

【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10月8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 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	野村外国債券（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）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2021年4月9日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

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

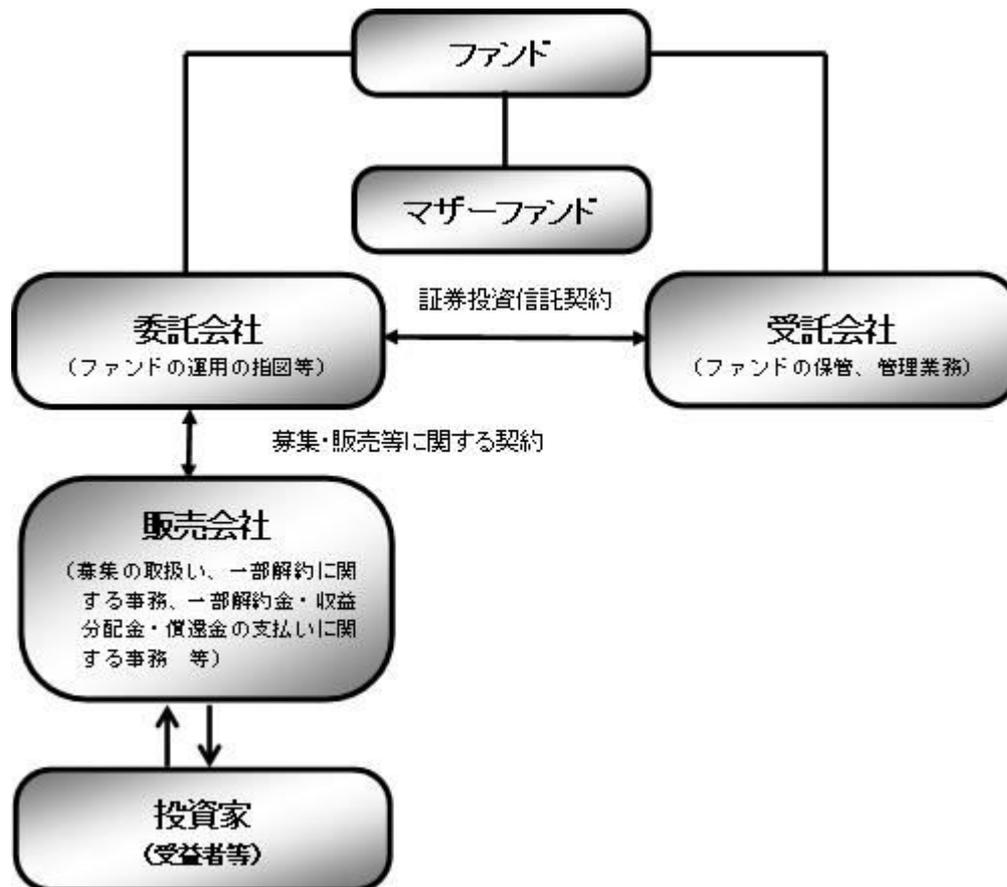
第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

<更新後>



ファンド	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）
マザーファンド (親投資信託)	外国債券マザーファンド 新興国債券マザーファンド
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

