASS A COM	51	70.00	3,570.00	
VISTRA ENERGY CORP RIGHTS	3,586	1.10	3,944.60	
SAMSON RESOURCES II LLC A COM	3,123	17.50	54,652.50	
MARK IV DAYCO	4,608	3.00	13,824.00	
AVAYA HOLDINGS CORP	1	9.87	9.87	
小計 銘柄数：9			112,171.46	
組入時価比率：0.3%			(11,992,250)	
			84.1%	
英ポンド	HIBU GROUP LIMITED COM	176,031	0.09	17,163.02
小計 銘柄数：1			17,163.02	
組入時価比率：0.1%			(2,262,257)	
			15.9%	
合計			14,254,507	
			(14,254,507)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2020年3月16日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	200,000.00	195,750.00	
		AIRCASTLE LTD	125,000.00	126,971.05	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	25,000.00	24,801.75	
		ALCOA INC	25,000.00	25,255.75	
		ALCOA INC	150,000.00	154,272.48	
		ALCOA INC	75,000.00	77,962.50	
		ALLEGHENY TECHNOLOGIES	75,000.00	72,725.81	
		ALLY FINANCIAL INC	75,000.00	92,942.15	
		AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	25,000.00	14,609.31	
		AMC ENTERTAINMENT INC	25,000.00	14,578.18	
		AMC NETWORKS INC	200,000.00	190,575.60	
		AMERIGAS PART/FIN CORP	50,000.00	47,718.62	

AMERIGAS PART/FIN CORP	100,000.00	93,950.00	
ANIXTER INC	100,000.00	101,657.25	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	50,000.00	47,687.75	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	50,000.00	47,684.75	
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	54,000.00	52,610.64	
BANK OF AMERICA CORP	200,000.00	207,039.00	
BANK OF AMERICA CORP	25,000.00	24,232.62	
BANK OF NOVA SCOTIA	25,000.00	21,543.50	
BARCLAYS PLC	200,000.00	194,639.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	200,000.00	211,250.00	
BEAZER HOMES USA	100,000.00	94,375.00	
BERRY PLASTICS CORP	100,000.00	100,674.75	
BERRY PLASTICS CORP	63,000.00	63,275.46	
BOYD GAMING CORP	125,000.00	107,776.50	
BUFFALO THUNDER DEV REGS	11,663.00	6,064.76	
BUFFALO THUNDER DEV ZCPN	5,172.47	0.51	
CALLON PETROLEUM CO	50,000.00	15,187.50	
CALPINE CORP	400,000.00	385,160.99	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	50,217.25	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	25,000.00	24,546.87	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	50,000.00	52,500.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	75,000.00	78,750.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	221,821.87	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	225,000.00	221,821.87	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	275,000.00	270,063.06	
CDK GLOBAL INC	50,000.00	50,758.12	
CDW LLC/CDW FINANCE	50,000.00	49,739.40	
CEDAR FAIR LP/CANADA'S W	100,000.00	92,927.12	
CENTENE CORP	200,000.00	197,555.00	
CENTENE CORP	200,000.00	204,357.00	
CENTENE CORP	325,000.00	332,544.45	
CENTRAL GARDEN & PET CO	100,000.00	101,421.80	
CENTURY COMMUNITIES	50,000.00	48,687.50	
CENTURYLINK INC	175,000.00	175,091.21	
CENTURYLINK INC	100,000.00	106,177.12	

CF INDUSTRIES INC	175,000.00	179,702.68
CHEMOURS CO	125,000.00	109,121.00
CHEMOURS CO	25,000.00	20,359.31
CHENIERE CORP CHRISTI HD	25,000.00	22,142.26
CHENIERE ENERGY PARTNERS	50,000.00	43,228.75
CHESAPEAKE ENERGY CORP	34,000.00	7,990.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	25,000.00	2,250.00
CINEMARK USA INC	100,000.00	90,125.25
CITIGROUP INC	150,000.00	134,718.75
CITIGROUP INC	200,000.00	192,098.00
CLEARWAY ENERGY OP LLC	250,000.00	250,693.75
CLIFFS NATURAL RESOURCES	13,000.00	10,680.80
CLOUD PEAK ENRGY	25,000.00	275.00
CLOUD PEAK ENRGY RES	20,000.00	0.00
COEUR MINING INC	25,000.00	22,921.81
COMMERCIAL METALS CO	50,000.00	50,287.31
CONSOL ENERGY INC	50,000.00	43,786.43
CRESTWOOD MIDSTREAM PART	50,000.00	41,588.56
CSC HOLDINGS LLC	25,000.00	26,203.18
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	214,247.00
DANA INC	75,000.00	68,891.90
DCP MIDSTREAM OPERATING	75,000.00	61,289.17
DCP MIDSTREAM OPERATING	50,000.00	35,321.75
DIAMOND OFFSHORE DRILL	25,000.00	10,718.75
DISH DBS CORP	25,000.00	24,734.31
DISH DBS CORP	35,000.00	33,181.19
DISH DBS CORP	25,000.00	24,569.37
DONNELLEY FINANCIAL SOL	50,000.00	48,189.37
ELDORADA RESORTS INC	125,000.00	125,156.25
EMBARQ CORP	75,000.00	77,390.43
EMC CORP	75,000.00	74,742.84
ENERGY TRANSFER	25,000.00	24,332.36
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	100,000.00	60,762.75
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	25,000.00	10,859.31
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	25,000.00	593.75

FELCOR LODGING LP	125,000.00	125,527.25	
FREEPORT-MCMORAN C & G	25,000.00	22,379.31	
FREEPORT-MCMORAN INC	25,000.00	23,140.62	
FREEPORT-MCMORAN INC	150,000.00	133,219.12	
FREEPORT-MCMORAN INC	175,000.00	152,111.31	
FRESENIUS MED CARE II	175,000.00	185,824.87	
FRONTIER COMMUNICATIONS	200,000.00	72,124.50	
GENESIS ENERGY LP/FIN	50,000.00	34,674.18	
GENWORTH HOLDINGS INC	300,000.00	281,245.49	
GEO GROUP INC/THE	75,000.00	61,827.93	
GLP CAPITAL LP / FIN II	25,000.00	26,734.31	
GLP CAPITAL LP / FIN II	50,000.00	51,000.90	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	100,000.00	94,069.49	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,000.00	72,183.75	
GRIFFON CORPORATION	150,000.00	142,211.25	
GULFPORT ENERGY CORP	50,000.00	13,286.43	
HCA INC	100,000.00	106,427.12	
HCA INC	75,000.00	80,202.84	
HCA INC	150,000.00	162,280.87	
HCA INC	75,000.00	83,287.12	
HCA INC	125,000.00	120,232.08	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	125,000.00	126,596.87	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	50,000.00	49,435.00	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	250,000.00	234,300.00	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	50,000.00	51,106.37	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	100,000.00	98,656.37	
INFOR US INC	100,000.00	98,937.25	
INN OF THE MOUNTAIN GODS	311,189.00	308,855.08	
INTL LEASE FINANCE CORP	300,000.00	306,051.51	
IRON MOUNTAIN INC	75,000.00	74,015.43	
JC PENNEY CORPORATION IN	50,000.00	13,750.00	
JP MORGAN CHASE & CO	12,000.00	11,266.50	
JPMORGAN CHASE & CO	50,000.00	52,597.25	
JPMORGAN CHASE & CO	275,000.00	272,441.12	
JPMORGAN CHASE & CO	50,000.00	49,289.75	

