

【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】	2021年1月19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】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ）
【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。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 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、半期報告書を提出いたしましたので、2020年7月15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

なお、原届出書の「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況」において「1財務諸表」につきましては「中間財務諸表」が追加され、「2ファンドの現況」につきましては内容を更新・訂正いたします。

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。

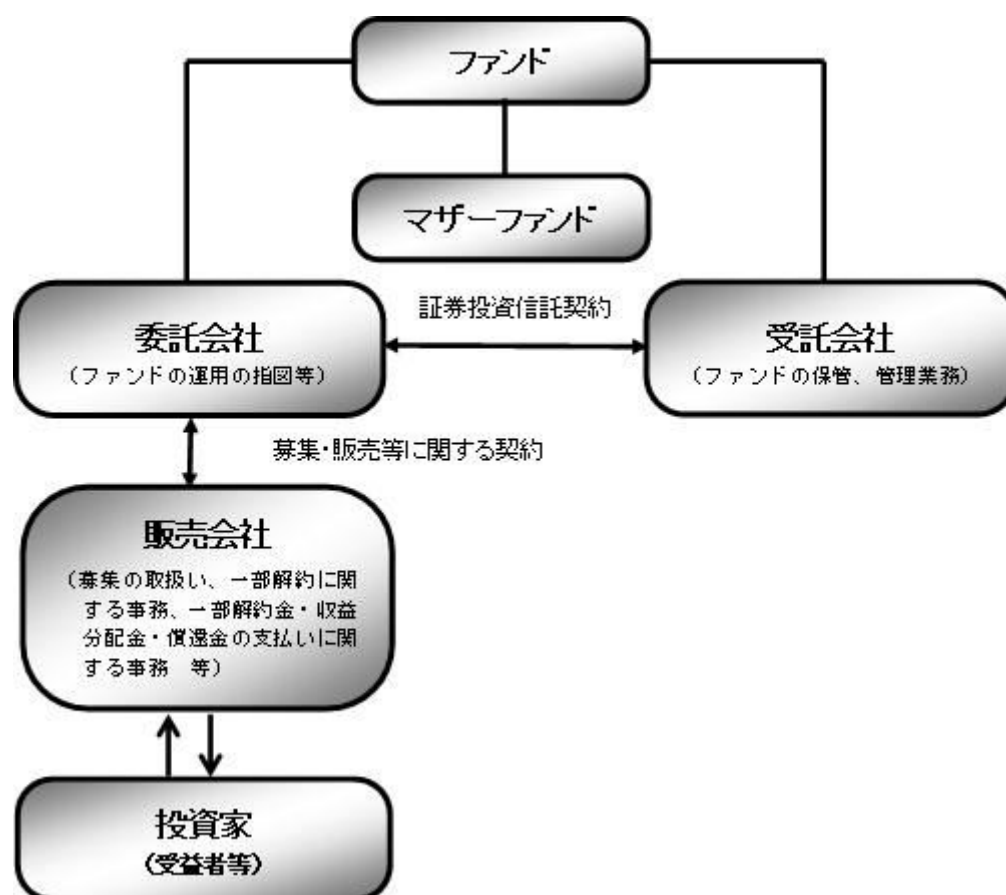
第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

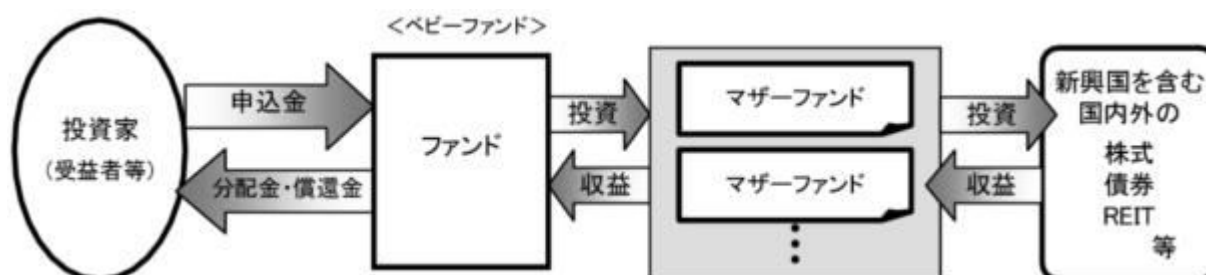
(3) ファンドの仕組み

<更新後>



《ファミリーファンド方式について》

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



ファンド	インデックス・ ブレンド (タイプ)	インデックス・ ブレンド (タイプ)	インデックス・ ブレンド (タイプ)	インデックス・ ブレンド (タイプ)	インデックス・ ブレンド (タイプ)
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド				
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド				
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド				
	新興国株式マザーファンド				
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド				
	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド				
	外国債券マザーファンド				
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド				
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド				
	新興国債券マザーファンド				
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド				
	J-REITインデックス マザーファンド				
	海外REITインデックス マザーファンド				
	海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド				
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社				
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社				

上記マザーファンドは2021年1月19日現在のものであり、変更する場合があります。

< 更新後 >

■ 委託会社の概況(2020年11月末現在) ■

・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

・ 資本金の額

17,180百万円

・ 会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・ 大株主の状況

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

2 投資方針

(1) 投資方針

< 更新後 >

- 「インデックス・ブレンド」は、リスク性資産 への投資比率が低い順に「タイプ 」、 「タイプ 」、 「タイプ 」、 「タイプ 」、 「タイプ 」の5つのファンドで構成されています。

当ファンドにおいて、投資対象とするマザーファンドが連動することを目指すインデックス等（インデックス）の過去の値動きや特性などを勘案し、相対的に大きな値動きが想定されるものをリスク性資産とします。

投資対象とする各マザーファンドは、各々以下の指数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。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数	リスク性 資産
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）	○
外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし） ・ MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算した ものです。	○
外国株式為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジあり）	○
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR （預託証書） ^{*1} を含 みます。）	MSCIエマージング・マーケット・インデックス （配当込み・円換算ベース） ・ MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配 当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算 したものです。	○
米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	米国の株式	S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベー ス） ^{（注1）} ・ S&P 500配当貴族指数（配当込み・米ドル建て）をも とに、委託会社が円換算したものです。	○
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合	
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジな し・円ベース）	○
外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッ ジ・円ベース）	
新興国債券（現地通貨建て）マ ザーファンド	現地通貨建ての新興 国の公社債	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（円換算ベース） ・ JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベー ス）をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボン ド・インデックス・プラス（円換算ベース） （注1） ・ JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース）をもとに、委託会社が円換算 したものです。	（注2）

米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	米ドル建てのハイ・イールド社債	ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース） ^{（注1）} ・ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス(USドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
J-REITインデックスマザーファンド	J-REIT ^{*2}	東証REIT指数（配当込み）	○
海外REITインデックスマザーファンド	日本を除く世界各国のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） ・S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）	○

上記は2021年1月19日現在のものであり、変更する場合があります。

- *1 Depositary Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRIは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。
- *2 わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。
- *3 世界の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。
- （注1） マザーファンドでは原則として為替ヘッジを行ないませんが、ファンドにおいて為替ヘッジを行なうことで、実質的に為替ヘッジを行なった当該対象指数へ連動する投資効果を得ることを目指して運用を行なう場合があります。
- （注2） 「新興国債券マザーファンド」への投資にあたっては為替ヘッジを行なうことを原則としており、当ファンドにおいて為替ヘッジ後の当該マザーファンドへの投資についてはリスク性資産とみなしておりません。

- 各ファンドのリスク性資産への投資比率の合計は、信託財産の純資産総額に対してそれぞれ以下の比率を中心とすることを原則とします。

タイプ	タイプ	タイプ	タイプ	タイプ
30%	43%	55%	65%	80%

- ・上記はリスク性資産とみなしたマザーファンドへの投資比率の合計とします。

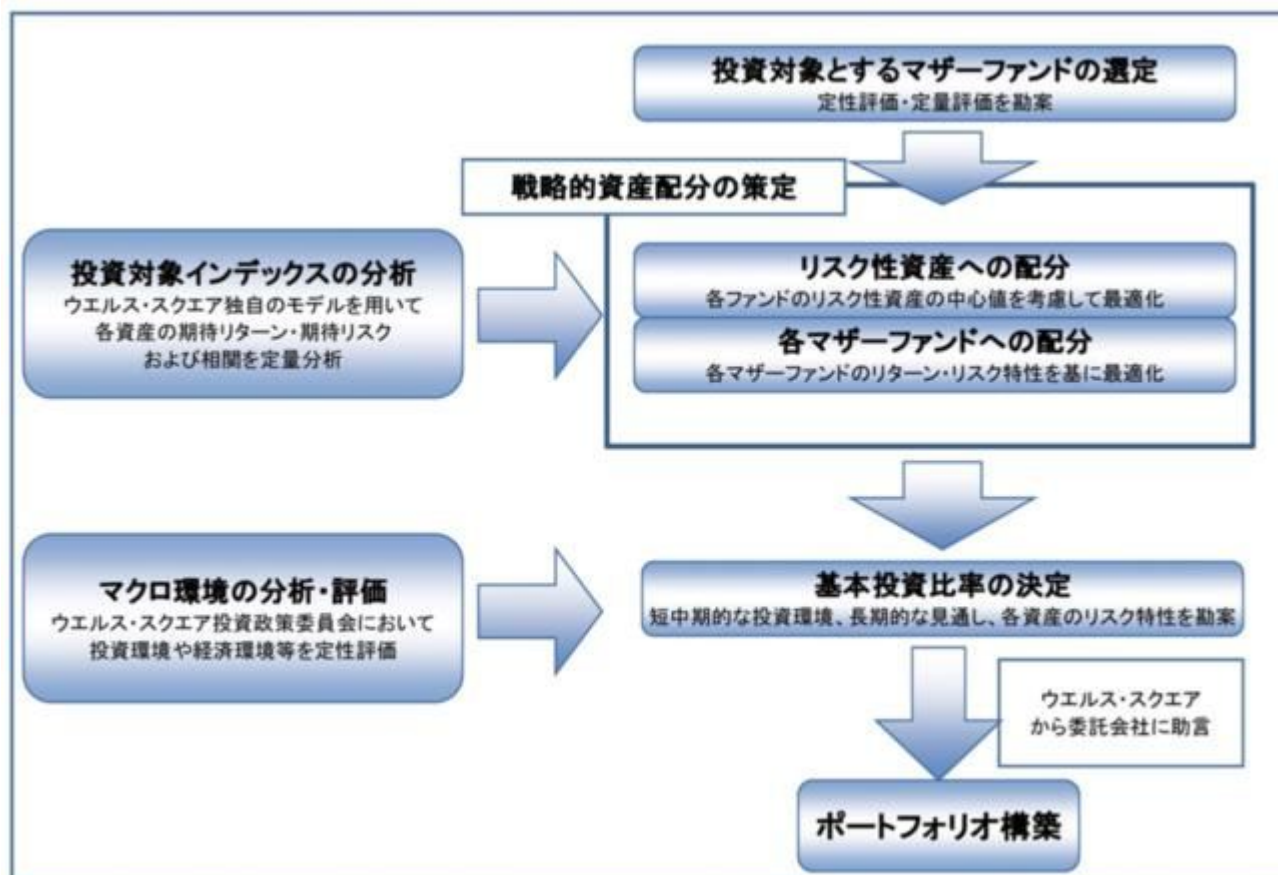
- 株式会社ウエルス・スクエア(ウエルス・スクエア) による以下のプロセスに従った助言に基づいて投資対象とするマザーファンドおよび各マザーファンドへの投資比率を決定します。

ウエルス・スクエア独自のモデルを用いてインデックスを定量的な手法により分析し、リスク性資産への配分および各マザーファンドへの配分を含む戦略的資産配分等を策定します。なお、分析において為替ヘッジを行なう場合と為替ヘッジを行わない場合では異なるインデックスとして扱います。

戦略的資産配分に各種情報や分析を基とした定性的な判断による短期、中期、長期の視点を取り入れ、リスク特性などを勘案して最終的な投資比率（基本投資比率）を決定します。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

投資対象とするマザーファンドについては、定性評価・定量評価等を勘案し、適宜見直しを行ないます。なお、投資対象とするマザーファンドは各種金融指標の動きを捉えることを目的とするマザーファンドから選定することを基本とします。

■ ポートフォリオ構築プロセス ■



* 上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

- 組入マザーファンドとファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、基本投資比率の見直しを定期的に行なうことを基本とします。なお、市況見通しの変化等によっては、適宜リバランスや基本投資比率の見直しを行なう場合があります。また、投資対象とするマザーファンドは適宜見直しを行ないます。
- 基本投資比率の決定において為替ヘッジを行なうこととした実質組入外貨建資産については、マザーファンドもしくはファンドにおいて為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ります。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて効率的な運用を行なうため、先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め実質的に活用する場合があります。

(参考) ウエルス・スクエアについて

■ ウエルス・スクエアの概要 ■

株式会社ウエルス・スクエアは、野村グループの資産運用会社で、主にファンドラップの投資運用サービス等の提供を行ないます。

■ 各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について ■

■東証株価指数（TOPIX）■

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は**㈱東京証券取引所**が有します。

㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。

また**㈱東京証券取引所**は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

本ファンドは、**㈱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ありません。

㈱東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、**㈱東京証券取引所**は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

■「MSCI-KOKUSAI指数」、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」■

MSCI-KOKUSAI指数、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

本ファンドは、MSCI Inc.、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIとその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、本ファンドまたは本ファンドの発行会社あるいは所有者に関わらず、MSCIにより決定、作成、及び計算されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、本ファンドの発行者または所有者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしておりません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性及び／または完全性について保証するものではありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、本件ファンドの発行会社、本件ファンドの所有者その他の個人・法人が、本契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連して本件指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証をおこなうものではありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数及びそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。本件指数及びそれに含まれるデータに関し、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む。）につき、その可能性について知らせを受け

ていたとしても、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

■ S&P 500配当貴族指数 ■

「S&P 500 Dividend Aristocrats Index」（S&P 500配当貴族指数）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが野村アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's^(R) およびS&P^(R) はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが野村アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P 500 Dividend Aristocrats Indexの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexに関して、S&P Dow Jones Indicesと野村アセットマネジメント株式会社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexは野村アセットマネジメント株式会社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500 Dividend Aristocrats Indexの決定、構成または計算において野村アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexに基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追跡する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホルドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P DOW JONES INDICESは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって野村アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESと野村アセットマネジメント株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

■ NOMURA-BPI総合 ■

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

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

■「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディパーシファイド」、

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」■

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

■ブルームバーグ・パークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス■

ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

■東証REIT指数（配当込み）■

東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利及び東証REIT指数（配当込み）の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数（配当込み）の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の商標の使用もしくは東証REIT指数（配当込み）の指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、東証REIT指数（配当込み）の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額と東証REIT指数（配当込み）の指数値の動向が乖離することがあります。

本ファンドは、㈱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ありません。

㈱東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は本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。

■ S&P先進国REIT指数 ■

本ファンドは、スタンダード・amp・プアーズ及びその関連会社（以下、S&P）により、何ら支援、推奨、販売または販促されるものではありません。

S&Pは、ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、証券への全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいはS&P先進国REIT指数の一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックする能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。

S&Pは、被許諾者とは、S&PおよびS&P先進国REIT指数の特定のトレードマークとトレードネームのライセンス使用を与えているのみの関係であり、S&P先進国REIT指数は、被許諾者あるいは本ファンドに関係なくS&Pにより決定、作成、および計算されています。

S&Pは、S&P先進国REIT指数の決定、作成、および計算において、被許諾者あるいは本ファンドの所有者の要求を考慮に入れる義務を一切負いません。

S&Pは、本ファンドの発行価格および発行数量の決定、あるいは本ファンドの発行または販売のタイミングや本ファンドを換金する際の方程式の決定または計算について、責任を負うものではなく、参加もしていません。

S&Pは、本ファンドの管理、マーケティングまたは売買に関連するいかなる義務または責任も負いません。

S&Pは、S&P先進国REIT指数またはそこに含まれるデータの正確性および／または完全性について保証するものではなく、それに関連する過誤、省略または中断に対して責任を負うことはありません。

S&Pは、被許諾者、ファンドの所有者またはその他のいかなる個人・法人がS&P先進国REIT指数またはそこに含まれるデータを使用することによって得られる結果について、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の保証を行いません。

S&Pは、明示的あるいは黙示的保証を行なうものではなく、かつ、S&P先進国REIT指数またはそこに含まれるデータに関連して、特定の目的あるいは使用のための市場性または適切性について何ら保証を行なうものではないことを明記します。

前記事項を制限することなく、S&Pは、たとえ特別の損害、懲罰的損害、間接的損害あるいは結果的損害（逸失利益を含む）につき、その可能性について通知を受けていたとしても、かかる損害について責任を負いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）投資対象

< 更新後 >

各マザーファンドへの投資を通じて、国内外（新興国を含む）の株式、債券、不動産投資信託証券（REIT）等を実質的な主要投資対象とします。なお、投資対象とするマザーファンドにおいて効率的な運用を行なうため、先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

■各マザーファンドの主要投資対象■

マザーファンド名	主要投資対象
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	外国の株式
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	米国の株式
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債
外国債券マザーファンド	外国の公社債
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	米ドル建てのハイ・イールド社債
J-REITインデックスマザーファンド	J-REIT
海外REITインデックスマザーファンド	日本を除く世界各国のREIT
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT

上記は2021年1月19日現在の組入マザーファンドであり、変更する場合があります。

投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（5）投資制限」、及び「（6）投資対象」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

ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産

- ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
- ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
- ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

有価証券の指図範囲等（信託約款）

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された別に定める親投資信託証券（以下「各マザーファンド」といいます。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含

みます。）

6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 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。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 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。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19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
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書ならびに第13号、第14号、第19号および第20号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号、第14号、第19号および第20号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第15号および第16号の証券ならびに第19号の証券または証書のうち第15号および第16号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）

8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）

9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

その他の投資対象

1. 先物取引等

2. スワップ取引

3. クレジットデリバティブ取引

4. 金利先渡取引

「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」という。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」という。）までの期間に係る国内又は海外において代表的利率として公表される預金契約又は金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」という。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額及び当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

5. 為替先渡取引

「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引及び当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいう。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいう。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭又はその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

6. 直物為替先渡取引

「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

(参考)各マザーファンドの概要

（国内株式マザーファンド）

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、東証株価指数(TOPIX)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

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

（外国株式MSCI-KOKUSAI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、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉え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

外国の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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。

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

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

（外国株式為替ヘッジ型マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）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

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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。

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

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

（新興国株式マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的

な動きを概ね捉え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

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

（米国株式配当貴族インデックスマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベース）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

米国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベース）の動きを効率的に捉える投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。また、効率的な運用を行なうため、上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の上場投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

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

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国債券マザーファンド）

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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉え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

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

いません。

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

（外国債券為替ヘッジ型マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、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（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉え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

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、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（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉え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

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉え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

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とし、ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、米国国債に投資する場合があります。

ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の動きを効率的に捉える投資成果を目指すため、債券先物取引等のデリバティブ取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。また、効率的な運用を行なうため、上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は、優先証券のうち株券または新株引受権証書の性質を有するものまたは転換社債を転換、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、）を行使したものおよび社債権者割当等により取得したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

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。

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。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

（J-REITインデックス 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、東証REIT指数（配当込み）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

わが国の不動産投資信託証券（以下「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

(2) 投資態度

J-REIT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。

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超えるJ-REITがある場合には、当該J-REITへ東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

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

（海外REITインデックス 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、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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。

S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）を委託会社において円換算した指数です。

2．運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

海外の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

(2) 投資態度

REIT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。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

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

（海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

海外の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

(2) 投資態度

日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

効率的な運用を行なうため、REIT指数先物取引、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

3 投資リスク

< 更新後 >

■ リスクの定量的比較 (2015年12月末～2020年11月末：月次)

■ タイプⅠ

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	7.5	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 3.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.7	3.7	6.6	4.2	1.5	0.8	0.8

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018 年 1 月から 2020 年 11 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015 年 12 月から 2020 年 11 月の 5 年間（当ファンドは 2018 年 1 月から 2020 年 11 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

■ タイプⅡ

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	10.4	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 5.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	-2.2	3.7	6.6	4.2	1.5	0.8	0.8

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018 年 1 月から 2020 年 11 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015 年 12 月から 2020 年 11 月の 5 年間（当ファンドは 2018 年 1 月から 2020 年 11 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

タイプⅢ

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年12月 2016年11月 2017年11月 2018年11月 2019年11月 2020年11月

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018 年 1 月から 2020 年 11 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	13.2	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 6.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.5	3.7	6.6	4.2	1.5	0.8	0.8

- * 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 12 月から 2020 年 11 月の 5 年間（当ファンドは 2018 年 1 月から 2020 年 11 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

タイプⅣ

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年12月 2016年11月 2017年11月 2018年11月 2019年11月 2020年11月

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018 年 1 月から 2020 年 11 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	15.4	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.6	3.7	6.6	4.2	1.5	0.8	0.8