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



※各マザーファンドに代えて、ETFに直接投資する場合があります。

< 更新後 >

委託会社の概況(2021年8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

野村証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%

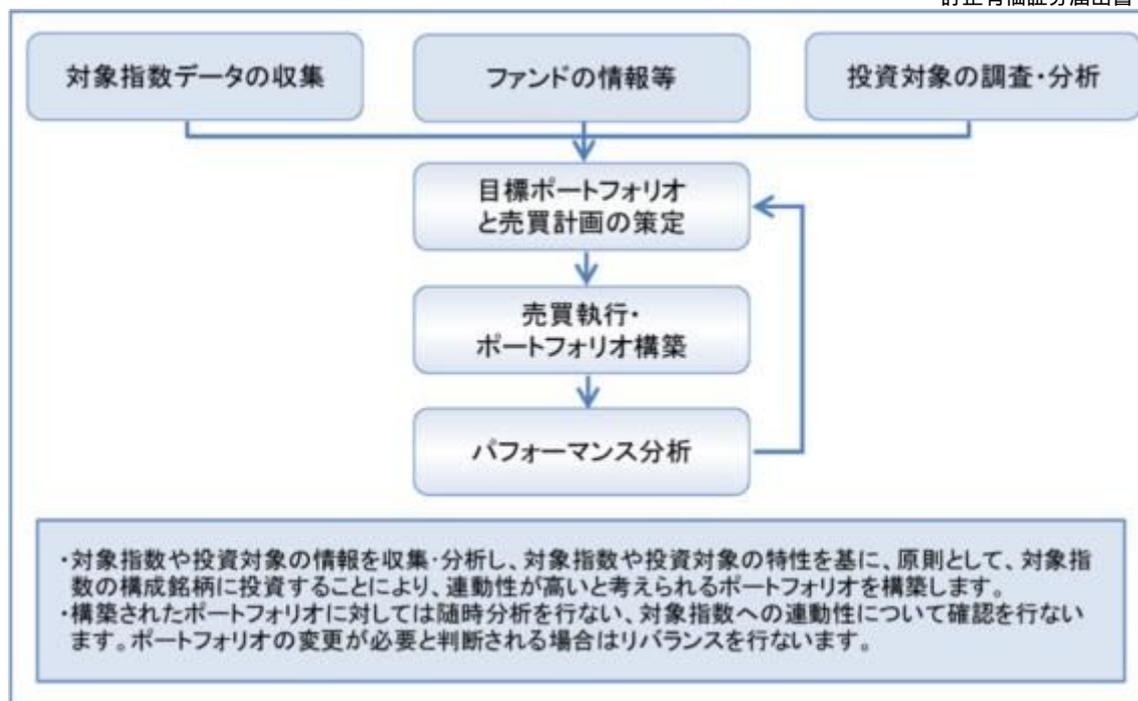
2 投資方針

(1) 投資方針

< 更新後 >

外国債券マザーファンド受益証券および新興国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、対象指数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。

投資プロセス



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

各マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として外国（新興国を含みます。）の債券に投資します。

各マザーファンド受益証券への投資配分比率は、対象指数における先進国（除く日本）および新興国の割合をもとに決定します。投資配分比率は、適宜見直しを行ないません。

2021年10月8日現在の投資割合

投資対象地域	マザーファンド名	主要投資対象	対象指数	投資割合
先進国 (除く日本)	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）	85.0%
新興国	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）	15.0%

各マザーファンド受益証券の組入比率の合計は、原則として高位を維持することを基本とします。

対象指数の動きに効率的に連動す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および為替予約取引を実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、ヘッジ目的外の利用も含め実質的に活用する場合があります。

実質組入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。

指数の著作権等について

・ 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。

・ 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・エー、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。

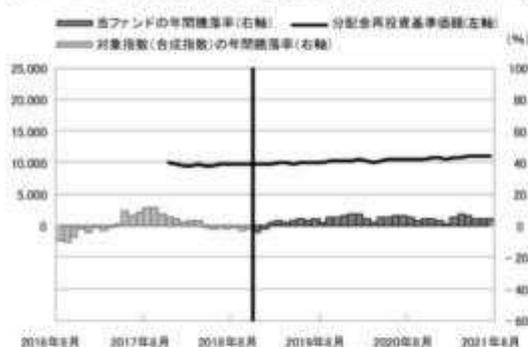
3 投資リスク

< 更新後 >

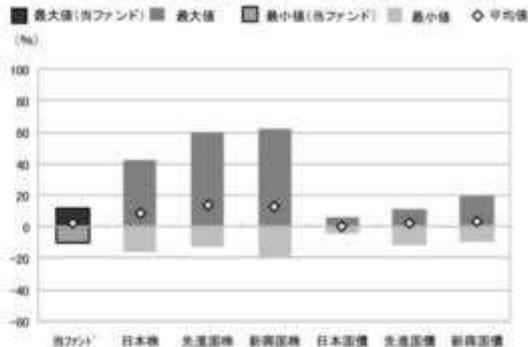
リスクの定量的比較

(2016年9月末～2021年8月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉



〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	11.3	42.1	59.8	62.7	6.2	11.4	19.3
最小値(%)	△ 9.9	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 11.4	△ 9.4
平均値(%)	2.5	8.9	13.7	12.8	0.4	2.5	3.7

- 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、2016 年 9 月から 2021 年 8 月の 5 年間の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、2018 年 11 月までは、対象指数(合成指数)の騰落率を表示しております。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2016 年 9 月から 2021 年 8 月の 5 年間の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象指数(合成指数)を用いて算出しております。
- 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、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLD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 LLDの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLD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)についてはここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、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IRMーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価値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予測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JP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)、「指数スポンサー」は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、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推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPMS, JP 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 LLD 他)

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

< 更新後 >

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。

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

信託報酬率	年0.33%（税抜年0.30%）以内 （2021年9月末現在 年0.33%（税抜年0.30%））
-------	--------------------------------------------------------