KB HOME	25,000.00	28,181.25
KENNEDY-WILSON INC	200,000.00	198,125.50
KRAFT HEINZ FOODS CO	100,000.00	103,599.65
KRAFT HEINZ FOODS CO	50,000.00	52,639.25
KRAFT HEINZ FOODS CO	75,000.00	86,261.86
KRAFT HEINZ FOODS CO	225,000.00	203,653.59
L BRANDS INC	25,000.00	23,796.87
L BRANDS INC	100,000.00	90,437.24
LAMAR MEDIA CORP	100,000.00	99,087.50
LAMAR MEDIA CORP	75,000.00	74,878.12
LAREDO PETROLEUM INC	200,000.00	80,136.73
LENNAR CORP	200,000.00	200,778.50
LENNAR CORP	100,000.00	108,490.50
LEVEL 3 FINANCING INC	225,000.00	222,328.68
LEVEL 3 FINANCING INC	25,000.00	24,824.20
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	25,000.00	21,475.87
MATADOR RESOURCES CO	100,000.00	42,315.25
MATTEL INC	50,000.00	48,158.21
MATTEL INC	25,000.00	20,140.56
MERCER INTL INC	25,000.00	23,382.43
MERITAGE HOMES CORP	108,000.00	114,412.23
MGIC INVESTMENT CORP	125,000.00	130,487.50
MGM RESORTS INTL	25,000.00	25,390.56
MGM RESORTS INTL	100,000.00	97,035.12
MGM RESORTS INTL	66,000.00	62,286.51
MIDWEST VANADIUM PTY LTD	93,229.03	139.84
MOOD MEDIA BORROWER LLC	110,165.00	88,132.00
MPT OPER PARTNERSP/FINL	150,000.00	153,632.70
MPT OPER PARTNERSP/FINL	25,000.00	25,197.40
MPT OPER PARTNERSP/FINL	25,000.00	24,968.37
MSCI INC	25,000.00	25,612.37
MURPHY OIL CORP	75,000.00	50,718.75
MURPHY OIL CORP	175,000.00	107,372.77
MURPHY OIL USA INC	50,000.00	49,984.25
NAVIENT CORP	25,000.00	24,996.18

NAVIENT CORP	75,000.00	75,984.56
NAVIENT CORP	75,000.00	74,372.25
NAVIENT CORP	100,000.00	100,266.25
NAVIENT CORP	25,000.00	22,859.52
NCR CORP	50,000.00	51,026.06
NETFLIX INC	25,000.00	25,378.81
NETFLIX INC	25,000.00	25,786.78
NETFLIX INC	100,000.00	109,687.50
NEWELL RUBBERMAID INC	75,000.00	74,966.28
NEWELL RUBBERMAID INC	225,000.00	234,008.05
NOBLE HOLDING INTL LTD	25,000.00	5,924.28
NRG ENERGY INC	25,000.00	25,819.37
NRG ENERGY INC	75,000.00	76,145.62
OASIS PETROLEUM INC	50,000.00	22,750.00
OASIS PETROLEUM INC	25,000.00	6,599.28
OLIN CORP	25,000.00	22,359.37
PACIFIC GAS & ELECTRIC	50,000.00	55,343.62
PACIFIC GAS & ELECTRIC	50,000.00	54,468.62
PACIFIC GAS & ELECTRIC	25,000.00	27,109.31
PBF HOLDING CO LLC	100,000.00	74,348.37
PBF LOGISTICS LP/FINANCE	50,000.00	46,507.62
PDC ENERGY INC	25,000.00	18,094.68
PDC ENERGY INC	50,000.00	32,669.62
PENSKE AUTO GROUP INC	125,000.00	124,296.56
QORVO INC	25,000.00	24,984.00
QORVO INC	50,000.00	49,968.00
QUEBECOR MEDIA INC	50,000.00	51,301.43
QUICKSILVER ESCROW DEBT	50,000.00	0.00
QVC INC	75,000.00	70,211.98
RADIAN GROUP INC	100,000.00	102,413.00
SANCHEZ ENERGY CORP	75,000.00	1,070.34
SBA COMMUNICATIONS CORP	250,000.00	245,025.92
SCOTTS MIRACLE-GRO CO	50,000.00	51,138.75
SCOTTS MIRACLE-GRO CO	75,000.00	75,515.43
SERVICE CORP INTL	100,000.00	108,437.25

SERVICE CORP INTL	25,000.00	26,171.87
SESI LLC	25,000.00	15,106.78
SILGAN HOLDINGS INC	50,000.00	49,302.93
SLM CORP	33,000.00	32,912.63
SLM CORP	50,000.00	48,593.62
SM ENERGY CO	56,000.00	26,004.86
SM ENERGY CO	175,000.00	63,765.18
SOUTHWESTERN ENERGY CO	25,000.00	16,316.31
SPRINGLEAF FINANCE CORP	125,000.00	126,876.37
SPRINGLEAF FINANCE CORP	150,000.00	150,561.03
SPRINGLEAF FINANCE CORP	200,000.00	202,375.00
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	46,802.93
SPRINT CAPITAL CORP	50,000.00	67,463.56
SPRINT COMMUNICATIONS	25,000.00	26,194.64
SPRINT CORP	250,000.00	272,057.17
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	150,000.00	148,459.12
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	75,000.00	75,893.85
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	150,000.00	75,655.87
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	50,000.00	15,088.50
SUMMIT MIDSTREAM PARTNER	125,000.00	60,061.25
T-MOBILE USA INC	75,000.00	75,798.75
T-MOBILE USA INC	225,000.00	225,398.52
T-MOBILE USA INC	75,000.00	74,841.56
T-MOBILE USA INC	25,000.00	24,526.50
T-MOBILE USA INC	175,000.00	174,748.00
TARGA RESOURCES PARTNERS	150,000.00	129,640.68
TARGA RESOURCES PARTNERS	25,000.00	22,000.06
TARGA RESOURCES PARTNERS	100,000.00	78,835.25
TARGA RESOURCES PARTNERS	75,000.00	57,266.90
TAYLOR MORRISON	25,000.00	25,274.59
TECK RESOURCES LIMITED	50,000.00	52,251.01
TELECOM ITALIA CAPITAL	75,000.00	78,488.62
TENNECO INC	25,000.00	17,546.81
TRANSDIGM INC	600,000.00	544,125.00
TRANSMONTAIGE PARTNERS	50,000.00	42,633.50