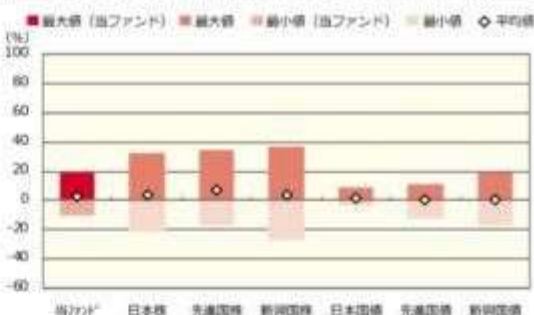
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015 年 12 月から 2020 年 11 月の 5 年間（当ファンドは 2018 年 1 月から 2020 年 11 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

タイプV

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	18.6	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 10.0	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.0	3.7	6.6	4.2	1.5	0.8	0.8

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。

* 年間騰落率は、2018年1月から2020年11月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

* 2015年12月から2020年11月の5年間（当ファンドは2018年1月から2020年11月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

* 決算日に対応した数値とは異なります。

* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：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数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に帰属しています。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、責任を負いません。
 - MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
 - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
 - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・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「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする種類の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMS LLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC. またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4 手数料等及び税金

（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です。

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■ 換金（解約）時および償還時の課税について ■

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、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。

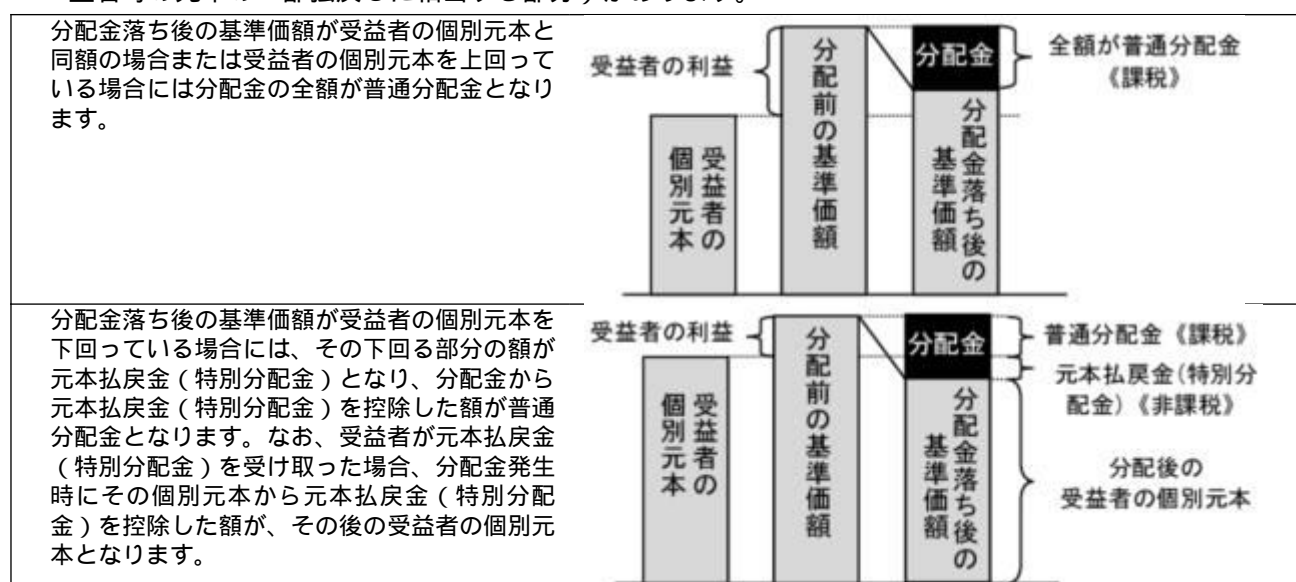
■ 個別元本について ■

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。

* 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11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11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

インデックス・ブレード（タイプ ）

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	139,390,605	99.46
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	751,808	0.53
合計（純資産総額）		140,142,413	100.00

インデックス・ブレード（タイプ ）

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	96,432,897	99.44
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	534,550	0.55
合計（純資産総額）		96,967,447	100.00

インデックス・ブレード（タイプ ）

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	334,919,079	99.47
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,782,607	0.52
合計（純資産総額）		336,701,686	100.00

インデックス・ブレード（タイプ ）

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	88,432,190	99.46
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	476,010	0.53
合計（純資産総額）		88,908,200	100.00

インデックス・ブレード（タイプ ）

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	262,135,649	99.42
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,507,607	0.57
合計（純資産総額）		263,643,256	100.00

（参考）国内株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	421,030,346,150	96.82
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	13,787,882,001	3.17
合計（純資産総額）		434,818,228,151	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	8,777,500,000	2.01

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	540,771,102,010	68.45
	カナダ	25,976,682,435	3.28
	ドイツ	23,507,868,508	2.97
	イタリア	6,130,673,908	0.77
	フランス	28,574,425,224	3.61
	オランダ	11,673,677,439	1.47
	スペイン	6,572,474,319	0.83
	ベルギー	2,425,864,983	0.30
	オーストリア	487,603,680	0.06
	ルクセンブルグ	310,479,346	0.03
	フィンランド	2,654,872,442	0.33
	アイルランド	1,785,063,078	0.22
	ポルトガル	435,610,850	0.05
	イギリス	34,256,285,452	4.33
	スイス	25,069,496,683	3.17
	スウェーデン	8,746,011,760	1.10
	ノルウェー	1,503,870,211	0.19
	デンマーク	6,292,790,493	0.79
	オーストラリア	16,682,939,455	2.11
	ニュージーランド	801,324,713	0.10
	香港	7,641,748,786	0.96
	シンガポール	2,442,752,287	0.30
	イスラエル	820,196,632	0.10
小計		755,563,814,694	95.64
新株予約権証券	スイス	4,315,054	0.00
投資証券	アメリカ	14,594,332,683	1.84
	カナダ	134,400,427	0.01
	フランス	473,077,837	0.05

	イギリス	426,691,188	0.05
	オーストラリア	1,294,349,154	0.16
	香港	352,886,320	0.04
	シンガポール	391,696,308	0.04
	小計	17,667,433,917	2.23
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	16,748,146,413	2.12
合計（純資産総額）		789,983,710,078	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,745,977,046	1.10
	買建	カナダ	414,540,750	0.05
	買建	ドイツ	1,339,895,987	0.16
	買建	イギリス	546,459,210	0.06
	買建	スイス	397,460,484	0.05
	買建	オーストラリア	241,222,445	0.03

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	42,298,165,571	67.81
	カナダ	2,030,778,683	3.25
	ドイツ	1,839,939,446	2.94
	イタリア	478,309,225	0.76
	フランス	2,239,764,407	3.59
	オランダ	914,125,984	1.46
	スペイン	514,583,338	0.82
	ベルギー	191,178,447	0.30
	オーストリア	37,298,080	0.05
	ルクセンブルグ	22,007,909	0.03
	フィンランド	208,084,778	0.33
	アイルランド	140,435,965	0.22
	ポルトガル	33,669,740	0.05
	イギリス	2,682,503,993	4.30
	スイス	1,961,535,016	3.14
	スウェーデン	681,450,597	1.09
	ノルウェー	117,110,478	0.18
	デンマーク	491,153,696	0.78
	オーストラリア	1,305,187,705	2.09
	ニュージーランド	62,188,681	0.09

	香港	595,997,046	0.95
	シンガポール	190,692,008	0.30
	イスラエル	62,966,792	0.10
	小計	59,099,127,585	94.74
新株予約権証券	スイス	332,861	0.00
投資証券	アメリカ	1,140,711,206	1.82
	カナダ	10,129,234	0.01
	フランス	32,589,724	0.05
	イギリス	31,148,590	0.04
	オーストラリア	101,621,336	0.16
	香港	28,832,780	0.04
	シンガポール	31,202,943	0.05
	小計	1,376,235,813	2.20
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,901,107,055	3.04
合計（純資産総額）		62,376,803,314	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	963,379,761	1.54
	買建	カナダ	49,744,890	0.07
	買建	ドイツ	144,972,352	0.23
	買建	イギリス	61,697,007	0.09
	買建	スイス	48,177,028	0.07
	買建	オーストラリア	38,087,754	0.06

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	8,703,627,895	16.82
	メキシコ	840,853,375	1.62
	ブラジル	2,427,674,283	4.69
	チリ	102,966,963	0.19
	コロンビア	42,814,368	0.08
	ギリシャ	58,986,312	0.11
	イギリス	32,981,827	0.06
	トルコ	169,455,418	0.32
	チェコ	46,548,696	0.08
	ハンガリー	100,051,514	0.19
	ポーランド	333,198,437	0.64
	香港	11,107,158,309	21.47

	マレーシア	784,377,747	1.51
	タイ	969,173,156	1.87
	フィリピン	367,188,968	0.70
	インドネシア	698,891,014	1.35
	韓国	6,296,876,243	12.17
	台湾	6,134,935,178	11.85
	インド	4,409,904,510	8.52
	パキスタン	10,325,393	0.01
	カタール	358,737,436	0.69
	エジプト	44,303,451	0.08
	南アフリカ	1,715,013,199	3.31
	アラブ首長国連邦	280,200,764	0.54
	サウジアラビア	1,277,696,933	2.46
	小計	47,313,941,389	91.46
投資信託受益証券	アメリカ	2,006,280,046	3.87
投資証券	メキシコ	21,514,376	0.04
	南アフリカ	16,165,514	0.03
	小計	37,679,890	0.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,373,746,349	4.58
合計（純資産総額）		51,731,647,674	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
 評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,918,147,038	3.70
	買建	シンガポール	416,555,886	0.80

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	29,471,823,008	94.47
投資信託受益証券	アメリカ	16,618,244	0.05
投資証券	アメリカ	1,526,912,688	4.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	180,255,279	0.57
合計（純資産総額）		31,195,609,219	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
 評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	170,008,191	0.54

（参考）国内債券NOMURA - B P I 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	560,592,933,830	79.73
地方債証券	日本	48,259,233,028	6.86
特殊債券	日本	60,008,904,481	8.53
社債券	日本	29,662,171,350	4.21
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	4,529,950,785	0.64
合計（純資産総額）		703,053,193,474	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	246,167,347,309	42.80
	カナダ	11,363,863,743	1.97
	メキシコ	4,672,006,067	0.81
	ドイツ	39,646,716,980	6.89
	イタリア	57,943,167,909	10.07
	フランス	57,629,427,556	10.02
	オランダ	9,707,494,056	1.68
	スペイン	39,181,423,382	6.81
	ベルギー	14,591,351,485	2.53
	オーストリア	8,270,789,255	1.43
	フィンランド	2,693,856,509	0.46
	アイルランド	7,170,559,893	1.24
	イギリス	37,811,549,068	6.57
	スウェーデン	1,898,012,254	0.33
	ノルウェー	1,252,209,057	0.21
	デンマーク	3,251,090,362	0.56
	ポーランド	3,598,571,205	0.62
	オーストラリア	15,363,453,603	2.67
	シンガポール	2,486,393,910	0.43
	マレーシア	2,854,814,175	0.49
	イスラエル	2,459,263,989	0.42
	小計	570,013,361,767	99.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	5,102,102,797	0.88
合計（純資産総額）		575,115,464,564	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	32,332,582,588	42.25
	カナダ	1,435,682,737	1.87
	メキシコ	595,916,378	0.77
	ドイツ	5,530,635,685	7.22
	イタリア	8,112,776,326	10.60
	フランス	7,854,184,849	10.26
	オランダ	1,408,962,634	1.84
	スペイン	5,420,299,624	7.08
	ベルギー	2,133,011,419	2.78
	オーストリア	1,178,629,417	1.54
	フィンランド	375,953,003	0.49
	アイルランド	713,657,107	0.93
	イギリス	5,170,655,575	6.75
	スウェーデン	205,924,364	0.26
	ノルウェー	145,437,725	0.19
	デンマーク	401,714,807	0.52
	ポーランド	475,035,392	0.62
	オーストラリア	2,007,763,526	2.62
	シンガポール	662,110,954	0.86
	イスラエル	282,792,236	0.36
小計		76,443,726,346	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	69,422,886	0.09
合計（純資産総額）		76,513,149,232	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）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	メキシコ	822,020,449	9.49
	ブラジル	729,608,357	8.43
	チリ	216,955,551	2.50
	コロンビア	477,333,831	5.51
	ペルー	256,715,849	2.96
	ウルグアイ	10,325,608	0.11
	ドミニカ共和国	15,140,537	0.17
	トルコ	178,352,102	2.06
	チェコ	354,290,521	4.09
	ハンガリー	323,054,281	3.73
	ポーランド	690,753,024	7.98
	ロシア	681,901,128	7.87
	ルーマニア	242,437,125	2.80
	マレーシア	581,930,672	6.72

	タイ	746,057,151	8.62
	フィリピン	27,319,896	0.31
	インドネシア	835,940,695	9.65
	南アフリカ	648,869,030	7.49
	中国	645,394,955	7.45
	小計	8,484,400,762	98.03
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	170,433,604	1.96
合計（純資産総額）		8,654,834,366	100.00

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	21,023,913,486	97.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	431,139,951	2.00
合計（純資産総額）		21,455,053,437	100.00

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アメリカ	3,395,941,044	95.84
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	147,120,632	4.15
合計（純資産総額）		3,543,061,676	100.00

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	37,200,265,280	96.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,151,199,346	3.00
合計（純資産総額）		38,351,464,626	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	1,147,840,000	2.99

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	23,368,190,285	72.37
	カナダ	624,475,618	1.93
	ドイツ	96,844,855	0.29
	イタリア	6,242,632	0.01
	フランス	820,134,233	2.54
	オランダ	63,511,165	0.19
	スペイン	156,617,927	0.48
	ベルギー	460,932,254	1.42
	アイルランド	44,251,916	0.13
	シンガポール	18,700,533	0.05
	イギリス	1,824,395,772	5.65
	オーストラリア	2,478,362,606	7.67
	ニュージーランド	160,268,086	0.49
	香港	582,795,480	1.80
	シンガポール	1,236,465,900	3.82
	韓国	25,172,124	0.07
	イスラエル	22,296,843	0.06
	小計	31,989,658,229	99.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	296,947,333	0.91
合計（純資産総額）		32,286,605,562	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	241,076,742	0.74

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	5,184,926,881	70.99
	カナダ	138,142,629	1.89
	ドイツ	21,321,394	0.29
	イタリア	1,337,707	0.01
	フランス	181,968,040	2.49
	オランダ	14,076,209	0.19
	スペイン	35,004,078	0.47
	ベルギー	102,072,371	1.39

	アイルランド	9,867,065	0.13
	シンガポール	4,102,052	0.05
	イギリス	405,224,009	5.54
	オーストラリア	549,890,484	7.52
	ニュージーランド	35,829,017	0.49
	香港	129,765,064	1.77
	シンガポール	273,626,305	3.74
	イスラエル	4,261,174	0.05
	小計	7,091,414,479	97.09
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	212,185,118	2.90
合計（純資産総額）		7,303,599,597	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	154,977,904	2.12

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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 - B P I 総合 マザーファンド	55,414,935	1.3341	73,933,669	1.3296	73,679,697	52.57
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	11,995,556	1.2388	14,860,095	1.2587	15,098,806	10.77
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	5,231,204	1.8836	9,853,496	2.3297	12,187,135	8.69
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - K O K U S A I マザーファンド	2,425,678	2.5893	6,280,809	3.2609	7,909,893	5.64
5	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	3,946,650	1.4565	5,748,296	1.8142	7,160,012	5.10
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	3,510,722	1.8647	6,546,444	1.9960	7,007,401	5.00
7	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,971,636	2.3818	4,696,043	2.4620	4,854,167	3.46
8	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,061,899	1.1274	2,324,585	1.4280	2,944,391	2.10
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	2,232,332	1.1494	2,565,843	1.2497	2,789,745	1.99
10	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マザーファンド	1,012,224	1.8704	1,893,287	2.2116	2,238,634	1.59
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,507,203	1.0999	1,657,773	1.4340	2,161,329	1.54
12	日本	親投資信託 受益証券	J - REITインデックス マザーファンド	626,565	1.9432	1,217,542	2.1696	1,359,395	0.97

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	99.46
合 計	99.46

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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 - B P I 総合 マザーファンド	29,482,074	1.3347	39,351,170	1.3296	39,199,365	40.42
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド	3,139,959	2.5633	8,048,657	3.2609	10,239,092	10.55
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	4,242,959	1.8658	7,916,513	2.3297	9,884,821	10.19
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,306,068	1.4649	6,307,960	1.8142	7,812,068	8.05
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	6,010,770	1.2390	7,447,655	1.2587	7,565,756	7.80
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	3,358,153	1.8645	6,261,277	1.9960	6,702,873	6.91
7	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,351,223	2.3822	3,219,000	2.4620	3,326,711	3.43
8	日本	親投資信託 受益証券	海外R E I Tインデックス マザーファンド	1,310,554	1.8817	2,466,070	2.2116	2,898,421	2.98
9	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	1,765,749	1.1276	1,991,186	1.4280	2,521,489	2.60
10	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,735,198	1.0860	1,884,426	1.4340	2,488,273	2.56
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,526,480	1.1520	1,758,527	1.2497	1,907,642	1.96
12	日本	親投資信託 受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	869,463	1.9540	1,698,931	2.1696	1,886,386	1.94

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	99.44
合 計	99.44

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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 - B P I 総合 マザーファンド	73,913,231	1.3344	98,629,816	1.3296	98,275,031	29.18
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド	20,777,804	2.5566	53,122,452	3.2609	67,754,341	20.12
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	17,462,002	1.4610	25,511,985	1.8142	31,679,564	9.40

4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファン ド	12,332,703	1.8558	22,887,031	2.3297	28,731,498	8.53
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	11,617,520	1.8671	21,691,072	1.9960	23,188,569	6.88
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファン ド	14,600,380	1.2390	18,090,610	1.2587	18,377,498	5.45
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	9,416,934	1.0966	10,326,610	1.4340	13,503,883	4.01
8	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,455,004	2.3821	12,994,366	2.4620	13,430,219	3.98
9	日本	親投資信託 受益証券	海外ＲＥＩＴインデックス マ ザーファンド	5,218,106	1.8701	9,758,844	2.2116	11,540,363	3.42
10	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	7,035,063	1.1239	7,906,708	1.4280	10,046,069	2.98
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	8,025,088	1.1509	9,236,074	1.2497	10,028,952	2.97
12	日本	親投資信託 受益証券	J - ＲＥＩＴインデックス マ ザーファンド	3,854,670	1.9488	7,511,981	2.1696	8,363,092	2.48

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	99.47
合 計	99.47

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,249,285	2.5534	18,510,951	3.2609	23,639,193	26.58
2	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	12,854,873	1.3341	17,149,687	1.3296	17,091,839	19.22
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	5,361,374	1.4610	7,832,968	1.8142	9,726,604	10.94
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファン ド	3,077,389	1.8833	5,795,647	2.3297	7,169,393	8.06
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	3,484,413	1.8750	6,533,275	1.9960	6,954,888	7.82
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	3,763,337	1.1370	4,278,915	1.4340	5,396,625	6.06
7	日本	親投資信託 受益証券	海外ＲＥＩＴインデックス マ ザーファンド	1,777,023	1.8658	3,315,570	2.2116	3,930,064	4.42
8	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファン ド	2,796,955	1.2391	3,465,707	1.2587	3,520,527	3.95
9	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,427,949	2.3853	3,406,087	2.4620	3,515,610	3.95
10	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	1,859,641	1.1197	2,082,241	1.4280	2,655,567	2.98
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	2,106,948	1.1537	2,430,786	1.2497	2,633,052	2.96
12	日本	親投資信託 受益証券	J - ＲＥＩＴインデックス マ ザーファンド	1,013,472	1.9408	1,966,947	2.1696	2,198,828	2.47

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	99.46
合 計	99.46

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	30,003,795	2.5488	76,473,673	3.2609	97,839,375	37.11
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	21,018,269	1.4680	30,854,819	1.8142	38,131,343	14.46
3	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	15,656,559	1.1414	17,871,894	1.4340	22,451,505	8.51
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	8,486,053	1.8869	16,012,334	2.3297	19,769,957	7.49
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	8,366,323	1.8836	15,758,872	1.9960	16,699,180	6.33
6	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	12,451,153	1.3344	16,615,232	1.3296	16,555,053	6.27
7	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	5,392,843	1.8593	10,026,913	2.2116	11,926,811	4.52
8	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	7,539,615	1.1249	8,481,313	1.4280	10,766,570	4.08
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	7,184,462	1.1542	8,292,777	1.2497	8,978,422	3.40
10	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	3,634,783	2.3857	8,671,679	2.4620	8,948,835	3.39
11	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	2,900,689	1.9383	5,622,641	2.1696	6,293,334	2.38
12	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	2,999,336	1.2396	3,718,200	1.2587	3,775,264	1.43