信託報酬率の配分は下記の通りとします。

支払先の配分（税抜）および役務の内容	
< 委託会社 > ファンドの運用とそれに伴う調査、 受託会社への指図、 法定書面等の作成、 基準価額の算出等	年0.22%以内 （2021年9月末現在年0.22%）
< 販売会社 > 購入後の情報提供、 運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理 および事務手続き等	年0.05%
< 受託会社 > ファンドの財産の保管・管理、 委託会社からの指図の実行等	年0.03%

* ファンドがETFに投資する場合は、上記の信託報酬に加え、投資するETFに関連する費用がかかりますが投資するETFとその比率があらかじめ定まっていなかったため記載することができません。

なお、当該費用のうち委託会社が収受する分に関しては、信託報酬の調整を行いません。

信託報酬率の調整について

信託報酬率の調整は以下の計算方法をもって行いません。信託報酬率は毎月1回計算し、当月の第5営業日目を降で前日が営業日となる最初の営業日（「適用開始営業日」といいます。）から翌月の適用開始営業日の前日まで適用することとします。

信託報酬率=年0.30%（税抜）- 対象ETFの委託会社報酬率（税抜）×対象ETFの投資割合

なお、信託報酬率は、信託報酬率のうち委託会社が受取る部分がゼロとなる水準を下限値とし、年0.30%（税抜）以内の範囲で委託会社が定めるものとします。

- ・対象ETFは、ファンドが投資するETFのうち、ファンドの委託会社が設定したETFとし、各マザーファンドに代えて投資するものをいいます。
- ・対象ETFの委託会社報酬率は、原則として、目論見書その他公表資料で開示されている当該各月の前月最終営業日時点の対象ETFの信託報酬率（税抜の年率値）のうち、純資産総額に応じて一定の率で委託会社が受取る部分（税抜の年率値）をいいます。
- ・対象ETFの投資割合は、当該各月の前月における対象ETFの投資割合の平均値とします。
- ・複数の対象ETFに投資する場合の「対象ETFの委託会社報酬率（税抜）×対象ETFの投資割合」は、各対象ETFについて算出した「当該各対象ETFの委託会社報酬率（税抜）×当該各対象ETFの投資割合」を

合計した値とします。

（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》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 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 <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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。