	TRI POINTE GROUP INC	100,000.00	100,777.50	
	UNITED CONTINENTAL HLDGS	125,000.00	123,671.56	
	UNITED RENTALS NORTH AM	50,000.00	50,343.62	
	UNITED RENTALS NORTH AM	25,000.00	25,780.87	
	UNITED RENTALS NORTH AM	25,000.00	25,109.31	
	UNITED RENTALS NORTH AM	50,000.00	48,343.75	
	UNITED RENTALS NORTH AM	75,000.00	69,572.06	
	UNITED STATES STEEL CORP	25,000.00	17,004.25	
	VIPER ENERGY PARTNERS LP	75,000.00	62,729.62	
	VODAFONE GROUP PLC	125,000.00	131,878.50	
	WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	25,000.00	25,106.78	
	WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN	25,000.00	26,030.98	
	WESTERN DIGITAL CORP	25,000.00	24,632.75	
	WHITING PETROLEUM CORP	25,000.00	3,856.78	
	WPX ENERGY INC	100,000.00	85,421.80	
	WPX ENERGY INC	25,000.00	17,753.12	
	WPX ENERGY INC	125,000.00	83,560.46	
	YPSO FINANCE BIS	200,000.00	214,504.50	
	YUM! BRANDS INC	150,000.00	144,573.18	
小計	銘柄数 : 241	22,150,418.50	20,375,982.80	
	組入時価比率 : 55.4%		(2,178,396,321)	
合計			100.0%	
			2,178,396,321	
			(2,178,396,321)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

第3 その他特定資産の明細表(2020年3月16日現在)

特定資産の種類 (銘柄名)	数量	帳簿価額		評価額		評価損益	備考
		単価	金額	単価	金額		
貸付債権							
米ドル							
ACOSTA TRANCHE B-1 TRM	23,877.71	23.31	5,566.49	20.33	4,855.12	711.37	
ADIENT INITIAL TERM LOAN	18,625.00	100.75	18,764.68	93.50	17,414.37	1,350.31	
ADIENT INITIAL TL 02	6,250.00	100.75	6,296.87	93.50	5,843.75	453.12	

ADT 2019 TRM B-1(PRIME)	149,625.00	100.51	150,399.90	92.50	138,403.12	11,996.78	
AIR METHODS CORP TRM	73,125.00	86.75	63,435.93	79.03	57,791.56	5,644.37	
ALERIS INTERNATIINI TRM	123,125.00	99.95	123,067.25	95.50	117,584.37	5,482.88	
ALLEN MEDIA TL	50,000.00	99.50	49,750.00	93.75	46,875.00	2,875.00	
ALLIED UNIVERSALINI TRM	300,000.00	101.24	303,749.99	93.63	280,875.00	22,874.99	
ALTRA INDUSTRIAL TL	132,537.33	100.37	133,027.71	92.50	122,597.03	10,430.68	
AMENTUM 1L TRM #1	66,513.76	99.49	66,181.19	93.38	62,107.22	4,073.97	
AMENTUM 1L TRM #2	33,486.24	99.50	33,318.81	93.38	31,267.77	2,051.04	
AMERICAN ROCK INITIL TRM	237,717.39	100.62	239,203.12	97.63	232,071.60	7,131.52	
ASURION 2L REPLA B-2 TRM	150,000.00	101.78	152,671.80	94.25	141,375.00	11,296.80	
ASURION REPLACE B6 TRM	23,653.81	100.75	23,831.21	92.50	21,879.77	1,951.44	
ASURION(LONESTAR) B4 IRL	56,307.72	100.79	56,753.50	94.50	53,210.79	3,542.71	
AVSC HOLD(PSAV) IN 1L #1	24,009.63	100.75	24,189.70	75.00	18,007.22	6,182.48	
AVSC HOLD(PSAV) IN 1L #2	23,897.22	100.75	24,076.44	75.00	17,922.91	6,153.53	
AVSC HOLD(PSAV) IN 1L #6	1,218.15	100.75	1,227.28	75.00	913.61	313.67	
AVSC HOLD(PSAV) INIT TRM	75,000.00	94.00	70,500.00	92.88	69,656.25	843.75	
BCP RENAISSANCEINI TL B	98,438.30	93.91	92,450.00	70.25	69,152.90	23,297.10	
BERRY PLASTICS TL W	174,679.66	100.54	175,625.89	95.15	166,207.69	9,418.20	
BERRY PLASTICS TL X	48,605.57	100.40	48,799.99	95.00	46,175.29	2,624.70	
BERRY PLASTICS TRM Y	49,750.00	100.55	50,023.62	91.67	45,604.18	4,419.44	
BIG RIVER STEEL TL	73,312.50	99.75	73,129.21	92.50	67,814.06	5,315.15	
BRIGHT BIDCO REFIN TLB	98,388.72	60.00	59,033.23	39.88	39,232.50	19,800.73	
BRIGHT BIDCO REFIN TLB02	26,591.55	60.00	15,954.93	39.88	10,603.38	5,351.55	
BRIGHT BIDCO REFIN TLB03	21,273.24	60.00	12,763.94	39.88	8,482.70	4,281.24	
BUCKEYE PARTNERS TL B	25,000.00	101.08	25,270.82	91.33	22,833.32	2,437.50	
BUILDERS FIRST US TRM	17,021.28	100.12	17,042.55	95.00	16,170.21	872.34	
BURGER KING CORP TL B4#1	135,749.09	100.37	136,258.14	91.00	123,531.67	12,726.47	
CAESARS ENTERTIMNT TRM B	81,333.33	100.52	81,759.92	92.67	75,368.91	6,391.01	
CALIFORNIA RESOURCES TRM	50,000.00	76.79	38,395.85	15.00	7,500.00	30,895.85	
CALIFORNIA RESOURCES TRM	250,000.00	91.81	229,531.25	51.33	128,333.25	101,198.00	
CAMELOT FINANCE TRM	25,000.00	100.93	25,234.37	90.63	22,656.25	2,578.12	
CENGAGE LERNNG ACQS B TL	357,039.73	96.25	343,650.74	86.07	307,309.09	36,341.65	
CENTURYLINK INC TRM B	100,000.00	99.76	99,764.08	94.00	94,000.00	5,764.08	
CHOBANI 1L CLOSIDATE TRM	193,304.51	100.02	193,352.83	93.75	181,222.97	12,129.86	
CITGO PETROLEUM TL B	23,687.50	100.75	23,865.15	92.00	21,792.50	2,072.65	
CITGO PETROLEUM TRM B	49,875.00	101.91	50,830.95	89.75	44,762.81	6,068.14	
CITYCENTER HLDGS TRM B	196,602.57	100.43	197,461.52	86.25	169,569.71	27,891.81	
CLEAR CHANNEL OUTD TRM B	24,937.50	100.64	25,097.82	90.50	22,568.43	2,529.39	
COINMACH TL B 01	254,788.35	99.70	254,023.98	93.75	238,864.07	15,159.91	
COLUMBUS MCKINON TLB2	29,265.45	100.12	29,302.03	95.00	27,802.17	1,499.86	
CONNECT FINCO DD TL	88,658.15	100.07	88,724.64	90.33	80,087.83	8,636.81	
CONNECT FINCO INTL TL	61,341.85	100.07	61,387.86	90.33	55,412.11	5,975.75	
CONSOLIDATED INIT TL 02	7,555.17	100.37	7,583.50	94.38	7,130.19	453.31	
CONSOLIDATED INITIAL TRM	41,322.31	100.37	41,477.26	94.38	38,997.93	2,479.33	
CSC HOLDINGS TL B5	120,937.50	100.79	121,894.96	92.50	111,867.18	10,027.78	
CUSHMAN&WAKEFIELD TL ZZB	112,762.26	100.43	113,255.59	92.13	103,882.23	9,373.36	
DAVIDS BRIDAL TAKEBACK#1	56,826.94	40.00	22,730.77	37.25	21,168.03	1,562.74	
DAYCO PRODUCTS LLC TRM	291,750.00	87.00	253,822.50	81.00	236,317.50	17,505.00	