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	99.42
合 計	99.42

（参考）国内株式マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	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	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,927,100	6,660.02	12,834,535,934	6,999.00	13,487,772,900	3.10
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,081,900	7,083.60	7,663,748,906	9,704.00	10,498,757,600	2.41
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,344,700	4,717.61	6,343,780,716	7,272.00	9,778,658,400	2.24
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	156,500	40,120.59	6,278,873,621	53,290.00	8,339,885,000	1.91
5	日本	株式	任天堂	その他製品	105,900	43,774.54	4,635,723,978	59,260.00	6,275,634,000	1.44
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,265,500	2,420.41	5,483,439,158	2,465.00	5,584,457,500	1.28
7	日本	株式	日本電産	電気機器	415,700	6,303.29	2,620,280,585	13,305.00	5,530,888,500	1.27

8	日本	株式	第一三共	医薬品	1,482,700	2,557.80	3,792,464,022	3,694.00	5,477,093,800	1.25
9	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,437,000	3,764.05	5,408,946,868	3,745.00	5,381,565,000	1.23
10	日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,652,900	423.84	4,939,074,876	448.50	5,226,325,650	1.20
11	日本	株式	ダイキン工業	機械	220,000	14,147.73	3,112,501,667	23,665.00	5,206,300,000	1.19
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,182,200	3,321.08	3,926,189,240	4,400.00	5,201,680,000	1.19
13	日本	株式	信越化学工業	化学	290,500	12,156.13	3,531,355,973	17,135.00	4,977,717,500	1.14
14	日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	342,600	9,764.94	3,345,469,848	13,910.00	4,765,566,000	1.09
15	日本	株式	村田製作所	電気機器	507,300	6,074.16	3,081,425,736	9,129.00	4,631,141,700	1.06
16	日本	株式	ファナック	電気機器	162,400	17,890.40	2,905,401,952	25,365.00	4,119,276,000	0.94
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,359,900	2,616.13	3,557,679,268	2,871.50	3,904,952,850	0.89
18	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	109,600	22,847.58	2,504,095,050	35,470.00	3,887,512,000	0.89
19	日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,235,600	3,157.93	3,901,949,940	2,982.50	3,685,177,000	0.84
20	日本	株式	ＳＭＣ	機械	54,200	51,254.31	2,777,983,999	66,320.00	3,594,544,000	0.82
21	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,178,100	2,819.05	3,321,134,227	3,032.00	3,571,999,200	0.82
22	日本	株式	エムスリー	サービス業	363,900	3,742.39	1,361,857,520	9,622.00	3,501,445,800	0.80
23	日本	株式	日立製作所	電気機器	829,900	3,272.82	2,716,117,440	3,966.00	3,291,383,400	0.75
24	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,189,800	2,239.58	2,664,655,740	2,758.50	3,282,063,300	0.75
25	日本	株式	花王	化学	413,500	8,442.38	3,490,926,151	7,808.00	3,228,608,000	0.74
26	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	602,300	4,513.32	2,718,374,993	5,190.00	3,125,937,000	0.71
27	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	175,500	14,293.38	2,508,489,288	17,765.00	3,117,757,500	0.71
28	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,314,800	1,234.77	2,858,261,200	1,327.50	3,072,897,000	0.70
29	日本	株式	中外製薬	医薬品	540,200	4,251.98	2,296,924,175	5,044.00	2,724,768,800	0.62
30	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,115,400	2,415.57	2,694,332,316	2,433.00	2,713,768,200	0.62

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	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.14
		建設業	2.28
		食料品	3.43
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.19
		化学	7.35
		医薬品	5.88
		石油・石炭製品	0.34
		ゴム製品	0.52
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.58
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.59
		機械	5.56

	電気機器	16.41
	輸送用機器	6.78
	精密機器	2.71
	その他製品	2.62
	電気・ガス業	1.28
	陸運業	3.39
	海運業	0.16
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	9.10
	卸売業	4.31
	小売業	4.66
	銀行業	4.41
	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	1.87
	その他金融業	1.07
	不動産業	1.97
	サービス業	5.90
合 計		96.82

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	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	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	2,835,500	7,026.08	19,922,451,825	12,112.53	34,345,093,276	4.34
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	1,178,200	17,084.71	20,129,205,912	22,360.24	26,344,840,306	3.33
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	69,340	214,447.66	14,869,800,758	331,963.87	23,018,374,926	2.91
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	393,300	18,155.81	7,140,682,590	28,861.68	11,351,299,098	1.43
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	49,480	123,171.98	6,094,549,768	186,294.50	9,217,852,310	1.16
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	49,070	123,113.80	6,041,194,441	185,653.50	9,110,017,628	1.15
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	121,340	13,599.20	1,650,127,050	60,854.60	7,384,097,941	0.93
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	432,400	13,902.55	6,011,466,858	14,960.16	6,468,773,184	0.81
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	498,300	9,771.89	4,869,334,481	12,593.54	6,275,363,872	0.79

10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	275,900	17,450.40	4,814,566,270	21,920.79	6,047,945,961	0.76
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	404,900	12,150.97	4,919,929,534	14,400.19	5,830,638,105	0.73
12	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	486,700	11,542.98	5,617,972,260	11,761.43	5,724,288,468	0.72
13	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	100,580	30,343.15	3,051,914,258	55,108.45	5,542,807,951	0.70
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	227,800	19,244.58	4,383,916,144	24,055.72	5,479,895,180	0.69
15	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	155,120	26,777.64	4,153,748,680	35,108.58	5,446,043,953	0.68
16	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	146,200	26,832.70	3,922,942,085	35,225.98	5,150,038,612	0.65
17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	175,900	21,039.80	3,700,901,312	28,672.60	5,043,510,533	0.63
18	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	295,400	10,579.11	3,125,071,664	15,285.33	4,515,288,166	0.57
19	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	676,800	5,717.06	3,869,310,742	6,293.65	4,259,546,516	0.53
20	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	182,400	10,927.15	1,993,112,196	21,961.30	4,005,742,415	0.50
21	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	744,900	3,755.62	2,797,563,945	5,376.30	4,004,811,457	0.50
22	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	114,870	35,588.96	4,088,104,238	34,778.42	3,994,997,680	0.50
23	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	78,800	34,475.89	2,716,700,644	49,558.64	3,905,221,360	0.49
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,277,000	2,307.39	2,946,545,842	3,011.77	3,846,031,695	0.48
25	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア	147,800	17,166.78	2,537,250,616	25,726.28	3,802,344,287	0.48
26	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	71,930	39,622.60	2,850,054,128	51,047.39	3,671,838,791	0.46
27	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	667,300	4,710.37	3,143,231,636	5,475.00	3,653,469,502	0.46
28	アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	231,700	12,186.29	2,823,565,015	15,749.72	3,649,211,051	0.46
29	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	908,800	3,240.32	2,944,811,086	3,867.82	3,515,079,087	0.44
30	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	1,165,000	3,116.70	3,630,955,501	3,015.92	3,513,554,606	0.44

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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.18
		メディア	1.15
		娯楽	1.47
		不動産管理・開発	0.42
		エネルギー設備・サービス	0.14
		石油・ガス・消耗燃料	2.85
		化学	2.19
		建設資材	0.26
		容器・包装	0.30
		金属・鉱業	1.45
		紙製品・林産品	0.10

航空宇宙・防衛	1.55
建設関連製品	0.55
建設・土木	0.27
電気設備	0.85
コングロマリット	1.18
機械	1.71
商社・流通業	0.30
商業サービス・用品	0.43
航空貨物・物流サービス	0.66
旅客航空輸送業	0.06
海運業	0.06
陸運・鉄道	1.10
運送インフラ	0.16
自動車部品	0.27
自動車	1.57
家庭用耐久財	0.36
レジャー用品	0.07
繊維・アパレル・贅沢品	1.49
ホテル・レストラン・レジャー	1.54
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	3.62
複合小売り	0.52
専門小売り	1.64
食品・生活必需品小売り	1.47
飲料	1.73
食品	1.73
タバコ	0.65
家庭用品	1.33
パーソナル用品	0.68
ヘルスケア機器・用品	3.03
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.94
バイオテクノロジー	1.89
医薬品	4.81
銀行	5.61
各種金融サービス	0.93
保険	3.10
情報技術サービス	4.70
ソフトウェア	7.01
通信機器	0.64
コンピュータ・周辺機器	4.59
電子装置・機器・部品	0.54
半導体・半導体製造装置	4.07
各種電気通信サービス	1.63

		無線通信サービス	0.30
		電力	2.01
		ガス	0.16
		総合公益事業	0.93
		水道	0.11
		消費者金融	0.37
		資本市場	2.93
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
		ヘルスケア・テクノロジー	0.17
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.96
		専門サービス	0.71
新株予約権証券	—	—	0.00
投資証券	—	—	2.23
合 計			97.87

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	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	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	221,802	8,807.79	1,953,586,369	12,112.53	2,686,584,510	4.30
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	92,170	19,851.30	1,829,694,432	22,360.24	2,060,943,754	3.30
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	5,424	264,062.40	1,432,274,498	331,963.87	1,800,572,045	2.88
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	30,760	23,465.63	721,802,911	28,861.68	887,785,304	1.42
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,871	150,481.54	582,514,074	186,294.50	721,146,045	1.15
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,839	150,094.03	576,211,014	185,653.50	712,723,816	1.14
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	9,490	22,351.93	212,119,849	60,854.60	577,510,215	0.92
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	33,710	15,315.46	516,284,285	14,960.16	504,306,994	0.80
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	38,980	9,820.72	382,811,732	12,593.54	490,896,415	0.78
10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	21,580	19,452.36	419,782,006	21,920.78	473,050,648	0.75
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	31,670	12,549.91	397,455,713	14,400.19	456,054,109	0.73
12	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	38,070	12,112.08	461,107,247	11,761.43	447,757,678	0.71
13	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	7,870	37,398.32	294,324,795	55,108.45	433,703,505	0.69
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	17,790	18,996.28	337,943,937	24,055.72	427,951,428	0.68

15	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	12,130	30,855.32	374,275,152	35,108.58	425,867,155	0.68
16	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	11,430	29,934.86	342,155,503	35,225.98	402,632,978	0.64
17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	13,760	25,286.82	347,946,726	28,672.60	394,534,991	0.63
18	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	23,110	11,677.23	269,860,924	15,285.33	353,244,108	0.56
19	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	52,940	5,948.74	314,926,369	6,293.65	333,186,159	0.53
20	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	58,200	3,950.93	229,944,516	5,376.30	312,901,097	0.50
21	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	8,990	38,739.14	348,264,882	34,778.42	312,658,041	0.50
22	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	14,210	16,099.83	228,778,631	21,961.30	312,070,174	0.50
23	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	6,140	40,486.97	248,590,008	49,558.64	304,290,091	0.48
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	99,900	2,464.27	246,180,653	3,011.77	300,875,933	0.48
25	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア	11,460	20,352.05	233,234,505	25,726.28	294,823,177	0.47
26	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	5,600	46,678.81	261,401,369	51,047.39	285,865,386	0.45
27	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	52,100	4,855.81	252,988,149	5,475.00	285,247,656	0.45
28	アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	18,090	13,185.71	238,529,653	15,749.72	284,912,507	0.45
29	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	91,000	3,052.28	277,758,227	3,015.92	274,449,330	0.43
30	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	70,900	3,645.50	258,465,957	3,867.82	274,228,771	0.43

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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.14
		メディア	1.11
		娯楽	1.46
		不動産管理・開発	0.40
		エネルギー設備・サービス	0.13
		石油・ガス・消耗燃料	2.82
		化学	2.17
		建設資材	0.25
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.46
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.53
		建設関連製品	0.55
		建設・土木	0.26
		電気設備	0.84
		コングロマリット	1.16
		機械	1.70
		商社・流通業	0.31
		商業サービス・用品	0.43

航空貨物・物流サービス	0.65
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.06
陸運・鉄道	1.09
運送インフラ	0.15
自動車部品	0.26
自動車	1.56
家庭用耐久財	0.34
レジャー用品	0.07
繊維・アパレル・贅沢品	1.48
ホテル・レストラン・レジャー	1.54
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	3.60
複合小売り	0.52
専門小売り	1.63
食品・生活必需品小売り	1.46
飲料	1.72
食品	1.70
タバコ	0.64
家庭用品	1.32
パーソナル用品	0.69
ヘルスケア機器・用品	3.01
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.92
バイオテクノロジー	1.87
医薬品	4.75
銀行	5.55
各種金融サービス	0.92
保険	3.06
情報技術サービス	4.66
ソフトウェア	6.93
通信機器	0.64
コンピュータ・周辺機器	4.57
電子装置・機器・部品	0.52
半導体・半導体製造装置	4.02
各種電気通信サービス	1.61
無線通信サービス	0.30
電力	2.00
ガス	0.15
総合公益事業	0.93
水道	0.11
消費者金融	0.38
資本市場	2.93
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06

		ヘルスケア・テクノロジー	0.17
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.95
		専門サービス	0.73
新株予約権証券	—	—	0.00
投資証券	—	—	2.20
合 計			96.95

（参考）新興国株式マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	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	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	124,950	21,551.44	2,692,852,664	28,723.50	3,589,002,225	6.93
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	370,200	5,748.06	2,127,933,293	7,812.20	2,892,076,440	5.59
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,586,000	1,111.54	1,762,913,225	1,779.96	2,823,016,560	5.45
4	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	500,300	2,926.93	1,464,347,938	4,010.15	2,006,280,046	3.87
5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	306,990	4,654.23	1,428,803,173	6,424.44	1,972,238,836	3.81
6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インター ネット販 売・通信販 売	230,700	1,865.28	430,320,096	4,180.80	964,510,560	1.86
7	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	27,840	20,496.14	570,612,705	21,579.23	600,765,769	1.16
8	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インター ネット販 売・通信販 売	57,010	5,288.34	301,488,312	9,288.80	529,554,767	1.02
9	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,136,000	82.41	505,667,760	81.74	501,556,640	0.96

10	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	182,100	2,229.18	405,934,006	2,721.01	495,497,378	0.95
11	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	383,500	1,057.79	405,664,766	1,228.78	471,237,130	0.91
12	アメリカ	株式	NIO INC ADR	自動車	69,900	778.73	54,433,255	5,610.06	392,143,194	0.75
13	アメリカ	株式	PINDUODUO INC ADR	インターネット販売・通信販売	24,490	8,578.36	210,084,229	14,965.35	366,501,532	0.70
14	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	234,921	973.77	228,760,995	1,526.44	358,593,375	0.69
15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	110,700	2,421.78	268,091,451	3,181.31	352,171,294	0.68
16	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	219,600	984.22	216,135,217	1,551.00	340,599,600	0.65
17	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	34,700	8,001.34	277,646,776	9,306.96	322,951,512	0.62
18	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	52,220	3,993.32	208,531,504	5,821.55	304,001,863	0.58
19	香港	株式	XIAOMI CORPORATION	コンピュータ・周辺機器	795,000	183.38	145,790,661	349.07	277,510,650	0.53
20	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	27,770	7,882.39	218,893,975	9,697.09	269,288,262	0.52
21	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	18,400	10,729.20	197,417,284	14,484.34	266,511,926	0.51
22	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	96,538	1,537.89	148,465,790	2,639.00	254,763,782	0.49
23	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,839,000	68.07	261,328,408	65.25	250,525,462	0.48
24	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	388,500	784.57	304,805,445	637.17	247,540,545	0.47
25	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	788,649	279.77	220,640,646	300.66	237,118,363	0.45
26	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	673,300	277.36	186,746,707	343.91	231,561,021	0.44
27	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	61,000	2,745.98	167,504,850	3,778.30	230,476,696	0.44
28	韓国	株式	LG CHEMICALS LTD	化学	3,000	34,608.80	103,826,427	76,302.00	228,906,000	0.44

29	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	338,800	487.85	165,286,809	667.42	226,123,082	0.43
30	韓国	株式	NAVER CORP	インタラクティブ・メディアおよびサービス	7,770	20,499.61	159,282,013	26,799.90	208,235,223	0.40

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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	7.32
		メディア	0.23
		娯楽	1.10
		不動産管理・開発	1.87
		エネルギー設備・サービス	0.05
		石油・ガス・消耗燃料	4.84
		化学	2.27
		建設資材	0.93
		容器・包装	0.03
		金属・鉱業	3.26
		紙製品・林産品	0.20
		航空宇宙・防衛	0.06
		建設関連製品	0.03
		建設・土木	0.48
		電気設備	0.27
		コングロマリット	0.96
		機械	0.34
		商社・流通業	0.02
		商業サービス・用品	0.19
		航空貨物・物流サービス	0.20
		旅客航空輸送業	0.08
		海運業	0.10
		陸運・鉄道	0.23
		運送インフラ	0.54
		自動車部品	0.46
		自動車	2.62
		家庭用耐久財	0.27
		レジャー用品	0.07

繊維・アパレル・贅沢品	0.83
ホテル・レストラン・レジャー	0.70
インターネット販売・通信販売	12.26
複合小売り	0.45
専門小売り	0.46
食品・生活必需品小売り	1.24
飲料	0.73
食品	1.57
タバコ	0.25
家庭用品	0.41
パーソナル用品	0.57
ヘルスケア機器・用品	0.34
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.49
バイオテクノロジー	0.68
医薬品	1.18
銀行	11.02
各種金融サービス	0.48
保険	2.72
情報技術サービス	1.69
ソフトウェア	0.31
通信機器	0.14
コンピュータ・周辺機器	5.62
電子装置・機器・部品	1.92
半導体・半導体製造装置	7.67
各種電気通信サービス	1.13
無線通信サービス	1.77
電力	0.69
ガス	0.50
総合公益事業	0.03
水道	0.12
貯蓄・抵当・不動産金融	0.68
消費者金融	0.38
資本市場	0.88
各種消費者サービス	0.81
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.49
ヘルスケア・テクノロジー	0.22

		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.66
		専門サービス	0.03
		その他の業種	0.00
投資信託受益証券	—	—	3.87
投資証券	—	—	0.07
合 計			95.41

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	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	アメリカ	株式	ALBEMARLE CORP	化学	44,850	6,231.32	279,474,800	14,301.49	641,422,158	2.05
2	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	59,630	8,273.79	493,366,671	9,486.19	565,661,862	1.81
3	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	51,310	8,567.80	439,614,244	10,897.02	559,126,204	1.79
4	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	21,290	23,981.96	510,576,090	25,973.53	552,976,643	1.77
5	アメリカ	株式	AFLAC INC	保険	114,300	3,642.38	416,324,423	4,704.13	537,683,111	1.72
6	アメリカ	株式	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	航空宇宙・防衛	69,160	6,437.02	445,184,608	7,678.50	531,045,745	1.70
7	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	126,700	4,126.51	522,828,918	4,175.33	529,015,464	1.69
8	アメリカ	株式	AUTOMATIC DATA PROCESS	情報技術サービス	29,000	14,076.05	408,205,626	18,206.72	527,994,952	1.69
9	アメリカ	株式	CHUBB LTD	保険	33,540	11,743.72	393,884,556	15,731.02	527,618,538	1.69
10	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	56,400	7,811.48	440,567,985	9,180.75	517,794,824	1.65
11	アメリカ	株式	GRAINGER(W.W.) INC	商社・流通業	11,990	28,519.88	341,953,394	43,070.71	516,417,887	1.65
12	アメリカ	株式	V F CORP	繊維・アパレル・贅沢品	57,830	5,725.37	331,098,604	8,905.45	515,002,220	1.65
13	アメリカ	株式	PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	銀行	378,300	1,152.14	435,854,600	1,336.02	505,418,409	1.62
14	アメリカ	株式	TARGET CORP	複合小売り	27,010	11,261.67	304,177,869	18,676.30	504,447,006	1.61
15	アメリカ	株式	EMERSON ELEC	電気設備	61,800	5,455.26	337,135,309	8,120.04	501,818,620	1.60
16	アメリカ	株式	PPG INDUSTRIES	化学	32,230	9,332.43	300,784,499	15,352.86	494,822,813	1.58
17	アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生活必需品小売り	66,800	5,312.93	354,904,031	7,401.12	494,395,056	1.58
18	アメリカ	株式	LINDE PLC	化学	18,470	19,328.73	357,001,726	26,744.40	493,969,118	1.58
19	アメリカ	株式	ECOLAB INC	化学	21,120	18,104.91	382,375,705	23,355.51	493,268,390	1.58
20	アメリカ	株式	NUCOR CORP	金属・鉱業	86,200	3,843.93	331,346,766	5,721.22	493,169,362	1.58
21	アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CL B	飲料	58,160	6,357.02	369,724,813	8,425.47	490,025,859	1.57

22	アメリカ	株式	CARDINAL HEALTH INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	87,700	5,016.84	439,977,578	5,587.20	489,997,808	1.57
23	アメリカ	株式	CARRIER GLOBAL CORP	建設関連製品	123,900	1,851.31	229,378,524	3,928.08	486,689,224	1.56
24	アメリカ	株式	GENERAL DYNAMICS	航空宇宙・防衛	30,750	13,823.60	425,075,804	15,797.51	485,773,537	1.55
25	アメリカ	株式	SHERWIN-WILLIAMS	化学	6,333	51,546.06	326,441,214	76,443.30	484,115,425	1.55
26	アメリカ	株式	COLGATE PALMOLIVE CO.	家庭用品	54,540	7,426.05	405,017,160	8,820.26	481,057,035	1.54
27	アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業サービス・用品	12,800	20,906.82	267,607,342	37,513.64	480,174,593	1.53
28	アメリカ	株式	DOVER CORP	機械	37,220	8,952.20	333,200,932	12,869.89	479,017,425	1.53
29	アメリカ	株式	OTIS WORLDWIDE CORP	機械	68,200	5,252.67	358,232,667	6,995.95	477,123,967	1.52
30	アメリカ	株式	STANLEY BLACK & DECKER INC	機械	24,310	11,444.52	278,216,339	19,501.19	474,073,975	1.51