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。

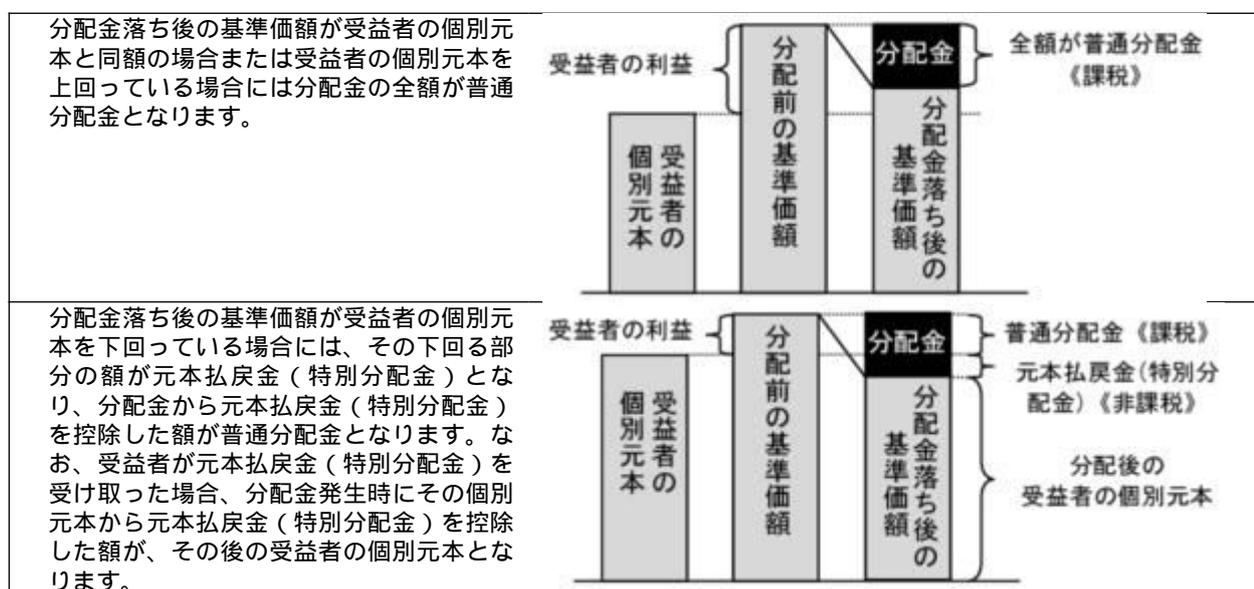
個別元本について

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(2021年8月末現在)が変更になる場合があります。

5 運用状況

以下は2021年8月31日現在の運用状況であります。

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

(1) 投資状況

野村外国債券（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）

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	19,144,897,325	99.97
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,571,869	0.02
合計（純資産総額）		19,150,469,194	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	274,694,881,615	45.01
	カナダ	12,202,517,838	1.99
	メキシコ	4,347,637,508	0.71
	ドイツ	41,072,012,066	6.73
	イタリア	62,205,948,496	10.19
	フランス	57,924,278,434	9.49
	オランダ	10,237,222,294	1.67
	スペイン	39,275,807,791	6.43
	ベルギー	14,565,674,364	2.38
	オーストリア	8,877,320,937	1.45
	フィンランド	2,674,819,955	0.43
	アイルランド	8,389,716,713	1.37
	イギリス	38,587,253,181	6.32
	スウェーデン	1,768,052,706	0.28
	ノルウェー	1,472,472,371	0.24
	デンマーク	3,119,580,945	0.51
	ポーランド	3,487,254,364	0.57
	オーストラリア	11,571,586,529	1.89
	シンガポール	2,667,722,847	0.43
	マレーシア	2,894,048,326	0.47
イスラエル	2,841,042,965	0.46	
	小計	604,876,852,245	99.12
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,312,418,566	0.87
合計（純資産総額）		610,189,270,811	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	26,381,375,392	98.39
現金・預金・その他資産（負債控除後）		430,708,359	1.60

合計(純資産総額)	26,812,083,751	100.00
-----------	----------------	--------

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

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)

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	外国債券マザーファンド	6,344,389,247	2.5448	16,145,266,564	2.5578	16,227,678,815	84.73
2	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	1,375,851,771	2.0858	2,869,854,433	2.1203	2,917,218,510	15.23

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	99.97
合計	99.97

(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 N/B	105,300,000	14,903.91	15,693,822,549	15,100.08	15,900,392,093	5.375	2031/2/15	2.60
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	65,000,000	13,719.39	8,917,604,539	13,568.35	8,819,431,535	6	2026/2/15	1.44
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	52,700,000	14,256.13	7,512,981,091	14,305.03	7,538,750,912	5.5	2028/8/15	1.23
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	66,000,000	11,264.10	7,434,307,155	11,209.37	7,398,184,393	1.5	2023/2/28	1.21
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,600,000	12,215.53	7,036,150,659	12,313.52	7,092,588,271	2.875	2028/5/15	1.16
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,400,000	14,124.46	6,836,239,942	14,203.71	6,874,598,341	5.25	2028/11/15	1.12
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	11,505.58	5,925,376,203	12,331.12	6,350,528,287	2.5	2046/2/15	1.04
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,100,000	11,298.11	5,999,301,339	11,238.56	5,967,676,384	1.75	2023/1/31	0.97
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	11,770.46	5,955,853,490	11,715.94	5,928,265,667	2.25	2025/11/15	0.97
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,400,000	11,232.33	5,885,745,127	11,184.04	5,860,437,818	1.875	2022/8/31	0.96
11	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	28,200,000	20,304.65	5,725,913,102	20,623.30	5,815,771,672	5.75	2032/7/30	0.95
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,500,000	11,707.49	5,678,137,468	11,625.78	5,638,507,174	2.5	2024/5/15	0.92
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	17,792.17	5,319,859,159	18,085.27	5,407,495,880	5.25	2029/11/1	0.88