DEALER TIRE TRM B-1	15,959.63	99.74	15,919.73	93.00	14,842.45	1,077.28	
DEALER TIRE TRM B-1 02	9,040.37	99.75	9,017.77	93.00	8,407.54	610.23	
DIAMOND SPORTS B TRM	24,937.50	100.04	24,947.89	73.50	18,329.06	6,618.83	
DUN AND BRDST INIT TL B	150,000.00	100.81	151,218.75	96.00	144,000.00	7,218.75	
EDELMAN FINANC IN TRM 2L	50,000.00	100.00	50,000.00	88.88	44,437.50	5,562.50	
ENVISION HEALTH INIT TRM	123,750.00	86.41	106,940.66	75.25	93,121.87	13,818.79	
EVERI PAYMENTS TRM B	67,217.61	100.49	67,546.97	95.38	64,108.79	3,438.18	
FINANCIAL&RISK DOLLAR TL	198,000.00	101.04	200,062.56	93.50	185,130.00	14,932.56	
FORMULA ONE NEW TL B	163,471.34	100.35	164,043.48	88.00	143,854.77	20,188.71	
FOUNDATION BUILDING B TL	123,750.00	100.56	124,446.09	93.00	115,087.50	9,358.59	
GARDA WORLD SEC TL	68,706.54	101.00	69,393.60	94.50	64,927.68	4,465.92	
GATEWAY CASINOSINI TRM	295,500.00	99.72	294,687.37	90.00	265,950.00	28,737.37	
GLOBAL AVIATION 2ND LIEN	831.44	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
GOLDEN NUGGET TRM B	38,835.35	100.36	38,976.57	84.50	32,815.87	6,160.70	
GOLDEN NUGGET TRM B02	31,341.00	100.38	31,460.93	84.50	26,483.14	4,977.79	
HARBOR FREIGHT TRM	244,167.97	100.03	244,241.22	90.00	219,751.17	24,490.05	
HARD ROCK NORTHIN DD TRM	23,648.65	102.50	24,239.86	93.00	21,993.24	2,246.62	
HARLAND CLARKE TL01	144,878.50	80.00	115,902.80	70.33	101,897.83	14,004.97	
HEALOGICS INITIAL#1	118,437.50	73.09	86,570.46	72.75	86,163.28	407.18	
HELIX ACQUISITION 2L TRM	75,000.00	94.25	70,687.50	84.88	63,656.25	7,031.25	
HUB INTERNATIONAL 2019 IRL	50,000.00	101.37	50,687.50	91.00	45,500.00	5,187.50	
HUB INTERNATIONAL TL	93,800.07	100.37	94,151.81	91.13	85,475.31	8,676.50	
HUB INTERNATIONAL#8	238.68	100.37	239.58	91.13	217.49	22.09	
HUB INTERNATIONAL#9	4,461.25	100.37	4,477.98	91.13	4,065.31	412.67	
IAA SPINCO TRM B	24,187.50	100.58	24,327.78	94.75	22,917.65	1,410.13	
INSTALLED BUILD B-3 TRM	300,000.00	100.25	300,750.00	95.00	285,000.00	15,750.00	
IRB HOLDING(ARBYS) TRM B	442,865.60	100.67	445,870.88	91.00	403,007.69	42,863.19	
J CREW INITIAL LOAN #1	6,491.82	86.00	5,582.96	79.50	5,160.99	421.97	
J CREW INITIAL LOAN #2	13,016.17	86.00	11,193.90	79.50	10,347.85	846.05	
J CREW INITIAL LOAN #4	4,167.00	86.00	3,583.62	79.50	3,312.76	270.86	
KAR HOLDINGS NEW TLB6 01	53,498.40	100.84	53,949.81	94.00	50,288.49	3,661.32	
KCA DEUTAG EXTENDED TL	122,380.67	69.75	85,360.51	49.50	60,578.43	24,782.08	
KEANE GROUP INITIAL TRM	24,250.00	96.75	23,461.87	83.75	20,309.37	3,152.50	
KLOECKNER PENTAPLST \$ TL	98,241.18	90.20	88,613.54	79.50	78,101.73	10,511.81	
KRONOSINI TRM #1	77,527.54	99.49	77,139.90	93.50	72,488.24	4,651.66	
KRONOSINI TRM #2	25,017.00	99.50	24,891.92	93.50	23,390.89	1,501.03	
KRONOSINI TRM #3	43,507.82	99.49	43,290.28	93.50	40,679.81	2,610.47	
KRONOSINI TRM #4	53,947.64	99.49	53,677.90	93.50	50,441.04	3,236.86	
KSBR HOLDING (SABRE)TRM	24,812.50	100.50	24,936.56	98.00	24,316.25	620.31	
LIFE TIME FITNESS #1 B	388,539.37	100.33	389,834.37	88.08	342,238.29	47,596.08	
LIFE TIME FITNESS #11 B	996.25	100.33	999.57	88.08	877.52	122.05	
LIFEPOINT TRM B	50,000.00	100.25	50,125.00	92.50	46,250.00	3,875.00	
LIONS GATE ENTERTA TRM B	170,165.38	99.54	169,385.51	92.00	156,552.14	12,833.37	
LOWER CADENCEINI TRM	149,250.00	99.87	149,063.43	76.00	113,430.00	35,633.43	
LUCID ENERGY INITIAL TRM	49,125.00	94.25	46,300.31	75.50	37,089.37	9,210.94	
MALLINCKRODT 2018 IRL	134,187.33	81.75	109,698.14	83.19	111,627.08	1,928.94	
MARRIOT OWNRSHP InitialTL	99,250.00	100.31	99,560.15	88.50	87,836.25	11,723.90	
MAUSER PACKAGING TL	96,882.52	99.93	96,821.96	89.83	87,032.76	9,789.20	