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	石油・ガス・消耗燃料	3.50
		化学	9.72
		容器・包装	1.50
		金属・鉱業	1.58
		航空宇宙・防衛	3.25
		建設関連製品	3.05
		電気設備	1.60
		コングロマリット	2.90
		機械	9.03
		商社・流通業	1.65
		商業サービス・用品	1.53
		航空貨物・物流サービス	1.34
		家庭用耐久財	1.43
		繊維・アパレル・贅沢品	1.65
		ホテル・レストラン・レジャー	1.37
		販売	1.43
		複合小売り	1.61
		専門小売り	1.29
		食品・生活必需品小売り	4.58
		飲料	4.56
		食品	4.14
		家庭用品	5.81
		ヘルスケア機器・用品	4.29
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.57
		バイオテクノロジー	1.79
		医薬品	1.42

		銀行	1.62
		保険	4.86
		情報技術サービス	1.69
		各種電気通信サービス	1.50
		ガス	1.42
		総合公益事業	1.37
		資本市場	4.25
投資信託受益証券	—	—	0.05
投資証券	—	—	4.89
合 計			99.42

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 4 8 回	6,800,000,000	101.65	6,912,678,000	101.36	6,893,092,000	0.1	2027/9/20	0.98
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 3 4 回	6,600,000,000	103.07	6,802,950,000	102.60	6,771,864,000	0.6	2024/6/20	0.96
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 2 回	6,600,000,000	101.47	6,697,657,000	101.33	6,687,978,000	0.1	2028/9/20	0.95
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 6 0 回	6,500,000,000	100.73	6,547,740,000	100.73	6,547,645,000	0.1	2030/9/20	0.93
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 2 0 年 ）第 1 5 5 回	5,600,000,000	110.99	6,215,992,000	111.20	6,227,312,000	1	2035/12/20	0.88
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 3 3 回	6,200,000,000	100.62	6,238,440,000	100.43	6,226,846,000	0.1	2022/9/20	0.88
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 2 9 回	6,000,000,000	102.98	6,179,135,000	102.38	6,142,800,000	0.8	2023/6/20	0.87
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 4 3 回	5,900,000,000	101.40	5,983,005,000	101.11	5,965,844,000	0.1	2026/6/20	0.84
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 0 回	5,850,000,000	101.64	5,946,349,500	101.39	5,931,607,500	0.1	2028/3/20	0.84
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 4 4 回	5,800,000,000	101.50	5,887,058,000	101.16	5,867,686,000	0.1	2026/9/20	0.83
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 1 回	5,600,000,000	101.57	5,688,088,000	101.36	5,676,552,000	0.1	2028/6/20	0.80
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 3 8 回	5,500,000,000	100.81	5,544,842,000	100.78	5,542,955,000	0.1	2023/12/20	0.78
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 8 回	5,470,000,000	100.93	5,521,335,100	100.97	5,523,387,200	0.1	2030/3/20	0.78
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 3 2 回	5,400,000,000	102.69	5,545,260,000	102.25	5,521,608,000	0.6	2023/12/20	0.78
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 4 7 回	5,400,000,000	101.67	5,490,218,000	101.31	5,471,172,000	0.1	2027/6/20	0.77

16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 1 回	5,300,000,000	102.47	5,430,910,000	102.05	5,408,968,000	0.3	2025/12/20	0.76
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 9 回	5,300,000,000	100.63	5,333,618,000	100.85	5,345,474,000	0.1	2030/6/20	0.76
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 2 8 回	5,250,000,000	102.19	5,365,395,000	101.68	5,338,357,500	0.6	2023/3/20	0.75
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 1 回	5,300,000,000	100.47	5,325,014,000	100.28	5,315,158,000	0.1	2022/3/20	0.75
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 3 回	5,100,000,000	101.40	5,171,502,000	101.29	5,165,994,000	0.1	2028/12/20	0.73
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 5 回	5,100,000,000	101.15	5,158,905,000	101.20	5,161,251,000	0.1	2029/6/20	0.73
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 9 回	5,000,000,000	102.73	5,136,630,000	102.37	5,118,950,000	0.4	2025/6/20	0.72
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 8 回	5,000,000,000	102.58	5,129,264,000	102.29	5,114,550,000	0.4	2025/3/20	0.72
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 5 回	5,000,000,000	101.59	5,079,650,000	101.21	5,060,850,000	0.1	2026/12/20	0.71
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 4 3 回	4,970,000,000	101.00	5,019,928,700	100.99	5,019,401,800	0.1	2025/3/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 4 7 回	4,200,000,000	118.53	4,978,554,000	118.56	4,979,604,000	1.6	2033/12/20	0.70
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 6 回	4,900,000,000	101.68	4,982,712,000	101.26	4,962,083,000	0.1	2027/3/20	0.70
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 6 回	4,800,000,000	100.98	4,847,420,000	101.14	4,855,056,000	0.1	2029/9/20	0.69
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 5 回	4,600,000,000	102.83	4,730,180,000	102.40	4,710,722,000	0.5	2024/9/20	0.67
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 4 4 回	4,500,000,000	100.90	4,540,515,000	101.00	4,545,270,000	0.1	2025/6/20	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.73
地方債証券	6.86
特殊債券	8.53
社債券	4.21
合 計	99.35

（参考）外国債券マザーファンド

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	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	73,500,000	13,704.79	10,073,021,437	13,391.25	9,842,574,552	6	2026/2/15	1.71

2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,500,000	10,794.55	8,797,559,090	10,663.74	8,690,948,281	2.5	2022/1/15	1.51
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,000,000	14,408.50	6,916,081,968	14,086.83	6,761,680,650	5.25	2028/11/15	1.17
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	14,513.75	6,705,355,797	14,188.28	6,554,989,752	5.5	2028/8/15	1.13
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	12,903.05	6,645,073,802	12,586.11	6,481,846,852	2.5	2046/2/15	1.12
6	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000	20,074.93	5,731,393,086	21,603.48	6,167,795,702	3.25	2045/5/25	1.07
7	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000	22,064.08	6,056,592,019	20,973.44	5,757,211,918	3.25	2044/1/22	1.00
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	11,431.93	5,784,557,328	11,346.73	5,741,448,384	2.25	2025/11/15	0.99
9	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,800,000	19,400.79	5,393,420,287	20,491.60	5,696,666,190	5.75	2032/7/30	0.99
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	10,824.65	5,379,851,561	10,747.74	5,341,629,084	1.75	2023/1/31	0.92
11	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,173.06	4,835,747,010	17,669.42	5,283,157,417	5.25	2029/11/1	0.91
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,100,000	11,213.86	5,281,732,593	11,101.61	5,228,862,996	2.75	2023/7/31	0.90
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,303.09	5,218,354,815	15,271.99	5,207,751,420	3.5	2026/4/25	0.90
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,724.38	5,055,585,053	18,833.14	5,084,949,678	5.5	2029/4/25	0.88
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,100,000	13,930.00	5,168,030,585	13,635.56	5,058,793,688	3	2044/11/15	0.87
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,303.71	5,097,976,911	11,203.88	5,052,953,122	2.375	2024/8/15	0.87
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	12,833.92	5,120,734,447	12,564.19	5,013,114,553	2.5	2045/2/15	0.87
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,700,000	15,465.47	4,902,554,053	15,060.80	4,774,274,691	5.375	2031/2/15	0.83
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,299.66	4,813,655,272	11,170.60	4,758,679,495	2.75	2023/11/15	0.82
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,215.24	4,788,911,595	11,125.15	4,750,442,153	2.125	2024/9/30	0.82
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,141.39	4,790,797,734	11,043.18	4,748,568,184	2.25	2023/12/31	0.82
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,434.33	4,824,521,737	12,094.66	4,692,728,803	6.25	2023/8/15	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,716.84	4,452,400,744	11,605.64	4,410,146,437	2.375	2027/5/15	0.76
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,800,000	13,885.13	4,415,473,707	13,855.43	4,406,028,165	5.5	2022/11/1	0.76
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	21,116.26	4,244,369,514	21,560.86	4,333,733,622	5.75	2032/10/25	0.75
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,351.29	4,261,198,258	12,026.89	4,149,277,140	2.25	2046/8/15	0.72
27	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	23,201.72	4,278,397,454	21,974.21	4,052,044,345	3.5	2045/1/22	0.70
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,200,000	14,513.43	4,092,787,873	14,184.23	3,999,953,301	5.25	2029/2/15	0.69
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	22,500,000	16,884.05	3,798,913,464	17,746.53	3,992,971,140	6.5	2027/11/1	0.69
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,685.33	4,031,439,295	11,552.89	3,985,747,787	2.875	2025/4/30	0.69

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.11
合 計	99.11

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	12,053.19	650,872,380	11,979.81	646,910,044	2.625	2029/2/15	0.84
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,521.17	626,058,988	12,347.48	617,374,428	3.125	2028/11/15	0.80
3	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,180,000	25,110.80	547,415,483	24,957.98	544,083,993	4.25	2046/12/7	0.71
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,770.06	538,503,263	10,738.00	536,900,247	1.375	2023/9/30	0.70
5	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,480,000	19,399.54	481,108,805	21,124.69	523,892,540	4.75	2044/9/1	0.68
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	15,366.79	530,154,313	15,158.20	522,957,910	3.75	2043/11/15	0.68
7	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	12,803.10	512,124,078	12,915.32	516,612,828	0	2029/11/25	0.67
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,496.07	517,323,502	11,424.65	514,109,405	2.625	2025/3/31	0.67
9	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000	12,790.94	511,637,628	12,845.24	513,809,800	0	2026/2/25	0.67
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	12,069.90	506,936,093	11,953.03	502,027,290	2.75	2028/2/15	0.65
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	13,677.76	492,399,641	13,464.30	484,715,018	2.875	2046/11/15	0.63
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,954.47	478,178,909	11,789.89	471,595,648	2.375	2029/5/15	0.61
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,117.85	466,949,816	11,059.41	464,495,415	1.625	2026/5/15	0.60
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,630.80	465,232,385	11,552.89	462,115,685	2.875	2025/4/30	0.60
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,609.70	464,388,300	11,530.97	461,239,104	2.75	2025/6/30	0.60
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000	13,666.87	437,339,980	14,046.23	449,479,468	2.2	2027/6/1	0.58
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,249.33	449,973,563	11,190.90	447,636,038	2.25	2024/11/15	0.58
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,110,000	10,850.82	445,968,836	10,809.42	444,267,545	2	2023/2/15	0.58
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,098.37	443,934,936	11,048.86	441,954,543	1.625	2026/2/15	0.57
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,086.19	443,447,941	11,042.37	441,694,818	2	2024/6/30	0.57
21	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000	12,685.66	431,312,526	12,689.86	431,455,563	0.45	2022/10/31	0.56
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	12,782.52	434,605,950	12,590.16	428,065,759	2.5	2046/5/15	0.55
23	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000	18,671.30	429,439,985	18,564.21	426,976,888	6.5	2027/7/4	0.55
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,691.74	427,669,667	10,656.84	426,273,635	1.625	2022/8/31	0.55
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,530,000	12,216.81	431,253,558	12,026.89	424,549,226	2.25	2046/8/15	0.55
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,383.72	415,348,974	10,382.91	415,316,482	0.125	2022/9/30	0.54
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,370.33	414,813,291	10,371.54	414,861,984	0.125	2023/9/15	0.54
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,020,000	13,900.96	419,809,239	13,698.86	413,705,872	3	2045/11/15	0.54
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,339.08	413,563,364	10,338.67	413,547,110	0.25	2025/9/30	0.54
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000	20,911.14	376,400,699	21,603.48	388,862,777	3.25	2045/5/25	0.50

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.90
合 計	99.90

（参考）新興国債券（現地通貨建て）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	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	7,400,000	3,037.33	224,762,875	3,089.66	228,635,210	2.5	2027/7/25	2.64
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,510,000,000	3.66	165,178,570	3.75	169,211,592	9.85	2027/6/28	1.95
3	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,708.41	170,841,940	1,674.47	167,447,820	3.6	2030/5/21	1.93
4	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,704.05	170,405,713	1,650.61	165,061,095	3.48	2027/6/29	1.90
5	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	9,400,000	1,638.58	154,027,241	1,592.31	149,677,169	—	2024/1/1	1.72
6	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,209.29	134,772,394	2,204.68	134,486,040	10	2023/1/1	1.55
7	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,000,000	637.97	121,215,583	641.98	121,976,596	8	2030/1/31	1.40
8	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000	1,619.39	121,454,566	1,605.34	120,401,055	3.03	2024/6/24	1.39
9	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,978.74	119,149,674	2,994.13	119,765,579	2.5	2024/4/25	1.38
10	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000	3,116.48	118,426,444	3,136.77	119,197,336	3.25	2025/7/25	1.37
11	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	772.91	115,164,713	795.97	118,600,929	10.5	2026/12/21	1.37
12	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	23,600,000	460.55	108,690,999	477.62	112,719,010	1	2026/6/26	1.30
13	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,230,000,000	0.84	103,696,443	0.87	106,499,133	9	2029/3/15	1.23
14	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000	2,873.57	106,322,439	2,858.29	105,756,765	2.25	2022/4/25	1.22
15	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	13,300,000,000	0.74	98,985,375	0.78	104,600,776	7	2030/9/15	1.20
16	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,736.55	104,193,458	1,723.96	103,437,715	4.15	2027/12/4	1.19
17	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	28,300,000	354.28	100,261,362	351.27	99,409,587	1.6	2029/12/17	1.14
18	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,700,000	597.29	93,774,883	621.53	97,581,597	8.5	2029/5/31	1.12
19	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000	2,296.66	94,393,872	2,254.66	92,666,771	10	2025/1/1	1.07
20	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,550,000	548.31	85,263,321	580.31	90,238,930	7.5	2027/6/3	1.04
21	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000	1,726.33	84,590,194	1,746.01	85,554,908	—	2022/7/1	0.98
22	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000	352.71	84,297,812	352.99	84,364,998	1.45	2024/12/17	0.97
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000	2,710.06	78,591,913	2,737.17	79,378,014	3.733	2028/6/15	0.91

24	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000	154.07	73,953,833	155.69	74,734,925	7.65	2030/4/10	0.86
25	マレーシ ア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000	2,751.21	74,282,854	2,759.18	74,498,081	3.955	2025/9/15	0.86
26	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000	152.79	72,881,274	155.16	74,012,827	7.95	2026/10/7	0.85
27	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	12,900,000	564.63	72,838,501	569.17	73,423,153	8	2023/12/7	0.84
28	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,369.64	75,834,350	2,272.53	72,721,142	10	2027/1/1	0.84
29	インドネ シア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000	0.76	67,421,770	0.81	71,947,832	8.125	2024/5/15	0.83
30	マレーシ ア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,817.57	73,257,058	2,761.52	71,799,649	3.885	2029/8/15	0.82

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.03
合 計	98.03

（参考）新興国債券マザーファンド

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	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	3,600,000	12,898.98	464,363,366	14,134.34	508,836,556	5.25	2047/6/23	2.37
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	11,937,686	2,834.50	338,373,945	3,781.59	451,435,054	0.125	2035/7/9	2.10
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	8,365,309	3,364.16	281,423,197	4,160.89	348,072,004	0.125	2030/7/9	1.62
4	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000	10,076.17	272,056,743	11,555.42	311,996,474	7.625	2029/4/26	1.45
5	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000	10,501.72	252,041,297	12,303.64	295,287,379	5.625	2047/2/21	1.37
6	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,200,000	12,287.37	270,322,196	13,129.09	288,840,173	5.1	2035/3/28	1.34
7	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,409.98	249,839,659	11,322.83	271,748,065	7.375	2025/2/5	1.26
8	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,200,000	11,697.71	257,349,743	12,041.52	264,913,579	4.375	2029/3/21	1.23
9	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000	10,923.08	240,307,959	12,018.77	264,413,036	4.5	2029/4/22	1.23
10	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	10,941.17	251,647,033	11,345.56	260,948,045	4.25	2025/1/7	1.21
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	6,086,159	4,682.19	284,965,752	4,212.84	256,400,347	0.125	2038/1/9	1.19
12	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	13,445.79	242,024,222	14,222.64	256,007,608	5.625	2042/4/4	1.19
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,550,000	15,155.36	234,908,146	16,477.26	255,397,617	7.75	2038/1/17	1.19
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,000,000	10,887.67	217,753,440	12,573.28	251,465,745	5	2045/6/15	1.17
15	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,810,000	11,852.81	214,535,862	13,589.38	245,967,839	6.05	2040/1/11	1.14
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	9,380.38	215,748,831	10,681.29	245,669,774	6	2027/3/25	1.14

17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000	12,014.30	240,286,142	12,131.65	242,633,017	3.7	2042/2/2	1.13
18	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	11,238.40	191,052,879	13,194.13	224,300,276	5.55	2045/1/21	1.04
19	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	8,498.41	178,466,813	10,365.05	217,666,120	6.625	2045/2/17	1.01
20	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,250,000	16,709.31	208,866,455	17,132.37	214,154,638	9.5	2030/2/2	0.99
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,800,000	11,132.11	200,378,045	11,896.34	214,134,120	4.5	2029/3/15	0.99
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,520,000	12,261.07	186,368,271	13,775.81	209,392,373	6.125	2041/1/18	0.97
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,300,000	15,774.65	205,070,548	15,965.76	207,554,922	5.625	2050/11/18	0.96
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	5,300,000	4,063.33	215,356,698	3,901.17	206,762,190	0.125	2041/7/9	0.96
25	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	9,947.46	169,106,948	11,836.13	201,214,308	4.6	2048/2/10	0.93
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,337.10	192,730,703	11,805.59	200,695,066	3.875	2028/3/17	0.93
27	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	9,988.40	169,802,803	11,771.30	200,112,243	4.6	2046/1/23	0.93
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000	11,661.65	174,924,788	13,308.30	199,624,635	5.625	2044/2/26	0.93
29	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,750,000	10,977.93	192,113,908	11,340.58	198,460,158	4	2023/10/2	0.92
30	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	1,600,000	11,552.45	184,839,218	11,968.17	191,490,879	5.875	2024/1/15	0.89

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.99
合 計	97.99

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

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	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000	9,311.11	37,244,461	10,830.53	43,322,130	4.063	2024/11/1	1.22
2	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	440,000	7,448.27	32,772,413	9,698.44	42,673,150	2.9	2024/8/15	1.20
3	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	350,000	10,753.20	37,636,230	11,039.55	38,638,457	4.75	2030/3/1	1.09
4	アメリカ	社債券	KRAFT HEINZ FOODS CO	300,000	10,954.50	32,863,523	11,280.23	33,840,692	3.875	2027/5/15	0.95
5	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	280,000	10,390.73	29,094,062	10,999.40	30,798,336	6.25	2026/3/15	0.86
6	アメリカ	社債券	CENTENE ESCROW I CORP	280,000	10,823.26	30,305,129	10,973.38	30,725,468	5.375	2026/6/1	0.86
7	アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	250,000	10,497.36	26,243,426	10,892.86	27,232,167	8	2026/3/15	0.76
8	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	200,000	10,944.91	21,889,831	12,187.59	24,375,191	9.875	2027/8/1	0.68
9	アメリカ	社債券	NETFLIX INC	200,000	11,427.06	22,854,137	12,056.69	24,113,388	4.875	2030/6/15	0.68
10	アメリカ	社債券	INTESA SANPAOLO SPA	200,000	10,481.16	20,962,321	11,813.19	23,626,383	5.71	2026/1/15	0.66