14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,550,000	20,054.00	5,123,798,584	20,976.73	5,359,555,789	3.25	2045/5/25	0.87
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,000,000	18,830.01	5,272,404,420	18,880.85	5,286,639,065	5.5	2029/4/25	0.86
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	17,991.72	5,253,584,276	18,029.50	5,264,615,110	6.5	2027/11/1	0.86
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,711.64	5,281,952,959	11,636.94	5,248,264,192	2.375	2024/8/15	0.86
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,300,000	20,836.65	5,063,306,350	21,207.92	5,153,524,654	4.75	2035/4/25	0.84
19	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,534.26	5,141,842,774	15,466.82	5,119,520,531	3.5	2026/4/25	0.83
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,000,000	11,569.99	5,090,799,407	11,496.99	5,058,679,768	2.25	2023/12/31	0.82
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	11,826.29	5,002,522,255	11,819.40	4,999,606,627	2.375	2026/4/30	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,688.03	4,979,103,525	11,594.87	4,939,418,288	2.75	2023/11/15	0.80
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,636.52	4,968,794,389	11,566.54	4,938,914,839	2.125	2024/9/30	0.80
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	11,519.32	4,596,209,621	12,297.63	4,906,757,345	2.5	2045/2/15	0.80
25	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	22,200,000	21,008.77	4,663,947,866	21,929.89	4,868,436,976	3.25	2044/1/22	0.79
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,501.55	4,850,602,800	12,292.05	4,769,318,013	6.25	2023/8/15	0.78
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,700,000	12,568.60	4,486,991,379	13,354.56	4,767,580,290	3	2044/11/15	0.78
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,861.47	4,507,359,296	11,912.12	4,526,609,072	2.375	2027/5/15	0.74
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000	21,202.42	4,325,293,992	21,454.53	4,376,725,933	5.75	2032/10/25	0.71
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,200,000	11,684.71	4,346,713,145	11,625.78	4,324,793,131	2.25	2024/11/15	0.70

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.12
合計	99.12

(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	4,400,000	13,717.38	603,565,085	14,211.55	625,308,360	5.25	2047/6/23	2.33
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	14,537,686	3,463.66	503,536,508	3,867.27	562,211,729	1.125	2035/7/9	2.09
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	10,365,309	3,947.84	409,206,629	4,315.66	447,331,816	0.5	2030/7/9	1.66
4	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	3,600,000	12,303.06	442,910,188	12,358.25	444,897,180	4.25	2027/6/23	1.65

5	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3,400,000	11,945.19	406,136,659	11,791.77	400,920,365	5.625	2047/2/21	1.49
6	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	3,200,000	11,830.88	378,588,444	12,006.57	384,210,400	7.375	2025/2/5	1.43
7	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,800,000	13,025.31	364,708,865	13,383.75	374,745,109	5.1	2035/3/28	1.39
8	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000	11,913.59	321,667,189	12,252.75	330,824,277	7.625	2029/4/26	1.23
9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	16,013.82	304,262,710	16,417.41	311,930,819	6.75	2044/1/15	1.16
10	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000	12,258.38	294,201,201	12,918.63	310,047,242	5	2051/4/27	1.15
11	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,750,000	17,343.59	303,512,891	17,382.11	304,186,990	9.5	2030/2/2	1.13
12	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000	12,400.78	297,618,871	12,576.79	301,842,987	4.15	2027/3/28	1.12
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,750,000	16,510.14	288,927,583	16,807.61	294,133,200	7.75	2038/1/17	1.09
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2,600,000	11,139.63	289,630,460	11,277.93	293,226,388	2.783	2031/1/23	1.09
15	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	13,969.44	279,388,879	14,601.20	292,024,082	5.625	2042/4/4	1.08
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	14,826.35	281,700,735	15,345.44	291,563,491	5.95	2046/1/8	1.08
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	11,722.50	293,062,637	11,613.35	290,333,820	5	2045/6/15	1.08
18	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000	11,972.56	287,341,518	11,908.37	285,801,105	4.625	2028/1/13	1.06
19	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,010,000	13,647.66	274,318,000	14,205.06	285,521,898	6.05	2040/1/11	1.06
20	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,600,000	10,872.61	282,688,076	10,945.27	284,577,038	2.659	2031/5/24	1.06
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,600,000	10,380.70	269,898,377	10,731.07	279,007,966	6.625	2045/2/17	1.04
22	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000	12,389.74	272,574,310	12,638.44	278,045,791	4.5	2029/4/22	1.03
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	2,200,000	12,347.41	271,643,127	12,596.18	277,116,147	4.5	2056/4/1	1.03
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000	14,085.82	267,630,677	14,422.01	274,018,230	5.35	2049/2/11	1.02
25	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000	11,350.69	272,416,603	11,371.35	272,912,472	2.875	2025/6/6	1.01
26	アメリカ	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000	12,870.69	257,413,934	13,233.71	264,674,368	9.75	2028/11/1	0.98
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	6,100,000	3,905.12	238,212,756	4,329.29	264,086,733	2.5	2041/7/9	0.98
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	11,135.61	256,119,202	11,364.37	261,380,610	6	2027/3/25	0.97
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	5,686,159	4,120.92	234,322,080	4,558.98	259,230,947	2	2038/1/9	0.96
30	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	12,385.04	247,700,972	12,575.31	251,506,370	4.375	2029/3/21	0.93