MAUSER PACKAGING TL 11	249.06	99.93	248.90	89.83	223.73	25.17	
MCDERMOTT DD TL	21,698.43	101.91	22,114.32	103.75	22,512.12	397.80	
MCDERMOTT INTER TRM CMIT	14,233.48	95.09	13,534.75	98.25	13,984.39	449.64	
MCDERMOTT INTRNTINL TL A	47,736.56	101.91	48,651.52	103.75	49,526.68	875.16	
MCDERMOTT INTRNTINL TL A	43,396.87	101.91	44,228.65	103.75	45,024.25	795.60	
MCDERMOTT TECH DD TL	16,821.39	100.00	16,821.39	98.25	16,527.01	294.38	
MCGRAW HILL TRM B	248,700.38	95.83	238,337.78	86.83	215,954.74	22,383.04	
MOHEGAN TRBL GAMING TL B	199,472.14	96.46	192,428.37	86.50	172,543.40	19,884.97	
MOTION FINCO INITIAL TL	22,095.96	101.31	22,385.96	86.50	19,113.00	3,272.96	
MOTION FINCO LLC DD TL	2,904.04	101.31	2,942.15	86.50	2,511.99	430.16	
MRO HOLDINGS INI TL02	5,102.48	100.00	5,102.48	93.75	4,783.57	318.91	
MRO HOLDINGS INI TL03	2,506.58	100.00	2,506.58	93.75	2,349.91	156.67	
MRO HOLDINGS INITIAL TRM	17,265.94	100.00	17,265.94	93.75	16,186.81	1,079.13	
NASCAR Initial TL	23,590.43	100.93	23,809.82	91.00	21,467.29	2,342.53	
NATIONAL INTERGOV TRM	320,129.38	99.91	319,862.71	92.13	294,919.19	24,943.52	
NAVISTAR B TRM	97,877.17	100.16	98,033.77	91.00	89,068.22	8,965.55	
NEXSTAR BROADCAST TRM B4	24,015.63	100.69	24,181.33	93.00	22,334.53	1,846.80	
NOURYON FIN BV TL B01	3,936.32	100.33	3,949.43	89.75	3,532.84	416.59	
NOURYON FIN BV TL B02	20,242.54	100.33	20,310.00	89.75	18,167.67	2,142.33	
NUMERICABL USD TLB-11 TL	291,750.00	99.75	291,020.62	88.50	258,198.75	32,821.87	
NUMERICABLE \$ TLB13 IRL	197,500.00	100.46	198,408.50	94.25	186,143.75	12,264.75	
PANTHER BF AGGRE 2ND TLB	74,812.50	100.66	75,311.27	90.00	67,331.25	7,980.02	
PARAGON OFFSHORE TL	1,633.68	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
PEABODY ENERGY CORP TL B	23,063.22	87.00	20,065.00	47.25	10,897.37	9,167.63	
PISCES MIDCO INITL TL	147,750.00	100.00	147,750.00	89.50	132,236.25	15,513.75	
PLAYTIKA TL B	350,000.00	101.31	354,593.75	91.75	321,125.00	33,468.75	
PRAIRIE ECI ACQUIOR TRM	165,973.48	99.59	165,299.29	79.33	131,672.23	33,627.06	
PRESTIGE BRANDS B4 TRM	50,757.05	100.75	51,137.72	94.00	47,711.62	3,426.10	
PRISO ACQUISI TL B	71,089.42	97.75	69,489.90	93.00	66,113.16	3,376.74	
REYNOLDS CONSUMER PR TRM	25,000.00	99.87	24,968.75	92.94	23,234.37	1,734.38	
REYNOLDS GROUP US IRL	53,509.05	100.62	53,840.80	93.75	50,164.73	3,676.07	
REYNOLDS GROUP US IRL #2	32,667.66	100.62	32,870.19	93.75	30,625.93	2,244.26	
REYNOLDS GROUP US IRL #3	144,975.59	100.62	145,874.43	93.75	135,914.61	9,959.82	
RHP HOTEL PROP B TRM NEW	97,348.76	100.62	97,957.18	93.75	91,264.46	6,692.72	
RP CROWN PARENT INIT TLB	24,433.27	100.68	24,601.24	93.00	22,722.94	1,878.30	
SCIENTIFIC GAMES B5 TL01	98,397.60	100.77	99,160.17	85.00	83,637.96	15,522.21	
SCIENTIFIC GAMES B5 TL02	23,918.66	100.77	24,104.02	85.00	20,330.86	3,773.16	
SCIENTIFIC GAMES B5 TL08	312.03	100.77	314.45	85.00	265.22	49.23	
SERTA SIMMONS INT TL #1	226,365.38	67.00	151,664.80	51.33	116,200.81	35,463.99	
SERTA SIMMONS INT TL #2	64,634.62	67.00	43,305.19	51.33	33,179.08	10,126.11	
SERTA SIMMONS TRM 2L	47,466.67	29.57	14,036.55	25.00	11,866.66	2,169.89	
SINCLAIR TELEVI TRM B-2b	49,875.00	100.31	50,030.85	90.00	44,887.50	5,143.35	
SMG US MIDCO 2 TRM	172,812.50	100.22	173,196.28	85.00	146,890.62	26,305.66	
SPECTACLE GARY HLDNGS TL	326,351.35	102.50	334,510.13	93.00	303,506.75	31,003.38	
SPORTS AUTHORITY TRM B	33,486.49	0.10	33.48	0.10	33.48	0.00	
STAPLES 2019 RFNIG B1 TL	272,937.50	98.10	267,751.68	91.33	249,282.82	18,468.86	
STARS GROUP TRM 01	197,065.85	100.85	198,740.90	95.33	187,869.37	10,871.53	
STARS GROUP TRM 02	17,807.42	100.85	17,960.45	95.33	16,976.40	984.05	