11	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	11,206.09	22,412,190	11,480.93	22,961,872	8.125	2027/2/1	0.64
12	アメリカ	社債券	ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000	10,134.98	20,269,978	11,395.43	22,790,869	6.125	2028/5/15	0.64
13	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,103.76	22,207,526	11,285.10	22,570,206	5.75	2030/1/15	0.63
14	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	9,583.85	19,167,705	11,184.27	22,368,556	5.584	2024/3/18	0.63
15	アメリカ	社債券	IQVIA INC	200,000	10,773.05	21,546,110	10,993.79	21,987,591	5	2027/5/15	0.62
16	アメリカ	社債券	VEON HOLDINGS BV	200,000	10,490.29	20,980,585	10,929.59	21,859,183	4	2025/4/9	0.61
17	アメリカ	社債券	VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000	10,716.77	21,433,546	10,911.04	21,822,095	4.5	2030/8/15	0.61
18	アメリカ	社債券	MELCO RESORTS FINANCE	200,000	10,144.63	20,289,270	10,882.47	21,764,955	5.625	2027/7/17	0.61
19	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	10,490.81	20,981,624	10,876.14	21,752,280	5.25	2027/8/15	0.61
20	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	10,525.30	21,050,607	10,794.17	21,588,342	4.125	2030/12/1	0.60
21	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FINANCE CORP	180,000	9,717.95	17,492,323	11,986.36	21,575,449	7.125	2026/3/15	0.60
22	アメリカ	社債券	CONNECT FINCO SARL/CONNE	200,000	10,833.64	21,667,299	10,768.71	21,537,436	6.75	2026/10/1	0.60
23	アメリカ	社債券	ALTICE FINANCING SA	200,000	10,230.04	20,460,097	10,688.35	21,376,718	5	2028/1/15	0.60
24	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	9,522.03	19,044,076	10,434.45	20,868,904	3.087	2023/1/9	0.58
25	アメリカ	社債券	WYNN MACAU LTD	200,000	10,207.19	20,414,385	10,433.41	20,866,826	5.125	2029/12/15	0.58
26	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	180,000	11,107.51	19,993,526	11,168.17	20,102,715	4.75	2028/2/1	0.56
27	アメリカ	社債券	COLT MERGER SUB INC	180,000	10,766.67	19,380,015	11,129.26	20,032,683	6.25	2025/7/1	0.56
28	アメリカ	社債券	BAUSCH HEALTH AMERICAS	170,000	11,216.36	19,067,815	11,468.57	19,496,574	8.5	2027/1/31	0.55
29	アメリカ	社債券	HILTON DOMESTIC OPERATIN	160,000	10,770.01	17,232,026	11,200.64	17,921,025	4.875	2030/1/15	0.50
30	アメリカ	社債券	EQT CORP	150,000	9,635.79	14,453,697	11,883.92	17,825,888	7.875	2025/2/1	0.50

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	95.84
合 計	95.84

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス 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）	投資 比率 （%）
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,659	659,017	3,070,361,077	577,000	2,688,243,000	7.00
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,140	589,041	2,438,631,531	542,000	2,243,880,000	5.85
3	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,264	300,190	1,880,392,369	327,500	2,051,460,000	5.34
4	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	11,904	145,229	1,728,812,723	157,900	1,879,641,600	4.90
5	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,388	145,301	1,945,300,931	136,000	1,820,768,000	4.74

6	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,907	257,411	1,520,530,996	251,300	1,484,429,100	3.87
7	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,778	162,497	1,263,903,791	166,500	1,295,037,000	3.37
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,249	161,956	1,335,981,784	156,000	1,286,844,000	3.35
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,932	310,767	1,221,938,641	301,500	1,185,498,000	3.09
10	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,854	134,180	1,188,037,623	118,000	1,044,772,000	2.72
11	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,852	166,359	973,536,774	176,000	1,029,952,000	2.68
12	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,177	72,564	883,619,415	74,600	908,404,200	2.36
13	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,281	640,464	820,434,973	662,000	848,022,000	2.21
14	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,075	416,831	864,924,333	390,000	809,250,000	2.11
15	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,705	279,921	757,187,478	295,000	797,975,000	2.08
16	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,376	623,305	857,668,775	577,000	793,952,000	2.07
17	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,578	356,773	919,761,175	306,500	790,157,000	2.06
18	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,614	160,152	738,945,558	156,200	720,706,800	1.87
19	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,445	458,474	662,495,406	496,000	716,720,000	1.86
20	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,337	51,154	682,250,853	51,400	685,521,800	1.78
21	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,863	142,723	694,065,033	137,900	670,607,700	1.74
22	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,311	34,026	589,031,002	30,950	535,775,450	1.39
23	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	882	632,423	557,797,943	599,000	528,318,000	1.37
24	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,807	311,260	562,447,723	289,300	522,765,100	1.36
25	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,374	378,527	520,096,248	375,000	515,250,000	1.34
26	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,199	118,950	499,474,149	122,100	512,697,900	1.33
27	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,701	181,482	490,184,137	178,100	481,048,100	1.25
28	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,842	135,090	519,016,975	124,200	477,176,400	1.24
29	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,333	149,267	497,507,824	141,800	472,619,400	1.23
30	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,345	381,343	512,906,729	350,500	471,422,500	1.22

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.99
合 計	96.99

（参考）海外REITインデックス 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）	投資比率（%）
----	------	----	-----	----	---------	---------	---------	---------	---------

1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	186,060	10,150.79	1,888,657,073	10,451.33	1,944,575,204	6.02
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	22,310	72,723.39	1,622,459,008	72,777.02	1,623,655,379	5.02
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	67,780	14,791.27	1,002,552,622	14,204.87	962,806,746	2.98
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	38,320	22,081.36	846,157,771	22,858.91	875,953,688	2.71
5	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	82,000	8,720.56	715,086,713	8,887.78	728,798,739	2.25
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	105,200	6,125.10	644,361,102	6,705.06	705,372,375	2.18
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	35,480	17,741.97	629,485,145	17,440.01	618,771,707	1.91
8	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	420,000	1,179.74	495,493,135	1,431.29	601,143,942	1.86
9	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	87,000	6,489.25	564,565,271	6,403.77	557,128,825	1.72
10	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	86,400	6,600.70	570,301,246	6,150.28	531,384,883	1.64
11	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	29,580	16,654.02	492,626,205	16,844.72	498,266,954	1.54
12	香港	投資証券	LINK REIT	522,000	907.82	473,886,788	917.90	479,143,800	1.48
13	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	94,100	4,491.96	422,693,503	4,976.33	468,272,747	1.45
14	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,450	27,044.89	444,888,542	25,973.53	427,264,715	1.32
15	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	141,400	2,952.91	417,541,598	2,987.87	422,485,723	1.30
16	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	135,800	2,998.69	407,222,620	3,104.23	421,554,869	1.30
17	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	35,740	10,533.13	376,454,141	10,641.45	380,325,519	1.17
18	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	301,100	1,205.03	362,836,514	1,248.88	376,040,689	1.16
19	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	93,500	3,847.62	359,752,993	3,988.33	372,909,519	1.15
20	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	32,580	10,779.97	351,211,635	11,427.90	372,320,982	1.15
21	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,860	12,832.32	370,340,881	12,882.36	371,784,910	1.15
22	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	134,700	2,328.41	313,637,780	2,667.89	359,365,483	1.11
23	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	24,800	14,989.57	371,741,359	14,400.19	357,124,784	1.10
24	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	43,900	7,307.86	320,815,125	7,260.87	318,752,285	0.98
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	74,500	4,217.07	314,172,087	4,074.56	303,555,152	0.94
26	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,314,000	204.90	269,245,719	221.50	291,052,051	0.90
27	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,800	8,035.26	279,627,299	7,855.84	273,383,260	0.84
28	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	133,600	2,096.96	280,154,345	2,033.12	271,625,807	0.84
29	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	178,200	1,121.39	199,832,000	1,518.87	270,662,955	0.83
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,800	6,846.83	293,044,393	6,099.38	261,053,545	0.80

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.08
合 計	99.08

（参考）海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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）	投資 比率 （%）
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	41,280	10,443.33	431,100,736	10,451.33	431,431,067	5.90
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4,949	78,229.38	387,157,230	72,777.02	360,173,486	4.93
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,050	15,083.33	227,004,210	14,204.87	213,783,439	2.92
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	8,510	22,175.94	188,717,297	22,858.91	194,529,381	2.66
5	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,140	7,278.55	132,033,042	8,887.78	161,224,501	2.20

6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	23,400	6,245.64	146,148,078	6,705.06	156,898,418	2.14
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,900	16,638.95	131,447,716	17,440.01	137,776,113	1.88
8	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	93,300	1,399.63	130,585,751	1,431.29	133,539,833	1.82
9	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	19,170	6,624.60	126,993,713	6,403.77	122,760,455	1.68
10	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	19,230	5,937.08	114,170,188	6,150.28	118,270,038	1.61
11	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,580	17,170.99	112,985,124	16,844.72	110,838,288	1.51
12	香港	投資証券	LINK REIT	116,000	843.25	97,817,483	917.90	106,476,400	1.45
13	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	20,720	4,594.40	95,195,975	4,976.33	103,109,578	1.41
14	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,670	23,102.83	84,787,393	25,973.53	95,322,888	1.30
15	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	31,500	2,966.38	93,441,176	2,987.87	94,118,107	1.28
16	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	29,900	2,928.06	87,549,215	3,104.23	92,816,573	1.27
17	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	7,980	9,005.59	71,864,682	10,641.45	84,918,793	1.16
18	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,430	12,255.74	78,804,451	12,882.36	82,833,575	1.13
19	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	66,000	1,275.94	84,212,530	1,248.88	82,426,720	1.12
20	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	20,590	3,949.88	81,328,063	3,988.33	82,119,861	1.12
21	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,170	11,247.20	80,642,441	11,427.90	81,938,043	1.12
22	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	30,000	2,409.01	72,270,501	2,667.89	80,036,856	1.09
23	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	5,460	15,078.93	82,330,996	14,400.19	78,625,053	1.07
24	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	9,810	7,196.74	70,600,028	7,260.87	71,229,155	0.97
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	16,410	3,621.80	59,433,752	4,074.56	66,863,625	0.91
26	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	291,000	169.06	49,198,604	221.50	64,456,733	0.88
27	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,830	4,676.42	36,616,381	7,855.84	61,511,233	0.84
28	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	39,900	1,113.72	44,437,826	1,518.87	60,602,985	0.82
29	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,400	1,896.90	55,768,982	2,033.12	59,773,943	0.81
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,560	6,751.03	64,539,906	6,099.38	58,310,091	0.79

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.09
合 計	97.09

投資不動産物件

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	取引所	名称	買建 / 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2020年12月限)	買建	500	日本円	8,891,753,500	8,777,500,000	2.01

（参考）外国株式MSCI - K O K U S A Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国 / 地域	取引所	名称	買建 / 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2020 年12月限)	買建	463	米ドル	81,818,900	8,500,165,521	84,184,975	8,745,977,046	1.10
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2020年12 月限)	買建	25	カナダド ル	4,955,980	396,230,601	5,185,000	414,540,750	0.05

	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2020年12月限)	買建	305	ユーロ	10,187,260	1,267,091,399	10,772,600	1,339,895,987	0.16
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2020年12月限)	買建	19	豪ドル	2,991,275	230,058,961	3,136,425	241,222,445	0.03
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2020年12月限)	買建	62	英ポンド	3,821,400	529,454,970	3,944,130	546,459,210	0.06
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2020年12月限)	買建	33	スイスフラン	3,398,790	390,758,887	3,457,080	397,460,484	0.05

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2020年12月限)	買建	51	米ドル	9,136,287.5	949,168,908	9,273,075	963,379,761	1.54
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2020年12月限)	買建	3	カナダドル	596,840	47,717,358	622,200	49,744,890	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2020年12月限)	買建	33	ユーロ	1,126,250	140,082,975	1,165,560	144,972,352	0.23
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2020年12月限)	買建	3	豪ドル	479,050	36,843,736	495,225	38,087,754	0.06
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2020年12月限)	買建	7	英ポンド	435,025	60,272,713	445,305	61,697,007	0.09
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2020年12月限)	買建	4	スイスフラン	416,670	47,904,551	419,040	48,177,028	0.07

（参考）新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2020年12月限)	買建	299	米ドル	17,625,565	1,831,119,955	18,463,250	1,918,147,038	3.70
	シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2020年12月限)	買建	238	米ドル	3,950,508	410,418,279	4,009,586	416,555,886	0.80

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国／地域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2020 年12月限)	買建	9	米ドル	1,535,100	159,481,539	1,636,425	170,008,191	0.54

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
----	-----	----	-----------	----	----	-------------	------------	-----------------

REIT指数先物取引	大阪取引所	REIT指数先物(2020年12月限)	買建	680	日本円	1,160,970,800	1,147,840,000	2.99
------------	-------	---------------------	----	-----	-----	---------------	---------------	------

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ ボード オブ トレード	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2020年12月限)	買建	70	米ドル	2,278,880	236,752,844	2,320,500	241,076,742	0.74

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ ボード オブ トレード	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2020年12月限)	買建	45	米ドル	1,446,250	150,250,911	1,491,750	154,977,904	2.12

（３）運用実績

純資産の推移

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11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	(2017年 4月24日)	1	1	1.0002	1.0002
第2計算期間	(2018年 4月23日)	67	67	1.0242	1.0242
第3計算期間	(2019年 4月22日)	163	163	1.0487	1.0487
第4計算期間	(2020年 4月22日)	138	138	1.0282	1.0282
	2019年11月末日	176	—	1.0775	—
	12月末日	122	—	1.0811	—
	2020年 1月末日	141	—	1.0855	—
	2月末日	141	—	1.0690	—
	3月末日	137	—	1.0227	—
	4月末日	138	—	1.0436	—

5月末日	142	—	1.0559	—
6月末日	138	—	1.0587	—
7月末日	141	—	1.0685	—
8月末日	137	—	1.0819	—
9月末日	137	—	1.0765	—
10月末日	136	—	1.0686	—
11月末日	140	—	1.1005	—

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11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	(2017年 4月24日)	1	1	0.9998	0.9998
第2計算期間	(2018年 4月23日)	78	78	1.0402	1.0402
第3計算期間	(2019年 4月22日)	90	90	1.0690	1.0690
第4計算期間	(2020年 4月22日)	87	87	1.0281	1.0281
	2019年11月末日	69	—	1.1063	—
	12月末日	73	—	1.1126	—
	2020年 1月末日	86	—	1.1163	—
	2月末日	86	—	1.0860	—
	3月末日	86	—	1.0196	—
	4月末日	89	—	1.0513	—
	5月末日	92	—	1.0709	—
	6月末日	93	—	1.0777	—
	7月末日	94	—	1.0898	—
	8月末日	96	—	1.1142	—
	9月末日	93	—	1.1036	—
	10月末日	92	—	1.0924	—
	11月末日	96	—	1.1411	—

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11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	(2017年 4月24日)	2	2	0.9986	0.9986
第2計算期間	(2018年 4月23日)	182	182	1.0534	1.0534
第3計算期間	(2019年 4月22日)	215	215	1.0904	1.0904
第4計算期間	(2020年 4月22日)	291	291	1.0231	1.0231
	2019年11月末日	268	—	1.1327	—

12月末日	278	—	1.1434	—
2020年 1月末日	283	—	1.1443	—
2月末日	304	—	1.1016	—
3月末日	285	—	1.0117	—
4月末日	303	—	1.0533	—
5月末日	318	—	1.0798	—
6月末日	326	—	1.0883	—
7月末日	335	—	1.1034	—
8月末日	341	—	1.1389	—
9月末日	331	—	1.1230	—
10月末日	325	—	1.1086	—
11月末日	336	—	1.1733	—

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11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 (2017年 4月24日)	3	3	0.9989	0.9989
第2計算期間 (2018年 4月23日)	31	31	1.0646	1.0646
第3計算期間 (2019年 4月22日)	51	51	1.1052	1.1052
第4計算期間 (2020年 4月22日)	76	76	1.0179	1.0179
2019年11月末日	63	—	1.1530	—
12月末日	66	—	1.1667	—
2020年 1月末日	68	—	1.1659	—
2月末日	77	—	1.1130	—
3月末日	72	—	1.0045	—
4月末日	79	—	1.0539	—
5月末日	85	—	1.0848	—
6月末日	89	—	1.0954	—
7月末日	92	—	1.1124	—
8月末日	91	—	1.1572	—
9月末日	89	—	1.1363	—
10月末日	86	—	1.1194	—
11月末日	88	—	1.1982	—

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11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	(2017年 4月24日)	2	2	0.9965	0.9965
第2計算期間	(2018年 4月23日)	114	114	1.0820	1.0820
第3計算期間	(2019年 4月22日)	194	194	1.1290	1.1290
第4計算期間	(2020年 4月22日)	210	210	1.0107	1.0107
	2019年11月末日	225	—	1.1843	—
	12月末日	231	—	1.2017	—
	2020年 1月末日	240	—	1.1976	—
	2月末日	228	—	1.1257	—
	3月末日	205	—	0.9944	—
	4月末日	221	—	1.0556	—
	5月末日	233	—	1.0958	—
	6月末日	236	—	1.1095	—
	7月末日	244	—	1.1283	—
	8月末日	257	—	1.1885	—
	9月末日	250	—	1.1609	—
	10月末日	242	—	1.1402	—
	11月末日	263	—	1.2414	—

分配の推移

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円

第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

収益率の推移

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	2.4%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	2.4%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	2.0%
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	5.0%

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

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	4.0%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	2.8%

第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	3.8%
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	7.8%

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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	5.5%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.5%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	6.2%
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	10.5%

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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	6.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.8%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	7.9%
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	12.6%

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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.4%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	8.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	4.3%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	10.5%
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	16.1%

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

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,871,229	22,136	1,849,093
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	84,588,270	20,341,137	66,096,226
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	139,749,676	50,154,666	155,691,236
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	68,957,367	89,937,465	134,711,138
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	16,819,317	24,473,992	127,056,463

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,140,737	—	1,140,737
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	81,863,323	7,157,724	75,846,336
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	64,162,109	55,040,537	84,967,908
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	40,391,880	40,547,332	84,812,456
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	10,383,422	8,649,819	86,546,059

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	2,616,123	11,615	2,604,508
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	222,742,777	52,396,644	172,950,641
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	90,227,074	65,793,755	197,383,960
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	148,863,569	61,665,955	284,581,574
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	41,347,659	31,400,904	294,528,329

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	3,911,186	6,532	3,904,654
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	40,547,035	15,185,160	29,266,529
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	19,627,025	2,057,321	46,836,233
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	42,459,087	14,139,356	75,155,964
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	11,608,405	9,811,222	76,953,147

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	2,529,296	151,621	2,377,675
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	107,829,976	4,387,951	105,819,700
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	119,681,763	53,143,123	172,358,340
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	84,060,552	47,829,633	208,589,259
第5期（中間期）	2020年 4月23日～2020年10月22日	23,788,089	17,178,193	215,199,155

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11月30日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

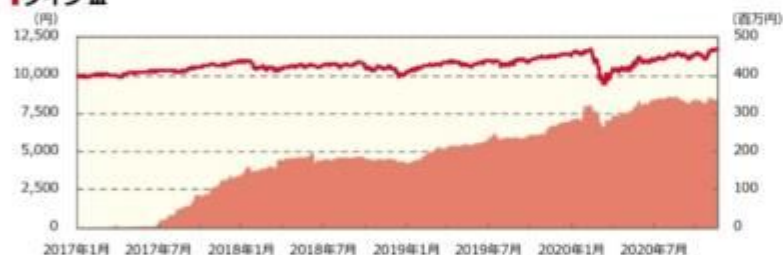
■ タイプⅠ



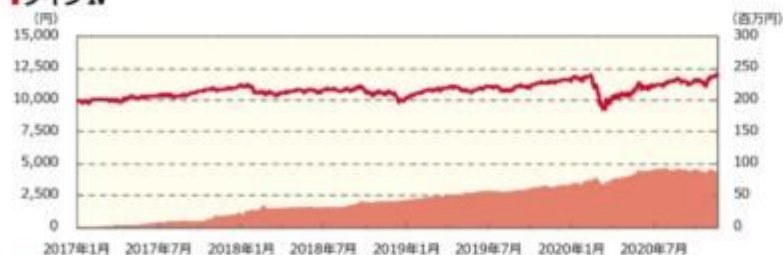
■ タイプⅡ



■ タイプⅢ



■ タイプⅣ



■ タイプⅤ



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

■ タイプⅠ

2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

■ タイプⅡ

2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

■ タイプⅢ

2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

■ タイプⅣ

2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

■ タイプⅤ

2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率（％）				
	タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
国内株式マザーファンド	5.1	8.1	9.4	10.9	14.5
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5.6	10.6	20.1	26.6	37.1
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	8.7	10.2	8.5	8.1	7.5
新興国株式マザーファンド	1.5	2.6	4.0	6.1	8.5
米国株式配当資産インデックスマザーファンド	2.1	2.6	3.0	3.0	4.1
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	52.6	40.4	29.2	19.2	6.3
外国債券マザーファンド	3.5	3.4	4.0	4.0	3.4
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	10.8	7.8	5.5	4.0	1.4
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	—	—	—	—	—
新興国債券マザーファンド	5.0	6.9	6.9	7.8	6.3
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	2.0	2.0	3.0	3.0	3.4
J-REITインデックス マザーファンド	1.0	1.9	2.5	2.5	2.4
海外REITインデックス マザーファンド	1.6	3.0	3.4	4.4	4.5
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	—	—	—	—	—

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.2	0.2	0.3	0.3	0.4
2	ソニー	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
4	キーエンス	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
5	任天堂	その他製品	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.2	0.5	0.9	1.2	1.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.2	0.4	0.7	0.9	1.2
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.3	0.6	0.8	1.1
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.3	0.4	0.5
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.2	0.3	0.4

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.4	0.4	0.3	0.3
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3	0.3	0.3	0.3	0.2
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3	0.3	0.2	0.2	0.2
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.1	0.2	0.3	0.4	0.6
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.2	0.3	0.5
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.1	0.1	0.2	0.3	0.5
4	XINRAKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3