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.39
合計	98.39

投資不動産物件

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）

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）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

野村外国債券（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）

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）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（3）運用実績

純資産の推移

野村外国債券（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）

2021年8月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間	(2018年 1月17日)	1,277	1,277	0.9942	0.9942
第2特定期間	(2018年 7月17日)	19,476	19,524	0.9705	0.9729
第3特定期間	(2019年 1月17日)	22,264	22,322	0.9258	0.9282
第4特定期間	(2019年 7月17日)	24,332	24,393	0.9517	0.9541
第5特定期間	(2020年 1月17日)	23,732	23,791	0.9745	0.9769
第6特定期間	(2020年 7月17日)	21,404	21,457	0.9808	0.9832
第7特定期間	(2021年 1月18日)	19,160	19,201	0.9683	0.9704
第8特定期間	(2021年 7月19日)	18,838	18,878	0.9905	0.9926
	2020年 8月末日	20,992		0.9809	

9月末日	20,815		0.9797
10月末日	20,237		0.9631
11月末日	19,624		0.9745
12月末日	19,474		0.9809
2021年 1月末日	19,271		0.9761
2月末日	18,645		0.9643
3月末日	18,887		0.9816
4月末日	18,867		0.9797
5月末日	18,800		0.9924
6月末日	18,815		0.9915
7月末日	18,995		0.9942
8月末日	19,150		0.9945

分配の推移

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）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	0.0000円
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	0.0120円
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	0.0144円
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	0.0144円
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	0.0144円
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	0.0144円
第7特定期間	2020年 7月18日～2021年 1月18日	0.0135円
第8特定期間	2021年 1月19日～2021年 7月19日	0.0126円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

収益率の推移

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）

	計算期間	収益率
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	0.6%
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	1.2%
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	3.1%
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	4.4%
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	3.9%
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	2.1%
第7特定期間	2020年 7月18日～2021年 1月18日	0.1%
第8特定期間	2021年 1月19日～2021年 7月19日	3.6%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

（４）設定及び解約の実績

野村外国債券（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）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	1,285,176,496		1,285,176,496
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	19,694,099,183	911,175,347	20,068,100,332
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	6,910,353,727	2,929,253,405	24,049,200,654
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	3,932,734,173	2,414,040,192	25,567,894,635
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	1,993,908,234	3,209,038,607	24,352,764,262
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	1,433,894,591	3,962,465,305	21,824,193,548
第7特定期間	2020年 7月18日～2021年 1月18日	1,061,029,659	3,097,166,337	19,788,056,870
第8特定期間	2021年 1月19日～2021年 7月19日	2,019,584,964	2,789,006,727	19,018,635,107

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

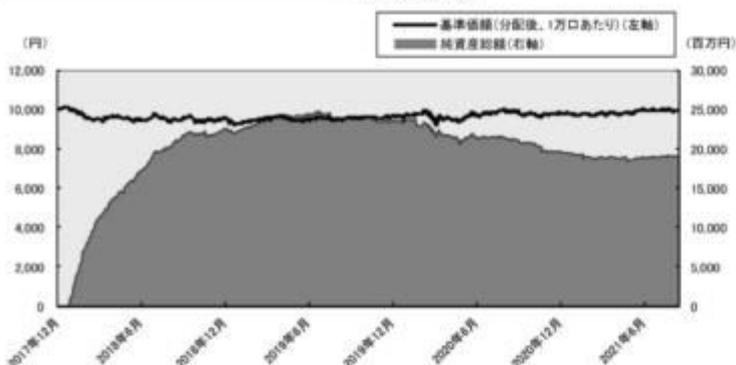
参考情報

< 更新後 >

運用実績 (2021年8月31日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次:設定来)



分配の推移

(1万円あたり、課税前)

2021年8月	21 円
2021年7月	21 円
2021年6月	21 円
2021年5月	21 円
2021年4月	21 円
直近1年間累計	258 円
設定来累計	978 円