SURGERY PARTNERS INIT TL	73,559.35	100.06	73,605.32	89.00	65,467.82	8,137.50	
TACALA INVESTMENT 1L TRM	49,125.00	100.43	49,339.92	94.33	46,341.23	2,998.69	
TEAM HEALTH INITIAL TL	121,562.50	80.87	98,313.67	74.85	90,989.53	7,324.14	
TEMPO ACQUISITION INIT TL	73,125.00	100.62	73,582.03	92.50	67,640.62	5,941.41	
TEREX CORP U.S. TRM	48,625.00	100.12	48,685.78	94.00	45,707.50	2,978.28	
TOWNSQUARE MEDIA TL B01	44,098.76	100.62	44,374.37	95.25	42,004.06	2,370.31	
TRANSDIGM REFIN TL E	92,585.65	100.51	93,063.02	90.50	83,790.01	9,273.01	
TRANSDIGM REFIN TL F	165,517.82	100.54	166,414.43	90.50	149,793.62	16,620.81	
TRANSDIGM REFIN TL G	316,907.48	100.48	318,442.57	90.75	287,593.53	30,849.04	
UFC TRM 1ST LIEN	98,054.16	100.82	98,863.10	91.50	89,719.55	9,143.55	
UNIFRAX USD TERM LOAN	123,750.00	95.12	117,717.18	81.75	101,165.62	16,551.56	
UNITED SITE INITIAL TRM #3	375.71	100.37	377.11	92.00	345.65	31.46	
UNITED SITE INITIAL TRM 1L	146,529.03	100.37	147,078.51	92.00	134,806.70	12,271.81	
UNITED SITE INITIAL TRM 2L	100,000.00	97.00	97,000.00	87.00	87,000.00	10,000.00	
USI HOLDINGS INITIAL TRM	97,872.83	100.06	97,934.00	91.00	89,064.27	8,869.73	
VALEANT PH F4 TR B #1 TL	56,773.12	100.68	57,163.43	93.25	52,940.93	4,222.50	
VALEANT PHM FIRST IRL TL	106,250.00	100.51	106,800.26	94.44	100,339.84	6,460.42	
VERSCEND TRM B LOANS	49,375.00	100.50	49,621.87	94.75	46,782.81	2,839.06	
VERTIV GROUP TL B	100,000.00	99.50	99,500.00	91.00	91,000.00	8,500.00	
WERNER INTER INITIAL TRM	247,857.18	99.50	246,617.89	91.00	225,550.03	21,067.86	
WESTERN DIGITAL TRM B-4	22,691.83	100.31	22,762.17	94.50	21,443.77	1,318.40	
WILSONART TRANCHE D TL01	233,436.70	100.62	234,895.67	92.00	214,761.76	20,133.91	
WINDSTREAM SERVICES TRM	125,000.00	100.12	125,156.25	99.50	124,375.00	781.25	
WOODFORD EXPRESS INITIAL TRM	171,931.31	85.50	147,001.27	81.75	140,553.84	6,447.43	
ZAYO INITIAL DOLLAR TL	75,000.00	99.75	74,812.50	91.19	68,390.62	6,421.88	
小計			15,907,628.47		14,325,146.77	1,582,481.70	
銘柄数：172			(1,700,684,559)		(1,531,501,441)	(169,183,118)	
組入時価比率：38.9%					100.0%		
貸付債権計			1,700,684,559		1,531,501,441	169,183,118	
			(1,700,684,559)		(1,531,501,441)	(169,183,118)	
					100.0%		
合計			1,700,684,559		1,531,501,441	169,183,118	
			(1,700,684,559)		(1,531,501,441)	(169,183,118)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

2020年3月31日現在

資産総額	7,137,894,928円
負債総額	3,480,021,223円

純資産総額(-)	3,657,873,705円
発行済口数	4,543,225,426口
1口当たり純資産額(/)	0.8051円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

<更新後>

(1)資本金の額

2020年3月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

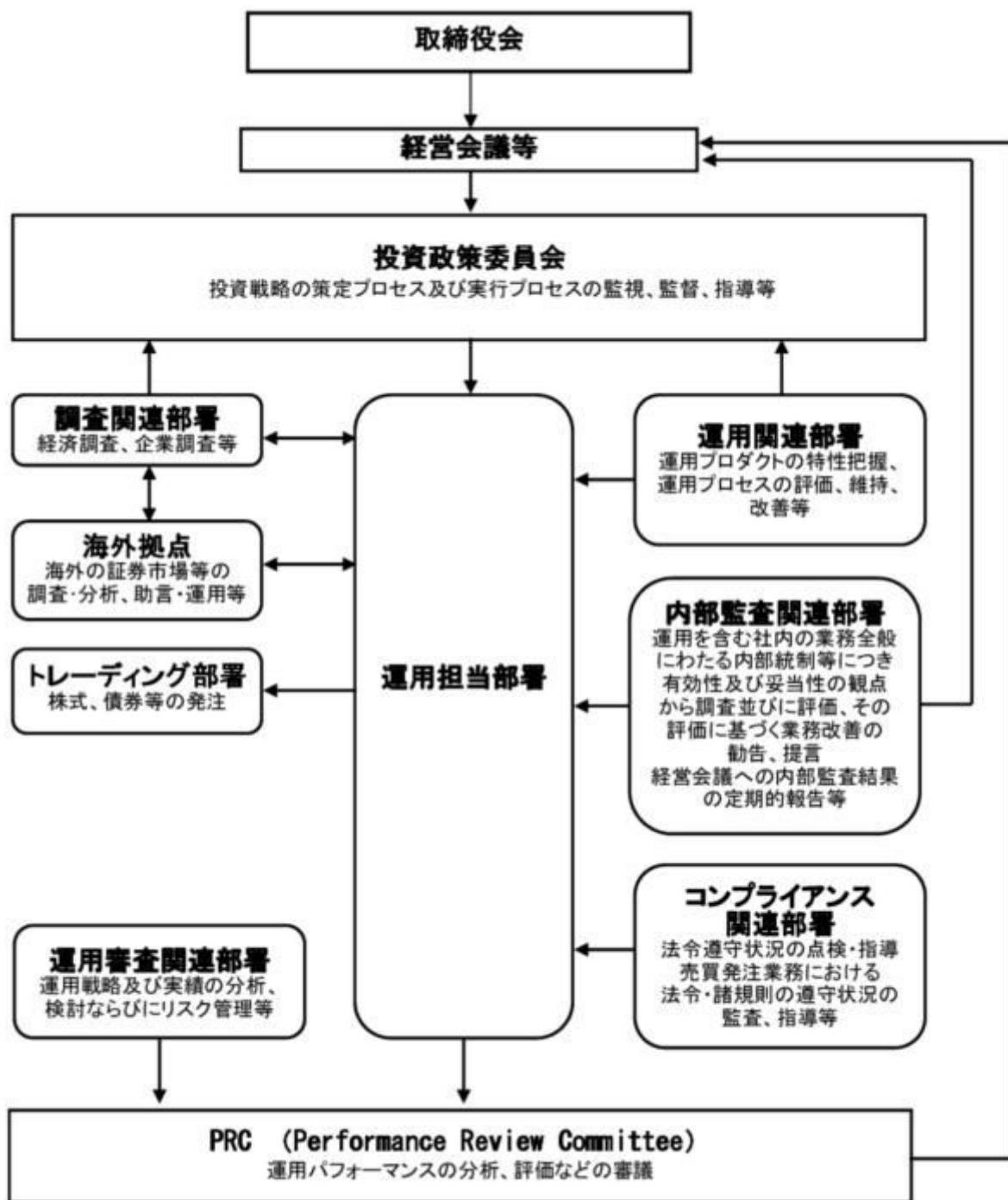
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年2月28日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,004	27,856,953
単位型株式投資信託	184	891,086
追加型公社債投資信託	14	5,668,377
単位型公社債投資信託	455	1,701,274
合計	1,657	36,117,690