・「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	ALBEMARLE CORP	化学	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
2	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
3	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
4	ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
5	AFLAC INC	保険	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	国庫債券 利付（10年）第348回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
3	国庫債券 利付（10年）第352回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第360回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
5	国庫債券 利付（20年）第155回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
3	UK TREASURY	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
5	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.1
3	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	REPUBLIC OF TURKEY	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
5	FED REPUBLIC OF BRAZIL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1

・「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	KRAFT HEINZ FOODS CO	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	TRANSDIGM INC	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
3	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	G L P 投資法人 投資証券	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
5	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
2	EQUINIX INC	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

■ タイプⅠ



■ タイプⅡ



■ タイプⅢ



■ タイプⅣ



■ タイプⅤ



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2017年は設定日（2017年1月10日）から年末までの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

インデックス・ブレード（タイプ ）
 インデックス・ブレード（タイプ ）
 インデックス・ブレード（タイプ ）
 インデックス・ブレード（タイプ ）
 インデックス・ブレード（タイプ ）

（1）当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3および第57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、中間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5期中間計算期間（2020年4月23日から2020年10月22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による中間監査を受けております。

中間財務諸表

インデックス・ブレード（タイプ ）

（1）中間貸借対照表

	（単位：円）	
	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,237,677	1,306,899
親投資信託受益証券	135,975,996	135,335,204
派生商品評価勘定	53,605	33,669
未収入金	1,635,411	973,842
流動資産合計	138,902,689	137,649,614
資産合計	138,902,689	137,649,614
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,907	-
未払金	-	120
未払解約金	5,389	129,024
未払受託者報酬	23,881	23,119
未払委託者報酬	358,098	346,775
未払利息	1	-
その他未払費用	2,328	2,245
流動負債合計	396,604	501,283
負債合計	396,604	501,283
純資産の部		
元本等		
元本	134,711,138	127,056,463
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,794,947	10,091,868
（分配準備積立金）	3,734,872	3,113,688
元本等合計	138,506,085	137,148,331
純資産合計	138,506,085	137,148,331
負債純資産合計	138,902,689	137,649,614

（2）中間損益及び剰余金計算書

	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,399,909	6,981,208
為替差損益	104,000	166,162
営業収益合計	3,503,909	7,147,370
営業費用		
支払利息	482	232
受託者報酬	26,289	23,119
委託者報酬	394,314	346,775
その他費用	2,571	2,245
営業費用合計	423,656	372,371
営業利益又は営業損失（ ）	3,080,253	6,774,999
経常利益又は経常損失（ ）	3,080,253	6,774,999
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,080,253	6,774,999
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	111,997	872,624
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,579,840	3,794,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,668,902	1,119,858
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,668,902	1,119,858
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,046,684	725,312
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,046,684	725,312
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,170,314	10,091,868

（３）中間注記表

（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。 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. 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。 為替差損益 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。 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。
4. その他	当ファンドの中間計算期間は、2020年 4月23日から2020年10月22日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 134,711,138口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 127,056,463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 1.0282円 (10,000口当たり純資産額) (10,282円)	2. 中間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 1.0794円 (10,000口当たり純資産額) (10,794円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 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。	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。 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 2 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 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）

1 元本の移動

第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
期首元本額 155,691,236円	期首元本額 134,711,138円
期中追加設定元本額 68,957,367円	期中追加設定元本額 16,819,317円
期中一部解約元本額 89,937,465円	期中一部解約元本額 24,473,992円

2 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	第4期(2020年 4月22日現在)				第5期中間計算期間末(2020年10月22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	3,880,544	-	3,833,846	46,698	6,473,475	-	6,439,806	33,669
米ドル	3,880,544	-	3,833,846	46,698	6,473,475	-	6,439,806	33,669
合計	3,880,544	-	3,833,846	46,698	6,473,475	-	6,439,806	33,669

（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。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

（ 1 ）中間貸借対照表

（単位：円）

	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	682,542	766,531
親投資信託受益証券	86,061,201	95,015,838
派生商品評価勘定	45,975	42,095
未収入金	628,754	379,453
流動資産合計	87,418,472	96,203,917
資産合計	87,418,472	96,203,917
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,647	-
未払金	-	301
未払受託者報酬	12,877	15,478
未払委託者報酬	197,438	237,308
その他未払費用	1,223	1,488

	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
流動負債合計	223,185	254,575
負債合計	223,185	254,575
純資産の部		
元本等		
元本	84,812,456	86,546,059
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,382,831	9,403,283
（分配準備積立金）	2,318,866	2,098,896
元本等合計	87,195,287	95,949,342
純資産合計	87,195,287	95,949,342
負債純資産合計	87,418,472	96,203,917

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,670,753	7,020,637
為替差損益	70,427	149,283
営業収益合計	1,741,180	7,169,920
営業費用		
支払利息	318	84
受託者報酬	12,574	15,478
委託者報酬	192,679	237,308
その他費用	1,197	1,488
営業費用合計	206,768	254,358
営業利益又は営業損失（ ）	1,534,412	6,915,562
経常利益又は経常損失（ ）	1,534,412	6,915,562
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,534,412	6,915,562
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	301,278	610,944
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,862,618	2,382,831
剰余金増加額又は欠損金減少額	740,582	980,754
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	740,582	980,754
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,189,114	264,920
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,189,114	264,920
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,647,220	9,403,283

(3) 中間注記表

(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。 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. 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。 為替差損益 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。 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。
4.その他	当ファンドの中間計算期間は、2020年 4月23日から2020年10月22日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 84,812,456口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 86,546,059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 1.0281円 (10,000口当たり純資産額) (10,281円)	2. 中間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 1.1087円 (10,000口当たり純資産額) (11,087円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 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。	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。 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 2 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 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）

1 元本の移動

第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日		第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日	
期首元本額	84,967,908円	期首元本額	84,812,456円
期中追加設定元本額	40,391,880円	期中追加設定元本額	10,383,422円
期中一部解約元本額	40,547,332円	期中一部解約元本額	8,649,819円

2 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	第4期(2020年 4月22日現在)				第5期中間計算期間末(2020年10月22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	3,262,168	-	3,227,840	34,328	6,353,247	-	6,311,152	42,095
米ドル	3,262,168	-	3,227,840	34,328	6,353,247	-	6,311,152	42,095
合計	3,262,168	-	3,227,840	34,328	6,353,247	-	6,311,152	42,095

（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。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

（ 1 ）中間貸借対照表

	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,072,927	3,649,907
親投資信託受益証券	285,250,126	328,230,391
派生商品評価勘定	138,649	155,371
未収入金	3,514,462	2,553,709
流動資産合計	291,976,164	334,589,378
資産合計	291,976,164	334,589,378
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,971	-
未払金	-	589
未払解約金	33,364	718,591
未払受託者報酬	46,057	54,229
未払委託者報酬	721,555	849,585
未払利息	3	2
その他未払費用	4,544	5,361
流動負債合計	812,494	1,628,357
負債合計	812,494	1,628,357
純資産の部		
元本等		
元本	284,581,574	294,528,329
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,582,096	38,432,692
（分配準備積立金）	8,650,179	7,799,552
元本等合計	291,163,670	332,961,021
純資産合計	291,163,670	332,961,021
負債純資産合計	291,976,164	334,589,378

（２）中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,010,673	32,219,265
為替差損益	163,885	538,774
営業収益合計	5,174,558	32,758,039
営業費用		
支払利息	663	531
受託者報酬	37,166	54,229
委託者報酬	582,185	849,585
その他費用	3,658	5,361
営業費用合計	623,672	909,706
営業利益又は営業損失（ ）	4,550,886	31,848,333
経常利益又は経常損失（ ）	4,550,886	31,848,333
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,550,886	31,848,333
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	103,201	3,044,319
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,850,030	6,582,096
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,712,438	3,954,516
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,712,438	3,954,516
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,817,207	907,934
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,817,207	907,934
分配金	-	-

	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	24,192,946	38,432,692

（ 3 ） 中間注記表

（ 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。 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. 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。 為替差損益 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。 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。
4. その他	当ファンドの中間計算期間は、2020年 4月23日から2020年10月22日までとなっております。

（ 中間貸借対照表に関する注記 ）

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 284,581,574口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 294,528,329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 1.0231円 (10,000口当たり純資産額) (10,231円)	2. 中間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 1.1305円 (10,000口当たり純資産額) (11,305円)

（ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

該当事項はありません。

（ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 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。	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 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）

1 元本の移動

第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日		第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日	
期首元本額	197,383,960円	期首元本額	284,581,574円
期中追加設定元本額	148,863,569円	期中追加設定元本額	41,347,659円
期中一部解約元本額	61,665,955円	期中一部解約元本額	31,400,904円

2 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	第4期(2020年 4月22日現在)				第5期中間計算期間末(2020年10月22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	10,665,233	-	10,533,555	131,678	21,983,759	-	21,828,388	155,371
米ドル	10,665,233	-	10,533,555	131,678	21,983,759	-	21,828,388	155,371
合計	10,665,233	-	10,533,555	131,678	21,983,759	-	21,828,388	155,371

（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。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

（１）中間貸借対照表

（単位：円）		
	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	775,996	863,348
親投資信託受益証券	74,610,988	86,372,240
派生商品評価勘定	32,035	46,966
未収入金	1,278,113	2,197,274
流動資産合計	76,697,132	89,479,828
資産合計	76,697,132	89,479,828
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,045	-
未払金	-	452
未払解約金	2	1,060,574
未払受託者報酬	11,389	14,626
未払委託者報酬	182,212	233,987
その他未払費用	1,067	1,421
流動負債合計	198,715	1,311,060
負債合計	198,715	1,311,060
純資産の部		
元本等		
元本	75,155,964	76,953,147
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,342,453	11,215,621
（分配準備積立金）	2,199,635	1,947,981
元本等合計	76,498,417	88,168,768
純資産合計	76,498,417	88,168,768
負債純資産合計	76,697,132	89,479,828

（２）中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）		
	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,383,437	10,170,252
為替差損益	42,852	159,086
営業収益合計	1,426,289	10,329,338
営業費用		

	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
支払利息	107	71
受託者報酬	9,147	14,626
委託者報酬	146,370	233,987
その他費用	864	1,421
営業費用合計	156,488	250,105
営業利益又は営業損失（ ）	1,269,801	10,079,233
経常利益又は経常損失（ ）	1,269,801	10,079,233
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,269,801	10,079,233
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	11,314	1,112,478
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,925,788	1,342,453
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,245,826	1,154,148
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,245,826	1,154,148
剰余金減少額又は欠損金増加額	442,717	247,735
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	442,717	247,735
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,010,012	11,215,621

(3) 中間注記表

(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。 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. 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。 為替差損益 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。 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。
4. その他	当ファンドの中間計算期間は、2020年 4月23日から2020年10月22日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 75,155,964口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 76,953,147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 1.0179円	2. 中間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 1.1457円

(10,000口当たり純資産額)	(10,179円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,457円)
------------------	-----------	------------------	-----------

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	1．中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2．時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 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）

1 元本の移動

第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
期首元本額	46,836,233円
期中追加設定元本額	42,459,087円
期中一部解約元本額	14,139,356円
期首元本額	75,155,964円
期中追加設定元本額	11,608,405円
期中一部解約元本額	9,811,222円

2 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	第4期(2020年 4月22日現在)			第5期中間計算期間末(2020年10月22日現在)		
	契約額等（円）		時価（円）	契約額等（円）		時価（円）
	うち1年 超			うち1年 超		
			評価損益（円）			評価損益（円）

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	3,184,224	-	3,156,234	27,990	6,654,493	-	6,607,527	46,966
米ドル	3,184,224	-	3,156,234	27,990	6,654,493	-	6,607,527	46,966
合計	3,184,224	-	3,156,234	27,990	6,654,493	-	6,607,527	46,966

(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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

(1) 中間貸借対照表

(単位：円)

	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,289,015	2,636,073
親投資信託受益証券	205,244,735	246,361,585
派生商品評価勘定	40,891	99,082
未収入金	3,894,912	4,565,008
流動資産合計	211,469,553	253,661,748
資産合計	211,469,553	253,661,748
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,540	-
未払金	-	1,285
未払解約金	-	337,987
未払受託者報酬	37,222	40,153
未払委託者報酬	607,926	655,749
未払利息	2	1
その他未払費用	3,662	3,957
流動負債合計	653,352	1,039,132
負債合計	653,352	1,039,132
純資産の部		
元本等		
元本	208,589,259	215,199,155

	第4期 (2020年 4月22日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年10月22日現在)
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,226,942	37,423,461
（分配準備積立金）	9,711,879	8,978,091
元本等合計	210,816,201	252,622,616
純資産合計	210,816,201	252,622,616
負債純資産合計	211,469,553	253,661,748

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,522,055	34,882,157
為替差損益	111,259	343,957
その他収益	-	1,693
営業収益合計	4,633,314	35,227,807
営業費用		
支払利息	542	323
受託者報酬	33,433	40,153
委託者報酬	546,043	655,749
その他費用	3,289	3,957
営業費用合計	583,307	700,182
営業利益又は営業損失（ ）	4,050,007	34,527,625
経常利益又は経常損失（ ）	4,050,007	34,527,625
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,050,007	34,527,625
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	188,222	2,268,337
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	22,240,062	2,226,942
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,521,556	3,247,921
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,521,556	3,247,921
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,006,523	310,690
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,006,523	310,690
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	28,993,324	37,423,461

(3) 中間注記表

(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。 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. 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。 為替差損益 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。 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。
4.その他	当ファンドの中間計算期間は、2020年 4月23日から2020年10月22日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 208,589,259口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 215,199,155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 1.0107円 (10,000口当たり純資産額) (10,107円)	2. 中間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 1.1739円 (10,000口当たり純資産額) (11,739円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 4月22日現在	第5期中間計算期間末 2020年10月22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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 2 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 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。	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。 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 2 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 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）

1 元本の移動

第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日		第5期中間計算期間 自 2020年 4月23日 至 2020年10月22日	
期首元本額	172,358,340円	期首元本額	208,589,259円
期中追加設定元本額	84,060,552円	期中追加設定元本額	23,788,089円
期中一部解約元本額	47,829,633円	期中一部解約元本額	17,178,193円

2 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	第4期(2020年 4月22日現在)				第5期中間計算期間末(2020年10月22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	5,793,946	-	5,757,595	36,351	15,223,028	-	15,123,946	99,082
米ドル	5,793,946	-	5,757,595	36,351	15,223,028	-	15,123,946	99,082
合計	5,793,946	-	5,757,595	36,351	15,223,028	-	15,123,946	99,082

（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。

（参考）

「インデックス・ブレンド（タイプ ）」、「インデックス・ブレンド（タイプ ）」、「インデックス・ブレンド（タイプ ）」、「インデックス・ブレンド（タイプ ）」、「インデックス・ブレンド（タイプ ）」は「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、

「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」および「海外REITインデックス 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。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,716,991,635
株式	443,271,198,190
派生商品評価勘定	19,073,465
未収入金	30,958,850
未収配当金	3,821,794,574
未収利息	985,523
その他未収収益	41,352,360
差入委託証拠金	331,459,200
流動資産合計	463,233,813,797
資産合計	463,233,813,797
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,754,780
未払解約金	533,675,034
未払利息	9,059
有価証券貸借取引受入金	11,624,602,239
流動負債合計	12,221,041,112
負債合計	12,221,041,112
純資産の部	
元本等	
元本	269,456,365,962
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	181,556,406,723
元本等合計	451,012,772,685
純資産合計	451,012,772,685
負債純資産合計	463,233,813,797

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。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2.費用・収益の計上基準	受取配当金 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。 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。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	有価証券売買等損益
	約定日基準で計上しております。
	派生商品取引等損益
	約定日基準で計上しております。
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	1.6738円
(10,000口当たり純資産額)	(16,738円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	11,026,133,170円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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	
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。	
派生商品評価勘定	
先物取引	
（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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	278,557,544,313円
同期中における追加設定元本額	17,253,062,973円
同期中における一部解約元本額	26,354,241,324円
期末元本額	269,456,365,962円
期末元本額の内訳 *	
バランスセレクト 3 0	158,192,056円

バランスセレクト５０	359,932,060円
バランスセレクト７０	469,659,571円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,634,760,675円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	3,409,332,087円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	7,799,546,021円
野村資産設計ファンド２０１５	45,029,814円
野村資産設計ファンド２０２０	45,507,148円
野村資産設計ファンド２０２５	82,588,635円
野村資産設計ファンド２０３０	107,531,043円
野村資産設計ファンド２０３５	84,980,126円
野村資産設計ファンド２０４０	170,420,007円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	86,439,322,763円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,664,825,855円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,104,527,285円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,508,158,197円
野村資産設計ファンド２０４５	26,465,990円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	1,780,093,528円
マイ・ロード	3,656,573,340円
ネクストコア	63,696,091円
野村インデックスファンド・内外７資産バランス・為替ヘッジ型	1,518,351,015円
野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	3,432,780,153円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,726,028,261円
野村資産設計ファンド２０５０	43,747,914円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	14,423,482円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	7,155,100円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	5,639,943円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	3,792,659円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	341,505,808円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	342,081,169円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,046,997円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,524,012円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	18,727,857円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,772,885円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	21,757,167円
野村６資産均等バランス	1,543,789,851円
世界６資産分散ファンド	100,597,200円
野村資産設計ファンド２０６０	16,773,263円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	611,521,226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）	395,385,412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）	245,661,645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）	617,104,180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）	725,486,416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）	4,289,344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）	9,248,638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）	862,108円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,734,229,519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）	10,731,808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）	103,255,852円

野村・国内株式インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	84,966,859円
野村世界インデックス・バランス40 V A（適格機関投資家専用）	29,642,332円
野村グローバル・インデックス・バランス25 V A（適格機関投資家専用）	101,012,486円
野村グローバル・インデックス・バランス50 V A（適格機関投資家専用）	254,782,183円
野村グローバル・インデックス・バランス75 V A（適格機関投資家専用）	4,480,879,753円
野村世界バランス25 V A（適格機関投資家専用）	73,216,899円
ノムラ日本株式インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	308,064,479円
ノムラF O F s用インデックスファンド・T O P I X（適格機関投資家専用）	2,036,470,265円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	364,289,980円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	1,040,255,720円
野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2％コース向け）（適格機関投資家専用）	1,732,822円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	7,753,665円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	29,443,678円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	37,482,715円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	127,780,912円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	9,957,810,946円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	25,741,626,424円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	27,890,210,317円
野村国内株式インデックスファンド・T O P I X（確定拠出年金向け）	32,072,076,661円
マイバランスD C 30	3,403,630,323円
マイバランスD C 50	5,473,748,930円
マイバランスD C 70	5,152,451,098円
野村D C 国内株式インデックスファンド・T O P I X	10,011,149,830円
野村D C 運用戦略ファンド	1,034,637,437円
野村D C 運用戦略ファンド（マイルド）	83,459,834円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,017,737,476円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	786,659,703円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	651,587,631円
野村世界6資産分散投信（D C）安定コース	8,235,438円
野村世界6資産分散投信（D C）インカムコース	4,001,688円
野村世界6資産分散投信（D C）成長コース	53,660,478円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2030	13,951,624円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2040	10,925,822円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2050	10,336,800円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	317,757,518円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	255,355,280円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	136,791,292円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	165,646,639円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2060	4,728,849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

外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	6,755,076,351
コール・ローン	559,962,193
株式	680,767,535,661
投資証券	16,462,871,027
派生商品評価勘定	121,326,467
未収配当金	428,114,001
差入委託証拠金	3,876,132,198
流動資産合計	708,971,017,898
資産合計	708,971,017,898
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,176,572
未払解約金	668,538,852
未払利息	322
その他未払費用	2,903,000
流動負債合計	809,618,746
負債合計	809,618,746
純資産の部	
元本等	
元本	231,989,066,013
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	476,172,333,139
元本等合計	708,161,399,152
純資産合計	708,161,399,152
負債純資産合計	708,971,017,898

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。 投資証券 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、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。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、わが国における計算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 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。 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。

	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	3.0526円
(10,000口当たり純資産額)	(30,526円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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 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。 投資証券 （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。 派生商品評価勘定 先物取引 （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。 派生商品評価勘定 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。 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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	234,207,680,093円
同期中における追加設定元本額	19,090,087,769円
同期中における一部解約元本額	21,308,701,849円
期末元本額	231,989,066,013円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	43,209,054円
バランスセレクト５０	131,206,001円
バランスセレクト７０	142,269,383円
野村外国株インデックスファンド	494,368,081円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	4,415,216,728円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	5,713,239,121円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	4,356,760,787円
野村資産設計ファンド２０１５	14,336,966円
野村資産設計ファンド２０２０	14,489,213円
野村資産設計ファンド２０２５	26,449,483円
野村資産設計ファンド２０３０	34,538,297円
野村資産設計ファンド２０３５	27,215,504円
野村資産設計ファンド２０４０	54,833,800円
野村外国株インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	32,902,677,672円
のむラップ・ファンド（保守型）	956,613,426円
のむラップ・ファンド（普通型）	7,999,822,469円
のむラップ・ファンド（積極型）	6,162,584,001円
野村資産設計ファンド２０４５	8,475,883円
野村インデックスファンド・外国株	5,571,256,726円
マイ・ロード	1,256,465,819円
ネクストコア	38,968,928円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	131,833,871円
野村外国株インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	1,999,072,413円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	829,476,519円
野村資産設計ファンド２０５０	14,060,644円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	4,662,448円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	2,299,363円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,823,976円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,216,622円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	212,885,322円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	500,353,784円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,417,827円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,239,233円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	20,895,089円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,578,012円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	30,174,092円