主要な資産の状況

銘柄別投資比率

銘柄	投資比率 (%)
外国債券マザーファンド	84.7
新興国債券マザーファンド	15.2

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

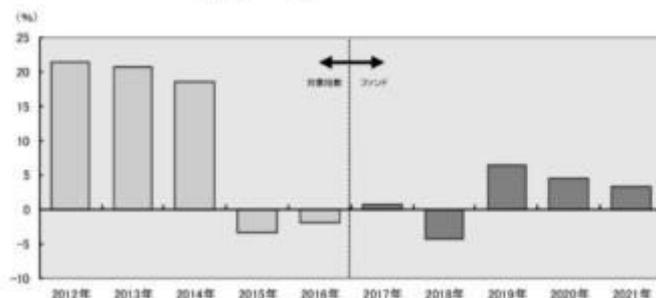
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	2.2
2	US TREASURY BOND	国債証券	1.2
3	US TREASURY BOND	国債証券	1.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	1.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	1.0
6	US TREASURY BOND	国債証券	0.9
7	US TREASURY N/B	国債証券	0.9
8	US TREASURY N/B	国債証券	0.8
9	US TREASURY N/B	国債証券	0.8
10	US TREASURY N/B	国債証券	0.8

・「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 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.4
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.3
3	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.3
4	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.3
5	FED REPUBLIC OF BRAZIL	国債証券	0.2
6	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.2
7	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.2
8	REPUBLIC OF TURKEY	国債証券	0.2
9	REPUBLIC OF INDONESIA	国債証券	0.2
10	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.2

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2012年から2016年は対象指数(合成指数)の年間収益率。
- ・2017年は設定日(2017年12月15日)から年末までのファンドの収益率。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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

第3【ファンドの経理状況】

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

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2021年1月19日から2021年7月19日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

野村外国債券（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) 貸借対照表

(単位：円)		
	前期 (2021年 1月18日現在)	当期 (2021年 7月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,253,787	61,484,007
親投資信託受益証券	19,152,055,287	18,831,276,676
未収入金	62,988,802	44,534,858
流動資産合計	19,253,297,876	18,937,295,541
資産合計	19,253,297,876	18,937,295,541
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	41,554,919	39,939,133
未払解約金	46,052,514	52,950,265
未払受託者報酬	559,725	546,077
未払委託者報酬	5,037,517	4,914,690
未払利息	25	56
その他未払費用	37,305	36,395
流動負債合計	93,242,005	98,386,616
負債合計	93,242,005	98,386,616
純資産の部		
元本等		
元本	19,788,056,870	19,018,635,107
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	628,000,999	179,726,182
（分配準備積立金）	693,076,518	706,179,956
元本等合計	19,160,055,871	18,838,908,925
純資産合計	19,160,055,871	18,838,908,925
負債純資産合計	19,253,297,876	18,937,295,541

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)		
	前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
営業収益		
有価証券売買等損益	50,274,944	699,107,016
営業収益合計	50,274,944	699,107,016

	前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
営業費用		
支払利息	7,485	5,134
受託者報酬	3,403,949	3,102,140
委託者報酬	30,635,484	27,919,182
その他費用	226,866	206,747
営業費用合計	34,273,784	31,233,203
営業利益又は営業損失（ ）	16,001,160	667,873,813
経常利益又は経常損失（ ）	16,001,160	667,873,813
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,001,160	667,873,813
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	7,006,028	11,872,801
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	419,233,405	628,000,999
剰余金増加額又は欠損金減少額	68,850,009	69,465,048
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	68,850,009	69,465,048
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,578,821	36,265,372
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,578,821	36,265,372
分配金	279,045,970	240,925,871
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	628,000,999	179,726,182

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2021年 1月19日から2021年 7月19日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2021年 1月18日現在	当期 2021年 7月19日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 19,788,056,870口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 19,018,635,107口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 628,000,999円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 179,726,182円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9683円	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9905円

(10,000口当たり純資産額)

(9,683円)

(10,000口当たり純資産額)

(9,905円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日			当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
2020年 7月18日から2020年 8月17日まで			2021年 1月19日から2021年 2月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	51,890,837円	費用控除後の配当等収益額	A	44,594,640円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	233,251,602円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	174,615,699円	収益調整金額	C	204,293,930円
分配準備積立金額	D	533,150,649円	分配準備積立金額	D	662,841,715円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	992,908,787円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	911,730,285円
当ファンドの期末残存口数	F	21,519,554,020口	当ファンドの期末残存口数	F	19,387,906,069口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	461円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	470円
10,000口当たり分配金額	H	24円	10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	51,646,929円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	40,714,602円
2020年 8月18日から2020年 9月17日まで			2021年 2月18日から2021年 3月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	64,777,220円	費用控除後の配当等収益額	A	41,000,748円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	178,112,585円	収益調整金額	C	209,935,424円
分配準備積立金額	D	753,107,256円	分配準備積立金額	D	656,285,275円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	995,997,061円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	907,221,447円
当ファンドの期末残存口数	F	21,265,967,551口	当ファンドの期末残存口数	F	19,252,895,710口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	468円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	471円
10,000口当たり分配金額	H	24円	10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	51,038,322円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	40,431,080円
2020年 9月18日から2020年10月19日まで			2021年 3月18日から2021年 4月19日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	47,117,527円	費用控除後の配当等収益額	A	46,426,933円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	181,181,205円	収益調整金額	C	217,733,109円
分配準備積立金額	D	755,762,972円	分配準備積立金額	D	648,015,437円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	984,061,704円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	912,175,479円
当ファンドの期末残存口数	F	21,069,194,018口	当ファンドの期末残存口数	F	19,209,724,261口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	467円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	474円
10,000口当たり分配金額	H	24円	10,000口当たり分配金額	H	21円