3 委託会社等の経理状況

<更新後>

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		金額(百万円)	金額(百万円)	金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金		919		1,562	
金銭の信託		47,936		45,493	
有価証券		22,600		19,900	
前払金		0		-	
前払費用		26		27	
未収入金		464		500	
未収委託者報酬		24,059		25,246	
未収運用受託報酬		6,764		5,933	

その他			181		269
貸倒引当金			15		15
流動資産計			102,937		98,917
固定資産					
有形固定資産			874		714
建物	2	348		320	
器具備品	2	525		393	
無形固定資産			7,157		6,438
ソフトウェア		7,156		6,437	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,825		18,608
投資有価証券		1,184		1,562	
関係会社株式		9,033		12,631	
従業員長期貸付金		36		-	
長期差入保証金		54		235	
長期前払費用		36		22	
前払年金費用		2,350		2,001	
繰延税金資産		3,074		2,694	
その他		168		168	
貸倒引当金		0		-	
投資損失引当金		-		707	
固定資産計			23,969		25,761
資産合計			126,906		124,679

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			133		145
未払金	1		17,853		16,709
未払収益分配金		1		0	
未払償還金		31		25	
未払手数料		7,884		7,724	
関係会社未払金		7,930		7,422	
その他未払金		2,005		1,535	
未払費用	1		12,441		11,704
未払法人税等			2,241		1,560
前受収益			33		29
賞与引当金			4,626		3,792
流動負債計			37,329		33,942
固定負債					
退職給付引当金			2,938		3,219
時効後支払損引当金			548		558
固定負債計			3,486		3,777
負債合計			40,816		37,720
(純資産の部)					
株主資本			86,078		86,924
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729

資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,168		56,014
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,483		55,329	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,876		30,723	
評価・換算差額等			11		33
その他有価証券評価差額金			11		33
純資産合計		86,090		86,958	
負債・純資産合計		126,906		124,679	

(2) 損益計算書

区分	注記番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			115,907		119,196
運用受託報酬			26,200		21,440
その他営業収益			338		355
営業収益計			142,447		140,992
営業費用					
支払手数料			45,252		42,675
広告宣伝費			1,079		1,210
公告費			0		0
調査費			30,516		30,082
調査費		5,830		5,998	
委託調査費		24,685		24,083	
委託計算費			1,376		1,311
営業雑経費			5,464		5,435
通信費		125		92	
印刷費		966		970	
協会費		79		86	
諸経費		4,293		4,286	
営業費用計			83,689		80,715
一般管理費					
給料			11,716		11,113
役員報酬		425		379	
給料・手当		6,856		7,067	
賞与		4,433		3,666	
交際費			132		107
旅費交通費			482		514
租税公課			1,107		1,048
不動産賃借料			1,221		1,223
退職給付費用			1,110		1,474
固定資産減価償却費			2,706		2,835

諸経費		9,131		10,115
一般管理費計		27,609		28,433
営業利益		31,148		31,843

区分	注記番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,031		6,538	
受取利息		4		0	
その他		362		424	
営業外収益計			4,398		6,964
営業外費用					
支払利息		2		1	
金銭の信託運用損		312		489	
時効後支払損引当金繰入額		13		43	
為替差損		46		34	
その他		31		17	
営業外費用計			405		585
経常利益			35,141		38,222
特別利益					
投資有価証券等売却益	3	20		20	
関係会社清算益		-		29	
株式報酬受入益		75		85	
特別利益計			95		135
特別損失					
投資有価証券等評価損		2		938	
関係会社株式評価損		-		161	
固定資産除却損	2	58		310	
投資損失引当金繰入額		-		707	
特別損失計			60		2,118
税引前当期純利益			35,176		36,239
法人税、住民税及び事業税			10,775		10,196
法人税等調整額			439		370
当期純利益			24,840		25,672

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本				
		資本剰余金		利益剰余金	
					その他利益剰余金

	資本金	資本準備金	その他資本 剩余金	資本 剩余金 合計	利益 準備金	別途 積立金	繰 越 利益 剩余金	利益 剩余金 合計	株主 資本 合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剩余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位:百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41	41	86,878
当期変動額			
剩余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目 の当期変動額(純 額)	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剩余金			利益剩余金				株主 資本 合計
		資本 準備金	その他 資本 剩余金	資本 剩余金 合計	利益 準備金	別途 積立金	繰 越 利益 剩余金	利益 剩余金 合計	
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剩余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証 券評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
剩余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの … 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方 法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得 した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した 建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアに ついては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法に よっております。

4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっています。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしてあります。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あります。 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あります。</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) 投資損失引当金 子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p>
5. 消費税等の会計処理方法	
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]

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[表示方法の変更に関する注記]

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」2,111百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」3,074百万円に含めて表示しております。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,781百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,434百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 736百万円 器具備品 3,106 合計 3,842

損益計算書関係

前事業年度 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,026百万円 支払利息 2	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 6,531百万円 支払利息 1
2. 固定資産除却損 建物 4百万円 器具備品 0 ソフ　ト　ウ　エ 53 合計 58	2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 3 ソフ　ト　ウ　エ 307 合計 310
	3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円

基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

金融商品関係

前事業年度（自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っています。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います。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2018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	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-
その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

す。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	919	-	-	-
金銭の信託	47,936	-	-	-
未収委託者報酬	24,059	-	-	-
未収運用受託報酬	6,764	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバ

ティピ取引については、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取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っています。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-
(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティ取引に関して

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あります。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あります。

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2018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(2018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(2018年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2018年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2019年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

(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	18,163百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	929百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	887

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企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	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用收益率の設定方法

年金資産の長期期待運用收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收益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
長期期待運用收益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金	賞与引当金
退職給付引当金	退職給付引当金
投資有価証券評価減	投資有価証券評価減
未払事業税	未払事業税
投資損失引当金	投資損失引当金
ゴルフ会員権評価減	ゴルフ会員権評価減
時効後支払損引当金	時効後支払損引当金
減価償却超過額	減価償却超過額
子会社株式売却損	子会社株式売却損
未払社会保険料	未払社会保険料
その他	その他
繰延税金資産小計	繰延税金資産小計
評価性引当額	評価性引当額
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金	その他有価証券評価差額金
前払年金費用	前払年金費用
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率	法定実効税率
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
外国税額控除	外国税額控除
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
その他	その他
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率

セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）製品・サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）製品・サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

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

親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等 役員の兼任	資金の借入 (*1)	3,000	短期借 入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	2	未払費用	-