野村 6 資産均等バランス	862,338,540円
野村つみたて外国株投信	5,986,842,779円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	3,317,231,630円
世界 6 資産分散ファンド	56,194,188円
野村資産設計ファンド 2 0 6 0	5,380,655円
野村スリーゼロ先進国株式投信	67,712,126円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI - KOKUSAI 指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	740,380,899円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,258,652,370円
グローバル・インデックス・バランス 2 5 V A（適格機関投資家専用）	220,856,518円
グローバル・インデックス・バランス 5 0 V A（適格機関投資家専用）	137,222,950円
グローバル・インデックス・バランス 4 0 V A（適格機関投資家専用）	1,036,431,927円
グローバル・インデックス・バランス 6 0 V A（適格機関投資家専用）	2,030,768,203円
ワールド・インデックス・ファンド V A 安定型（適格機関投資家専用）	2,395,529円
ワールド・インデックス・ファンド V A バランス型（適格機関投資家専用）	6,313,320円
ワールド・インデックス・ファンド V A 積極型（適格機関投資家専用）	1,059,423円
野村ワールド・インデックス・バランス 3 5 V A（適格機関投資家専用）	2,397,823円
野村ワールド・インデックス・バランス 5 0 V A（適格機関投資家専用）	38,452,874円
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	11,774,979円
野村世界インデックス・バランス 4 0 V A（適格機関投資家専用）	12,417,483円
野村グローバル・インデックス・バランス 2 5 V A（適格機関投資家専用）	37,609,200円
野村グローバル・インデックス・バランス 5 0 V A（適格機関投資家専用）	142,320,591円
野村グローバル・インデックス・バランス 7 5 V A（適格機関投資家専用）	2,860,519,019円
野村世界バランス 2 5 V A（適格機関投資家専用）	41,575,870円
ノムラ F O F s 用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	339,408,391円
野村 F o F s 用・外国株式 M S C I - K O K U S A I インデックスファンド（適格機関投資家専用）	14,966,450,748円
野村 F O F s 用・ターゲット・リターン・8 資産バランス（2 % コース向け）（適格機関投資家専用）	967,932円
バランスセレクト 3 0（確定拠出年金向け）	2,057,952円
バランスセレクト 5 0（確定拠出年金向け）	10,672,392円
バランスセレクト 7 0（確定拠出年金向け）	11,251,116円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSAI（確定拠出年金向け）	71,901,283,992円
マイバランス 3 0（確定拠出年金向け）	2,734,260,617円
マイバランス 5 0（確定拠出年金向け）	9,412,991,814円
マイバランス 7 0（確定拠出年金向け）	8,402,343,587円
マイバランス D C 3 0	933,838,445円
マイバランス D C 5 0	2,000,224,016円
マイバランス D C 7 0	1,560,433,876円
野村 D C 外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSAI	24,842,335,057円
野村 D C 運用戦略ファンド	633,364,594円
野村 D C 運用戦略ファンド（マイルド）	50,783,368円
マイターゲット 2 0 5 0（確定拠出年金向け）	327,978,031円
マイターゲット 2 0 3 0（確定拠出年金向け）	263,990,618円
マイターゲット 2 0 4 0（確定拠出年金向け）	229,435,010円
野村世界 6 資産分散投信（D C）安定コース	13,800,587円
野村世界 6 資産分散投信（D C）インカムコース	6,705,927円

野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	29,973,961円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	4,481,077円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	3,515,332円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	3,322,264円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	118,331,618円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	85,657,129円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	42,449,793円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	51,404,359円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,516,957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

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2020年10月22日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	93,064,288
コール・ローン	1,448,765,394
株式	46,988,966,180
投資証券	1,128,315,407
派生商品評価勘定	338,855,345
未収配当金	29,618,247
差入委託証拠金	777,916,162
流動資産合計	50,805,501,023
資産合計	50,805,501,023
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	67,563,853
未払解約金	23,060,393
未払利息	835
その他未払費用	239,400
流動負債合計	90,864,481
負債合計	90,864,481
純資産の部	
元本等	
元本	23,336,552,769
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,378,083,773
元本等合計	50,714,636,542
純資産合計	50,714,636,542
負債純資産合計	50,805,501,023

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。 投資証券 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、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。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、わが国における計算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 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。 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	2,1732円
(10,000口当たり純資産額)	(21,732円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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	

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。

投資証券

（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。

派生商品評価勘定

先物取引

（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。

派生商品評価勘定

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。

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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	25,336,454,968円
同期中における追加設定元本額	2,533,279,644円
同期中における一部解約元本額	4,533,181,843円
期末元本額	23,336,552,769円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型	2,079,925,281円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,200,182,448円
野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	587,296,383円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,708,035円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,119,392円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,269,463円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,829,174円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,585,338円
野村外国株インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	7,057,849,275円
野村外国株（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	2,145,177,717円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジあり）連動型上場投信	622,837,508円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	422,468,131円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	6,483,754,456円
野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	1,411,831,604円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	680,660,012円

野村国内外マルチアセット（６資産）ファンド（適格機関投資家専用）	159,867,517円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型（適格機関投資家専用）	594,417円
野村国内外マルチアセット（６資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	452,596,618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

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	522,417,687
コール・ローン	520,840,586
株式	43,295,055,865
投資信託受益証券	1,912,396,349
投資証券	32,025,065
派生商品評価勘定	67,879,968
未収配当金	40,475,776
差入委託証拠金	762,586,862
流動資産合計	47,153,678,158
資産合計	47,153,678,158
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,683,515
未払金	51,577,780
未払解約金	33,970,365
未払利息	300
その他未払費用	1,134,500
流動負債合計	90,366,460
負債合計	90,366,460
純資産の部	
元本等	
元本	35,331,830,208
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,731,481,490
元本等合計	47,063,311,698
純資産合計	47,063,311,698
負債純資産合計	47,153,678,158

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。 投資信託受益証券
-------------------	---

	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、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。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。 投資証券 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、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。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、わが国における計算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 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。 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	1.3320円
(10,000口当たり純資産額)	(13,320円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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	

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。

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。

投資証券

（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。

派生商品評価勘定

先物取引

（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。

派生商品評価勘定

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。

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

2020年10月22日現在		
期首		2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		34,118,060,612円
同期中における追加設定元本額		4,280,393,331円
同期中における一部解約元本額		3,066,623,735円
期末元本額		35,331,830,208円
期末元本額の内訳＊		
野村資産設計ファンド２０１５		25,663,967円
野村資産設計ファンド２０２０		25,955,658円
野村資産設計ファンド２０２５		46,765,550円
野村資産設計ファンド２０３０		60,650,207円
野村資産設計ファンド２０３５		48,119,970円
野村資産設計ファンド２０４０		95,874,300円
野村資産設計ファンド２０４５		14,986,952円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,580,604,648円
ネクストコア		22,307,104円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス		313,228,609円
野村資産設計ファンド２０５０		24,654,122円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６ - ２０２８年目標型		8,257,316円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９ - ２０３１年目標型		4,032,041円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２ - ２０３４年目標型		3,203,362円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,142,435円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,549,008円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,799,147円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	10,060,918円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,367,998円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	14,504,449円
野村つみたて外国株投信	2,173,902,767円
野村外国株（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	531,520,353円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	1,204,531,511円
世界6資産分散ファンド	133,488,330円
野村資産設計ファンド2060	9,477,031円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	406,530,359円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	562,767,744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）	9,827,928円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式（適格機関投資家専用）	394,100,571円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	574,949円
野村新興国株式インデックスファンド（確定拠出年金向け）	25,174,524,239円
野村DC運用戦略ファンド	374,183,509円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	26,158,160円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	7,869,554円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	6,148,318円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	5,825,286円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	2,671,838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

米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,719,508
コール・ローン	138,594,058
株式	29,488,732,213
投資信託受益証券	27,288,542
投資証券	1,349,230,870
派生商品評価勘定	5,922,933
未収入金	149,268,099
未収配当金	29,845,326
差入委託証拠金	77,577,473
流動資産合計	31,268,179,022
資産合計	
31,268,179,022	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	126,876
未払解約金	225,583,009
未払利息	79

(2020年10月22日現在)

その他未払費用	78,300
流動負債合計	225,788,264
負債合計	225,788,264
純資産の部	
元本等	
元本	23,151,242,360
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,891,148,398
元本等合計	31,042,390,758
純資産合計	31,042,390,758
負債純資産合計	31,268,179,022

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。 投資信託受益証券 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、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。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。 投資証券 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、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。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、わが国における計算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 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。 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。

4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
-----------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	1.3409円
(10,000口当たり純資産額)	(13,409円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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 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。 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。 投資証券 （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。 派生商品評価勘定 先物取引 （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。 派生商品評価勘定 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。 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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	22,298,536,380円
同期中における追加設定元本額	3,646,780,920円
同期中における一部解約元本額	2,794,074,940円
期末元本額	23,151,242,360円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・米国株式配当貴族	7,363,582,729円
野村インデックスファンド・米国株式配当貴族・為替ヘッジ型	2,988,882,140円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,004,633円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,748,170円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,325,408円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,961,543円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,433,668円
米国株式配当貴族・為替ヘッジあり型（投資一任サービス向け）	585,994,557円
米国株式配当貴族・為替ヘッジなし型（投資一任サービス向け）	67,109,529円
米国株式配当貴族（年4回決算型）	12,125,199,983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

国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,978,026,915
国債証券	550,738,828,620
地方債証券	48,991,930,896
特殊債券	60,468,220,151
社債券	29,468,299,650
未収利息	1,117,759,845
前払費用	19,609,481
流動資産合計	696,782,675,558
資産合計	696,782,675,558
負債の部	
流動負債	
未払金	704,698,000
未払解約金	390,677,651
未払利息	3,445
流動負債合計	1,095,379,096
負債合計	1,095,379,096
純資産の部	
元本等	
元本	523,441,996,714
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	172,245,299,748
元本等合計	695,687,296,462
純資産合計	695,687,296,462
負債純資産合計	696,782,675,558

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	1,3291円
(10,000口当たり純資産額)	(13,291円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	505,925,402,477円
同期中における追加設定元本額	44,650,546,232円
同期中における一部解約元本額	27,133,951,995円
期末元本額	523,441,996,714円

2020年10月22日現在

期末元本額の内訳 *

野村国内債券インデックスファンド	437,829,837円
野村世界 6 資産分散投信（安定コース）	39,930,093,957円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）	17,222,847,669円
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）	2,814,442,419円
野村資産設計ファンド 2 0 1 5	341,210,813円
野村資産設計ファンド 2 0 2 0	344,832,565円
野村資産設計ファンド 2 0 2 5	312,910,067円
野村資産設計ファンド 2 0 3 0	237,654,722円
野村資産設計ファンド 2 0 3 5	119,247,880円
野村資産設計ファンド 2 0 4 0	172,176,233円
野村日本債券インデックスファンド	889,991,724円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	151,427,280,686円
のむらップ・ファンド（保守型）	12,782,110,273円
のむらップ・ファンド（普通型）	9,278,091,181円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,277,449,316円
野村日本債券インデックス（野村 S M A 向け）	10,561,214,784円
野村資産設計ファンド 2 0 4 5	16,712,293円
野村円債投資インデックスファンド	994,101,046円
野村インデックスファンド・国内債券	3,419,185,350円
マイ・ロード	33,537,150,627円
野村インデックスファンド・内外 7 資産バランス・為替ヘッジ型	1,278,376,549円
野村日本債券インデックス（野村 S M A ・ E W 向け）	16,297,381,242円
野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）	1,810,946,081円
野村資産設計ファンド 2 0 5 0	21,250,147円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 2 6 - 2 0 2 8 年目標型	21,266,402円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 2 9 - 2 0 3 1 年目標型	5,791,430円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 3 2 - 2 0 3 4 年目標型	3,473,815円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 3 5 - 2 0 3 7 年目標型	1,881,090円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	877,578,109円
のむらップ・ファンド（やや積極型）	250,671,100円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	54,969,157円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	29,508,166円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	73,802,193円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,921,845円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,203,217円
野村 6 資産均等バランス	1,949,691,826円
世界 6 資産分散ファンド	127,044,342円
野村資産設計ファンド 2 0 6 0	6,052,400円
N E X T F U N D S 国内債券・N O M U R A - B P I 総合連動型上場投信	2,070,057,066円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	14,866,011,288円
グローバル・インデックス・バランス 2 5 V A （適格機関投資家専用）	599,211,252円
グローバル・インデックス・バランス 5 0 V A （適格機関投資家専用）	124,101,465円

2020年10月22日現在	
グローバル・インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,948,393,621円
グローバル・インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,374,353,781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）	19,863,025円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡバランス型（適格機関投資家専用）	10,381,488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）	435,467円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,452,783,645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）	10,841,606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）	86,933,600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）	74,878,944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）	340,184,487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）	321,770,398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）	808,431,329円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	188,043,310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）	535,040,657円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	3,417,228,784円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	8,753,529円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	34,503,739,530円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	43,156,745,423円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	15,529,054,835円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - B P I 総合（確定拠出年金向け）	49,882,072,947円
マイバランスＤＣ３０	11,803,916,745円
マイバランスＤＣ５０	9,207,796,937円
マイバランスＤＣ７０	2,900,934,959円
野村ＤＣ国内債券インデックスファンド・NOMURA - B P I 総合	12,800,179,311円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	756,981,145円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	1,790,597,983円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	789,896,355円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	124,808,980円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	20,215,953円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	19,362,635円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	30,834,750円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	11,038,791円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	5,021,005円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	484,105,978円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	244,186,670円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	76,780,989円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	92,977,159円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,706,339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

外国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	147,180,561
コール・ローン	1,113,937,676
国債証券	583,630,823,732
派生商品評価勘定	575,936
未収入金	185,746,013
未収利息	5,605,328,608
前払費用	392,440,535
その他未収収益	10,965,189
流動資産合計	591,086,998,250
資産合計	591,086,998,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,652,802
未払金	655,990,938
未払解約金	489,818,375
未払利息	642
その他未払費用	5,182,758
流動負債合計	1,154,645,515
負債合計	1,154,645,515
純資産の部	
元本等	
元本	240,558,594,304
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	349,373,758,431
元本等合計	589,932,352,735
純資産合計	589,932,352,735
負債純資産合計	591,086,998,250

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 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、わが国における計算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	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	2.4523円
(10,000口当たり純資産額)	(24,523円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	166,811,229,133円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	174,907,586,504円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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	
（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。	
派生商品評価勘定	
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。	
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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	240,634,818,748円
同期中における追加設定元本額	19,177,974,749円
同期中における一部解約元本額	19,254,199,193円

期末元本額	240,558,594,304円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	80,053,576円
バランスセレクト５０	79,261,480円
バランスセレクト７０	69,207,292円
野村外国債券インデックスファンド	288,327,556円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,578,247,177円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	23,149,325,623円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	1,512,815,161円
野村資産設計ファンド２０１５	19,870,863円
野村資産設計ファンド２０２０	20,085,659円
野村資産設計ファンド２０２５	36,265,761円
野村資産設計ファンド２０３０	35,411,934円
野村資産設計ファンド２０３５	24,876,527円
野村資産設計ファンド２０４０	44,888,907円
野村外国債券インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	96,382,389,429円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,621,651,172円
のむラップ・ファンド（普通型）	12,355,148,147円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,618,108,415円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	545,700,800円
野村資産設計ファンド２０４５	5,810,825円
野村インデックスファンド・外国債券	826,656,686円
マイ・ロード	8,849,448,711円
ネクストコア	281,006,320円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	160,259,909円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	8,382,432,189円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,202,454,421円
野村資産設計ファンド２０５０	7,403,860円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	4,622,467円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	1,819,178円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,303,134円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	858,243円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	559,140,489円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	408,063,333円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,930,622円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,356,453円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,347,760円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,425,303円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,521,637円
野村６資産均等バランス	1,048,304,216円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	6,962,043,419円
世界６資産分散ファンド	68,298,499円
野村資産設計ファンド２０６０	2,115,252円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	2,711,163,099円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	1,740,163,912円
野村外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	8,271,110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）	1,288,727,429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）	266,905,025円
グローバル・インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,466,647,494円
グローバル・インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,231,476,738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）	2,912,405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）	8,371,989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）	234,118円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,093,825,716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）	13,114,726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）	70,097,139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）	15,095,887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）	160,029,592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）	173,006,132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）	1,738,699,032円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	101,096,568円
ノムラ外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,013,228,496円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	1,098,185,483円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	3,529,986円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	3,641,669円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	6,295,144円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	5,464,886円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	584,713,615円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	5,062,739,841円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	5,810,624,269円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	4,171,846,405円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	17,185,718,426円
マイバランスＤＣ３０	1,729,681,916円
マイバランスＤＣ５０	1,230,830,502円
マイバランスＤＣ７０	777,847,799円
野村ＤＣ外国債券インデックスファンド	6,634,752,393円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	4,657,324,022円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	493,132,304円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	164,444,224円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	252,595,846円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	121,707,631円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	11,184,482円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	27,166,127円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	10,410,838円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	4,594,790円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	2,878,624円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	1,749,388円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	65,059,322円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	43,915,413円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	20,641,683円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	24,995,915円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	596,349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

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	114,051,236
コール・ローン	414,120,332
国債証券	72,657,350,222
派生商品評価勘定	433,572,530
未収入金	471,136,611
未収利息	469,954,038
前払費用	41,809,090
差入委託証拠金	3,816,493
流動資産合計	74,605,810,552
資産合計	74,605,810,552
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,429,961
未払金	2,167,799
未払解約金	521,544,019
未払利息	238
その他未払費用	414,500
流動負債合計	621,556,517
負債合計	621,556,517
純資産の部	
元本等	
元本	58,955,710,357
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,028,543,678
元本等合計	73,984,254,035
純資産合計	73,984,254,035
負債純資産合計	74,605,810,552

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 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、わが国における計算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	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。

4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
-----------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	1,2549円
(10,000口当たり純資産額)	(12,549円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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 （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。
派生商品評価勘定 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。
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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	54,769,039,580円
同期中における追加設定元本額	9,404,715,728円
同期中における一部解約元本額	5,218,044,951円
期末元本額	58,955,710,357円

期末元本額の内訳*		
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型		1,349,924,019円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型		958,274,447円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		22,452,386円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		6,114,417円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		3,667,547円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,986,000円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）		8,947,822,082円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		11,926,874円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		6,076,909円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		14,453,102円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		2,800,137円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		2,977,859円
野村外国債券インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）		28,665,230,692円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）		7,698,544,216円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型		4,181,353,937円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）		266,241,548円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）		768,105,570円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）		6,047,758,615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

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	396,964,581
コール・ローン	83,998,825
国債証券	20,741,362,847
未収利息	195,527,639
前払費用	4,269,495
流動資産合計	21,422,123,387
資産合計	21,422,123,387
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	450,298
未払金	325,020,944
未払解約金	12,609,813
未払利息	48
その他未払費用	52,000
流動負債合計	338,133,103
負債合計	338,133,103
純資産の部	
元本等	
元本	10,818,093,626
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,265,896,658
元本等合計	21,083,990,284
純資産合計	21,083,990,284

(2020年10月22日現在)

負債純資産合計

21,422,123,387

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 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、わが国における計算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	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

2020年10月22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	1.9490円
(10,000口当たり純資産額)	(19,490円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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

（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。

派生商品評価勘定

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。

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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	11,405,171,087円
同期中における追加設定元本額	1,615,367,056円
同期中における一部解約元本額	2,202,444,517円
期末元本額	10,818,093,626円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	689,932,526円
ネクストコア	38,561,735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	874,113,004円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,463,030円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,386,426円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	11,774,898円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,566,315円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	8,261,113円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	970,799,092円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	1,717,841,977円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	275,504,715円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	385,558,862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）	6,371,992円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,437,315円
新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	585,217,300円
野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	4,575,081,090円
野村DC運用戦略ファンド	596,357,756円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	68,864,480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

米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	64,777,657
コール・ローン	35,650,187
社債券	3,074,725,160
未収入金	97,583
未収利息	38,033,899
前払費用	3,449,744
流動資産合計	3,216,734,230
資産合計	3,216,734,230
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	181,500
未払金	42,641,177
未払解約金	184,383
未払利息	20
流動負債合計	43,007,080
負債合計	43,007,080
純資産の部	
元本等	
元本	2,576,054,285
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	597,672,865
元本等合計	3,173,727,150
純資産合計	3,173,727,150
負債純資産合計	3,216,734,230

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	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。 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、わが国における計算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	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。

4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
-----------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	1,2320円
(10,000口当たり純資産額)	(12,320円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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 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。
派生商品評価勘定 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。
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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	2,922,210,035円
同期中における追加設定元本額	717,205,423円
同期中における一部解約元本額	1,063,361,173円
期末元本額	2,576,054,285円