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等 の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の 子会社	野村證券株式 会社	東京都 中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売出の取 扱ならびに投 資信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (*2)	37,482	未払手数 料	6,691

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等 の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
							資金の借入 (*1)	3,000		

親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等 役員の兼任	資金の返済	3,000	短期借入 金	-
							借入金利息 の支払	1	未払費用	-

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等 の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の 子会社	野村證券株式 会社	東京都 中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売出の取 扱ならびに投 資信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (*2)	34,646	未払手数 料	6,410

(エ) 役員及び個人主要株主等
該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス株(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

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1 株当たり純資産額	16,714円33銭	1 株当たり純資産額	16,882円89銭
1 株当たり当期純利益	4,822円68銭	1 株当たり当期純利益	4,984円30銭

潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎	1株当たり当期純利益の算定上の基礎
損益計算書上の当期純利益 24,840百万円	損益計算書上の当期純利益 25,672百万円
普通株式に係る当期純利益 24,840百万円	普通株式に係る当期純利益 25,672百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	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。	該当事項はありません。
普通株式の期中平均株式数 5,150,693株	普通株式の期中平均株式数 5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		2019年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,212
金銭の信託		42,268
有価証券		5,800
未収委託者報酬		25,161
未収運用受託報酬		4,788
その他		957
貸倒引当金		15
流動資産計		81,173
固定資産		
有形固定資産	1	679
無形固定資産		5,940
ソフトウェア		5,939
その他		0
投資その他の資産		17,485
投資有価証券		1,362
関係会社株式		12,869
前払年金費用		1,736
繰延税金資産		2,096
その他		420
投資損失引当金		999
固定資産計		24,105
資産合計		105,278

		2019年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		11,888
未払収益分配金		0
未払償還金		25
未払手数料		7,472
関係会社未払金		3,649
その他未払金	2	739
未払費用		9,291
未払法人税等		1,661
賞与引当金		2,294
その他		181

流動負債計		25,317
固定負債		
退職給付引当金		3,267
時効後支払損引当金		565
固定負債計		3,832
負債合計		29,150
(純資産の部)		
株主資本		76,122
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		45,212
利益準備金		685
その他利益剰余金		44,527
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,920
評価・換算差額等		6
その他有価証券評価差額金		6
純資産合計		76,128
負債・純資産合計		105,278

中間損益計算書

		自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		58,947
運用受託報酬		8,401
その他営業収益		158
営業収益計		67,507
営業費用		
支払手数料		20,298
調査費		13,552
その他営業費用		3,856
営業費用計		37,706
一般管理費	1	14,394
営業利益		15,406
営業外収益	2	5,561
営業外費用	3	27
経常利益		20,940
特別利益	4	44
特別損失	5	410
税引前中間純利益		20,574

法人税、住民税及び事業税		5,116
法人税等調整額		610
中間純利益		14,847

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位：百万円)

資本金	株主資本									株主資本合計	
	資本剰余金			利益剰余金							
	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金別途積立金	繰越利益	利益剰余金合計				
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924		
当中間期変動額											
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650		
中間純利益							14,847	14,847	14,847		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）											
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	10,802	10,802	10,802		
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	19,920	45,212	76,122		

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当中間期変動額			
剰余金の配当			25,650
中間純利益			14,847
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	27	27	27
当中間期変動額合計	27	27	10,830
当中間期末残高	6	6	76,128

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式…移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>時価のあるもの…中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)</p> <p>時価のないもの…移動平均法による原価法</p>
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産</p> <p>定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
4 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金</p> <p>一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金</p> <p>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</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。</p> <p>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金</p> <p>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) 投資損失引当金</p> <p>子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p>
5 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
6 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2019年9月30日現在

1 有形固定資産の減価償却累計額	3,881百万円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

中間損益計算書関係

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	38百万円
無形固定資産	1,145百万円
2 営業外収益のうち主要なもののうち	
受取配当金	4,936百万円
金銭信託運用益	433百万円
3 営業外費用のうち主要なもののうち	
時効後支払損引当金繰入	10百万円
為替差損	6百万円
4 特別利益の内訳	
投資有価証券等売却益	1百万円
株式報酬受入益	43百万円
5 特別損失の内訳	
投資有価証券等評価損	119百万円
投資損失引当金繰入額	291百万円

中間株主資本等変動計算書関係

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日	
1 発行済株式に関する事項	
株式の種類	当事業年度期首
普通株式	5,150,693株
増加	
減少	
当中間会計期間末	5,150,693株
2 配当に関する事項	
配当金支払額	
2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。	
・普通株式の配当に関する事項	
(1) 配当金の総額	25,650百万円
(2) 1株当たり配当額	4,980円
(3) 基準日	2019年3月31日
(4) 効力発生日	2019年6月28日

金融商品関係

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,212	2,212	-
(2)金銭の信託	42,268	42,268	-
(3)未収委託者報酬	25,161	25,161	-
(4)未収運用受託報酬	4,788	4,788	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	5,800	5,800	-
資産計	80,231	80,231	-
(6)未払金	11,888	11,888	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,472	7,472	-
関係会社未払金	3,649	3,649	
その他未払金	739	739	-
(7)未払費用	9,291	9,291	-
(8)未払法人税等	1,661	1,661	-
負債計	22,841	22,841	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 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（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,362百万円、関係会社株式12,869百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができるず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（5）有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

有価証券関係

当中間会計期間末（2019年9月30日）

1. 満期保有目的の債券(2019年9月30日)

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式(2019年9月30日)

該当事項はありません。

3. その他有価証券(2019年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの 譲渡性預金			-
小計	5,800	5,800	-
合計	5,800	5,800	-

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

1 株当たり情報

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日	
1 株当たり純資産額	14,780円24銭
1 株当たり中間純利益	2,882円67銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。	
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。	
中間純利益	14,847百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	14,847百万円
期中平均株式数	5,150千株

第2【その他の関係法人の概況】**1 名称、資本金の額及び事業の内容**

<更新後>

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社 (再信託受託者：日本マスター トラスト信託銀行株式会社)	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2020年2月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

* 2020年2月末現在

(3) 投資顧問会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容

NOMURA CORPORATE RESEARCH AND ASSET MANAGEMENT INC. (ノムラ・コーポレート・リサー チ・アンド・アセット・マネ ジメント・インク)	47,293,610.10 ド ル	米国の1940年投資顧問法に基づき合衆国証券取引 委員会(SEC)に登録され当該法律の定める範囲内で 行なう投資顧問業およびそれに付随する一切の業 務を営んでいます。
---	----------------------	--

* 2019年9月末現在

独立監査人の監査報告書

2020年4月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井純子
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

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」に掲げられているノムラ・ボンド&ローン・ファンドの2019年9月18日から2020年3月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ノムラ・ボンド&ローン・ファンドの2020年3月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井純子
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 櫻井雄一郎
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 津村健二郎
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

櫻井雄一郎

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

津村健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

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

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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