期末元本額の内訳 *	
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券	570,498,734円
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券・為替ヘッジ型	277,667,164円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,205,173円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,532,980円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	8,057,610円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,127,357円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,100,513円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	670,843,523円
米国ハイ・イールド債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	1,036,021,231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

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	409,488,169
投資証券	35,785,815,800
未収入金	236,210,586
未収配当金	320,821,090
差入委託証拠金	259,896,000
流動資産合計	37,012,231,645
資産合計	37,012,231,645
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,350,800
未払金	43,890,140
未払解約金	19,260,558
未払利息	236
流動負債合計	87,501,734
負債合計	87,501,734
純資産の部	
元本等	
元本	17,197,518,257
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,727,211,654
元本等合計	36,924,729,911
純資産合計	36,924,729,911
負債純資産合計	37,012,231,645

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	投資証券
-------------------	------

2.費用・収益の計上基準 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 受取配当金 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。 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
--	--

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	2,1471円
(10,000口当たり純資産額)	(21,471円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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 投資証券 （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。 派生商品評価勘定 先物取引 （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

2020年10月22日現在

期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	18,258,534,194円
同期中における追加設定元本額	3,027,656,519円
同期中における一部解約元本額	4,088,672,456円
期末元本額	17,197,518,257円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,005,783,516円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,595,449,500円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	848,264,626円
野村資産設計ファンド2015	17,141,030円
野村資産設計ファンド2020	17,321,789円
野村資産設計ファンド2025	20,957,844円
野村資産設計ファンド2030	20,465,262円
野村資産設計ファンド2035	21,564,494円
野村資産設計ファンド2040	38,921,274円
野村資産設計ファンド2045	3,357,993円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,394,492,516円
ネクストコア	27,173,347円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,155,886,156円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,218,589,053円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	606,759,912円
野村資産設計ファンド2050	5,123,738円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	920,015円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,103,089円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,459,788円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,232,811円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,506,793円
野村6資産均等バランス	1,175,252,130円
野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	91,805,905円
野村資産設計ファンド2060	1,824,157円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	111,750,719円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	63,217,469円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	140,566,513円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,706,512,456円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	398,687,559円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	329,789円
野村DC運用戦略ファンド	442,486,871円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	34,582,923円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	6,269,453円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,046,516円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	5,835,787円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	2,655,264円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	2,495,275円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,210,643円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	514,282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

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年10月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	233,828,541
コール・ローン	122,046,143
投資証券	28,364,591,617
派生商品評価勘定	158,408
未収配当金	25,175,463
差入委託証拠金	97,083,413
流動資産合計	28,842,883,585
資産合計	28,842,883,585
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,947,439
未払金	196,210,252
未払解約金	3,459,128
未払利息	70
その他未払費用	397,300
流動負債合計	206,014,189
負債合計	206,014,189
純資産の部	
元本等	
元本	13,999,087,570
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,637,781,826
元本等合計	28,636,869,396
純資産合計	28,636,869,396
負債純資産合計	28,842,883,585

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	投資証券 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、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。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、わが国における計算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

	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。 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。 配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2020年10月22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	2,0456円
(10,000口当たり純資産額)	(20,456円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年10月22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	

投資証券

（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。

派生商品評価勘定

先物取引

（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。

派生商品評価勘定

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。

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

2020年10月22日現在	
期首	2020年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	13,267,520,967円
同期中における追加設定元本額	2,471,523,012円
同期中における一部解約元本額	1,739,956,409円
期末元本額	13,999,087,570円
期末元本額の内訳＊	
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,180,206,903円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	2,821,126,229円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	922,017,152円
野村資産設計ファンド２０１５	18,630,020円
野村資産設計ファンド２０２０	18,828,041円
野村資産設計ファンド２０２５	22,780,016円
野村資産設計ファンド２０３０	22,244,651円
野村資産設計ファンド２０３５	23,439,567円
野村資産設計ファンド２０４０	42,303,551円
野村資産設計ファンド２０４５	3,650,005円
野村インデックスファンド・外国ＲＥＩＴ	1,638,107,845円
ネクストコア	20,161,830円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	390,589,476円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	486,674,900円
野村資産設計ファンド２０５０	5,569,299円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	975,414円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,385,294円

インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,581,598円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,911,409円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,422,528円
野村 6 資産均等バランス	1,277,452,434円
野村資産設計ファンド 2060	1,982,787円
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	2,088,625,190円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	1,013,149,272円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA（適格機関投資家専用）	539,104,880円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT（適格機関投資家専用）	66,101,641円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	358,470円
野村DC運用戦略ファンド	330,715,959円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	26,048,544円
野村世界 6 資産分散投信（DC）安定コース	6,814,646円
野村世界 6 資産分散投信（DC）インカムコース	3,311,395円
野村世界 6 資産分散投信（DC）成長コース	6,343,268円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	2,886,167円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	2,712,265円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,315,920円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	559,004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

2 ファンドの現況

純資産額計算書

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11月30日現在

資産総額	146,832,205円
負債総額	6,689,792円
純資産総額（ - ）	140,142,413円
発行済口数	127,344,740口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1005円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11月30日現在

資産総額	103,404,614円
負債総額	6,437,167円
純資産総額（ - ）	96,967,447円
発行済口数	84,973,454口

1口当たり純資産額（ / ）	1.1411円
----------------	---------

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11月30日現在

資産総額	361,324,062円
負債総額	24,622,376円
純資産総額（ - ）	336,701,686円
発行済口数	286,959,981口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1733円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11月30日現在

資産総額	95,972,046円
負債総額	7,063,846円
純資産総額（ - ）	88,908,200円
発行済口数	74,203,432口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1982円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年11月30日現在

資産総額	280,140,636円
負債総額	16,497,380円
純資産総額（ - ）	263,643,256円
発行済口数	212,382,041口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2414円

（参考）国内株式マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	464,021,719,604円
負債総額	29,203,491,453円
純資産総額（ - ）	434,818,228,151円
発行済口数	239,680,670,948口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8142円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	793,741,086,246円
負債総額	3,757,376,168円
純資産総額（ - ）	789,983,710,078円
発行済口数	242,260,553,706口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2609円

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	117,407,411,422円
負債総額	55,030,608,108円
純資産総額（ - ）	62,376,803,314円
発行済口数	26,774,627,727口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3297円

（参考）新興国株式マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	52,022,002,861円
負債総額	290,355,187円
純資産総額（ - ）	51,731,647,674円
発行済口数	36,074,104,927口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4340円

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	31,197,489,594円
負債総額	1,880,375円
純資産総額（ - ）	31,195,609,219円
発行済口数	21,845,303,859口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4280円

（参考）国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	721,957,761,421円
------	------------------

負債総額	18,904,567,947円
純資産総額（ - ）	703,053,193,474円
発行済口数	528,766,770,220口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3296円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	576,658,918,239円
負債総額	1,543,453,675円
純資産総額（ - ）	575,115,464,564円
発行済口数	233,597,417,365口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4620円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	154,257,909,851円
負債総額	77,744,760,619円
純資産総額（ - ）	76,513,149,232円
発行済口数	60,789,708,180口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2587円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	8,662,105,901円
負債総額	7,271,535円
純資産総額（ - ）	8,654,834,366円
発行済口数	6,401,486,141口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3520円

（参考）新興国債券マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	21,455,761,284円
負債総額	707,847円
純資産総額（ - ）	21,455,053,437円
発行済口数	10,749,034,094口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9960円

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	3,544,024,804円
負債総額	963,128円
純資産総額（ - ）	3,543,061,676円
発行済口数	2,835,047,893口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2497円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	40,196,374,627円
負債総額	1,844,910,001円
純資産総額（ - ）	38,351,464,626円
発行済口数	17,676,977,511口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1696円

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	32,298,515,785円
負債総額	11,910,223円
純資産総額（ - ）	32,286,605,562円
発行済口数	14,598,821,643口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2116円

（参考）海外R E I Tインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	13,699,156,013円
負債総額	6,395,556,416円
純資産総額（ - ）	7,303,599,597円
発行済口数	5,171,944,449口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4122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11月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は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。

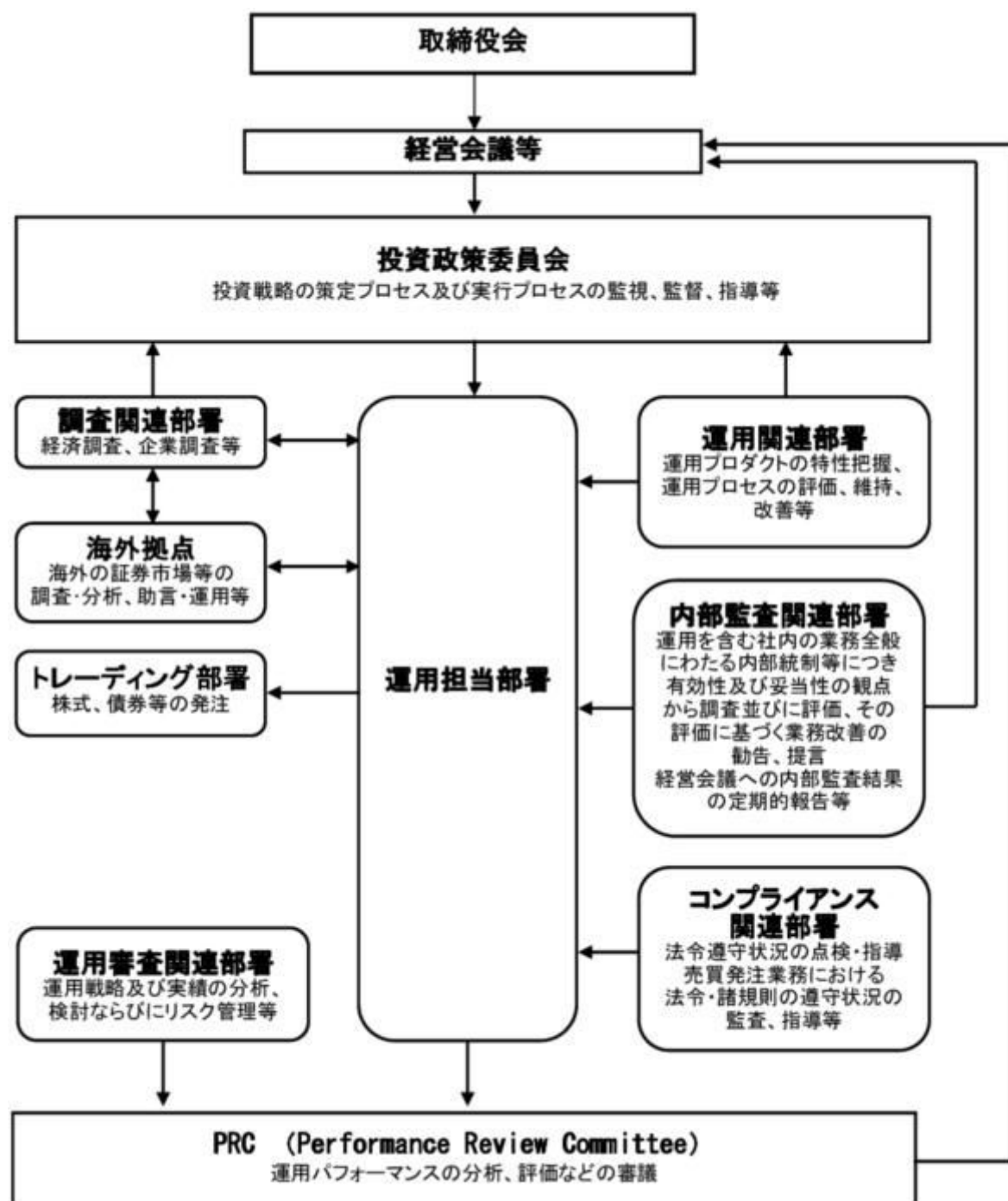
代表取締役・業務執行取締役

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10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	996	30,938,603
単位型株式投資信託	189	817,006
追加型公社債投資信託	14	5,731,753
単位型公社債投資信託	476	1,633,268
合計	1,675	39,120,629

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(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2020年4月1日から2020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

		前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		1,562	2,626
金銭の信託		45,493	41,524
有価証券		19,900	24,399
前払費用		27	106
未収入金		500	522
未収委託者報酬		25,246	23,936

未収運用受託報酬			5,933		4,336
その他			269		71
貸倒引当金			15		14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産			714		645
建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	
投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		0	
投資損失引当金		707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

		前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本			86,924		85,270

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			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 損益計算書

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		119,196	115,736
運用受託報酬		21,440	17,170
その他営業収益		355	340
営業収益計		140,992	133,247
営業費用			
支払手数料		42,675	39,435
広告宣伝費		1,210	1,006
公告費		0	-
調査費		30,082	26,833
調査費		5,998	5,696
委託調査費		24,083	21,136
委託計算費		1,311	1,342
営業雑経費		5,435	5,823
通信費		92	75
印刷費		970	958
協会費		86	92
諸経費		4,286	4,696
営業費用計		80,715	74,440
一般管理費			
給料		11,113	11,418
役員報酬		379	109
給料・手当		7,067	7,173
賞与		3,666	4,134
交際費		107	86
旅費交通費		514	391
租税公課		1,048	1,029
不動産賃借料		1,223	1,227

退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348
諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2018年4月 1 日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本		
		資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	株 主 資 本 合 計
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							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			
剰余金の配当			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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	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		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650

当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

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

[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。 <table> <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> (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。	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								

4．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
5．消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。
6．連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[未適用の会計基準等]

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（２）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

（１）概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

（２）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

（１）概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

（２）適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

（１）概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

（２）適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020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 1,434百万円	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 1,296百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 736百万円 器具備品 3,106 合計 3,842	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 761百万円 器具備品 2,347 合計 3,109

損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月 1 日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月 1 日 至 2020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 6,531百万円 支払利息 1	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソ フ ト ウ エ 307 ア 合計 310	2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソ フ ト ウ エ 59 ア 合計 67
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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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1,562百万円、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	-	-	-

当事業年度（自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバ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。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（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。

当事業年度（自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日）

１．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

４．その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(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业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2．確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	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%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
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、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,462 百万円
年金資産	17,413

	3,048
--	-------

非積立型制度の退職給付債務	3,299
---------------	-------

未積立退職給付債務	6,347
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	4,764
-------------	-------

未認識過去勤務費用	185
-----------	-----

貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
----------------------	-------

退職給付引当金	3,311
---------	-------

前払年金費用	1,545
--------	-------

貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
----------------------	-------

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
------	-----------

利息費用	154
------	-----

期待運用収益	436
--------	-----

数理計算上の差異の費用処理額	572
----------------	-----

過去勤務費用の費用処理額	35
--------------	----

確定給付制度に係る退職給付費用	1,289
-----------------	-------

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
----	-----

株式	24%
----	-----

生保一般勘定	12%
--------	-----

生保特別勘定	7%
--------	----

その他	0%
-----	----

合計	100%
----	------

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.6%
-----------------	------

退職一時金制度の割引率	0.5%
-------------	------

長期期待運用収益率	2.5%
-----------	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.4%
タックスヘイブン税制	2.6%	タックスヘイブン税制	2.6%
外国税額控除	0.6%	外国税額控除	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	1.3%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%

セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

１．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

（１）製品・サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

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 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)
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	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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*2）	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㈱（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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

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

親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入（*2）	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

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

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1 株当たり純資産額	16,882円89銭	1 株当たり純資産額	16,557円31銭
1 株当たり当期純利益	4,984円30銭	1 株当たり当期純利益	4,658円88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	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		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

		2020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		2,307
金銭の信託		40,828
有価証券		10,500
未収委託者報酬		24,249
未収運用受託報酬		4,560
その他		894
貸倒引当金		14
流動資産計		83,326
固定資産	1	
有形固定資産		2,998
無形固定資産		5,462
ソフトウェア		5,461
その他		0
投資その他の資産		15,942
投資有価証券		1,701
関係会社株式		10,171
前払年金費用		1,429
繰延税金資産		2,003
その他		636
固定資産計		24,403
資産合計		107,730

		2020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		11,513
未払収益分配金		0
未払償還金		0
未払手数料		6,651
関係会社未払金		4,007
その他未払金	2	853
未払費用		9,953
未払法人税等		1,444
賞与引当金		2,005
その他		147
流動負債計		25,063
固定負債		
退職給付引当金		3,350
時効後支払損引当金		579
資産除去債務		1,371
固定負債計		5,300
負債合計		30,364
(純資産の部)		
株主資本		77,365
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		46,455

利益準備金		685
その他利益剰余金		45,770
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,163
評価・換算差額等		0
その他有価証券評価差額金		0
純資産合計		77,366
負債・純資産合計		107,730

中間損益計算書

		自 2020年4月 1日 至 2020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		52,814
運用受託報酬		7,648
その他営業収益		178
営業収益計		60,641
営業費用		
支払手数料		16,811
調査費		11,994
その他営業費用		3,835
営業費用計		32,641
一般管理費	1	13,883
営業利益		14,115
営業外収益	2	6,145
営業外費用	3	33
経常利益		20,227
特別利益	4	2,228
特別損失	5	445
税引前中間純利益		22,011
法人税、住民税及び事業税		5,226
法人税等調整額		739
中間純利益		16,045

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当中間期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
中間純利益							16,045	16,045	16,045
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	-	-	-	-	-	-	7,905	7,905	7,905
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,163	46,455	77,365

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当中間期変動額			
剰余金の配当			23,950
中間純利益			16,045
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	10	10	10
当中間期変動額合計	10	10	7,915
当中間期末残高	0	0	77,366

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。

3 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、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。 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (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。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、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 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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
5 消費税等の会計処理	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。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2020年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	648百万円

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 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
1	減価償却実施額	
	有形固定資産	180百万円
	無形固定資産	1,125百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	受取配当金	4,540百万円
	金銭信託運用益	1,360百万円
3	営業外費用のうち主要なもの	
	時効後支払損引当金繰入	10百万円
	為替差損	9百万円
4	特別利益の内訳	
	投資有価証券等売却益	71百万円
	株式報酬受入益	26百万円
	移転補償金	2,130百万円
5	特別損失の内訳	
	投資有価証券等評価損	36百万円
	固定資産除却損	2百万円
	事務所移転費用	406百万円

中間株主資本等変動計算書関係

		自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日										
1	発行済株式に関する事項											
	<table><tr><td>株式の種類</td><td>当事業年度期首</td><td>増加</td><td>減少</td><td>当中間会計期間末</td></tr><tr><td>普通株式</td><td>5,150,693株</td><td>-</td><td>-</td><td>5,150,693株</td></tr></table>	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株	
株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末								
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株								
2	配当に関する事項											
	配当金支払額											
	2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。											
	・普通株式の配当に関する事項											
	(1) 配当金の総額	23,950百万円										
	(2) 1株当たり配当額	4,650円										
	(3) 基準日	2020年3月31日										
	(4) 効力発生日	2020年6月30日										

金融商品関係

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2020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	2,307	2,307	-
(2)金銭の信託	40,828	40,828	-
(3)未収委託者報酬	24,249	24,249	-
(4)未収運用受託報酬	4,560	4,560	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	10,500	10,500	-
資産計	82,445	82,445	-
(6)未払金	11,513	11,513	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	0	0	-
未払手数料	6,651	6,651	-
関係会社未払金	4,007	4,007	-
その他未払金	853	853	-
(7)未払費用	9,953	9,953	-
(8)未払法人税等	1,444	1,444	-
負債計	22,911	22,911	-

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1,701百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（５）有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当中間会計期間において、非上場株式について35百万円（投資有価証券35百万円）減損処理を行っております。

有価証券関係

当中間会計期間末（2020年9月30日）

１．満期保有目的の債券(2020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(2020年9月30日)

該当事項はありません。

３．その他有価証券(2020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	10,500	10,500	-
小計	10,500	10,500	-
合計	10,500	10,500	-

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減（単位：百万円）

	自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
期首残高	-
有形固定資産の取得に伴う増加	1,371
時の経過による調整額	-
中間期末残高	1,371

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
1株当たり純資産額	15,020円52銭	
1株当たり中間純利益	3,115円15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	16,045百万円	
普通株主に帰属しない金額	-	
普通株式に係る中間純利益	16,045百万円	
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
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2020年10月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券 a u カブコム証券株式会社 松井証券株式会社 マネックス証券株式会社 山和証券株式会社 楽天証券株式会社	48,323百万円 7,196百万円 11,945百万円 12,200百万円 585百万円 7,495百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社 株式会社京葉銀行 株式会社第四北越銀行 株式会社百五銀行	35,000百万円 49,759百万円 32,776百万円 20,000百万円	

* 2020年10月末現在

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月11日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月23日から2020年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年10月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年4月23日から2020年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月11日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月23日から2020年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年10月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年4月23日から2020年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月11日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月23日から2020年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年10月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年4月23日から2020年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月11日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月23日から2020年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年10月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年4月23日から2020年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月11日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀井純子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月23日から2020年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年10月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年4月23日から2020年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年6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

東京事務所

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

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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

2020年11月25日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村健二郎
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水永真太郎
--------------------	-------	-------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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。