収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	50,566,065円
---------	-----------------------	-------------

2020年10月20日から2020年11月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	42,120,807円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	181,421,844円
分配準備積立金額	D	714,776,403円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	938,319,054円
当ファンドの期末残存口数	F	20,186,142,823口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	464円
10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	42,390,899円

2020年11月18日から2020年12月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	45,615,805円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	185,506,617円
分配準備積立金額	D	699,879,806円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	931,002,228円
当ファンドの期末残存口数	F	19,928,017,417口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	467円
10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	41,848,836円

2020年12月18日から2021年 1月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	41,335,207円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	190,368,311円
分配準備積立金額	D	693,296,230円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	924,999,748円
当ファンドの期末残存口数	F	19,788,056,870口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	467円
10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	41,554,919円

収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	40,340,420円
---------	-----------------------	-------------

2021年 4月20日から2021年 5月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	44,122,837円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	232,446,233円
分配準備積立金額	D	628,092,348円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	904,661,418円
当ファンドの期末残存口数	F	18,928,456,180口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	477円
10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	39,749,757円

2021年 5月18日から2021年 6月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	47,718,468円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	81,370,852円
収益調整金額	C	242,873,618円
分配準備積立金額	D	623,460,940円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	995,423,878円
当ファンドの期末残存口数	F	18,928,990,465口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	525円
10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	39,750,879円

2021年 6月18日から2021年 7月19日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	41,351,716円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	256,357,598円
分配準備積立金額	D	704,767,373円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,002,476,687円
当ファンドの期末残存口数	F	19,018,635,107口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	527円
10,000口当たり分配金額	H	21円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	39,939,133円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">前期</p> <p style="text-align: center;">自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日</p>	<p style="text-align: center;">当期</p> <p style="text-align: center;">自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 2em;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 2em;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 2em;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">前期</p> <p style="text-align: center;">2021年 1月18日現在</p>	<p style="text-align: center;">当期</p> <p style="text-align: center;">2021年 7月19日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
期首元本額 21,824,193,548円	期首元本額 19,788,056,870円
期中追加設定元本額 1,061,029,659円	期中追加設定元本額 2,019,584,964円
期中一部解約元本額 3,097,166,337円	期中一部解約元本額 2,789,006,727円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	116,572,850	65,514,721
合計	116,572,850	65,514,721

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年7月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年7月19日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	日本円	外国債券マザーファンド	6,291,197,331	16,002,289,531	
		新興国債券マザーファンド	1,349,256,997	2,828,987,145	
	小計	銘柄数：2	7,640,454,328	18,831,276,676	
		組入時価比率：100.0%		100.0%	
合計				18,831,276,676	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「外国債券マザーファンド」および「新興国債券マザーファンド」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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 7月19日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	375,852,761
コール・ローン	475,840,574
国債証券	591,623,702,632
派生商品評価勘定	465,027
未収入金	142,314,714
未収利息	5,270,827,998
前払費用	332,231,293
その他未収収益	7,305,061
流動資産合計	598,228,540,060
資産合計	
598,228,540,060	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,819
前受収益	45,088
未払金	199,626,362
未払解約金	611,800,092
未払利息	436
その他未払費用	3,480,381
流動負債合計	815,023,178
負債合計	
815,023,178	
純資産の部	
元本等	
元本	234,869,473,660
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	362,544,043,222
元本等合計	597,413,516,882
純資産合計	
597,413,516,882	
負債純資産合計	
598,228,540,060	

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	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
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	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 7月19日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.5436円
(10,000口当たり純資産額)	(25,436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	200,484,160,108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	210,851,949,041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)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日	
1. 金融商品に対する取組方針	

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(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、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 7月19日現在	
期首	2021年 1月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	235,370,900,307円
同期中における追加設定元本額	20,035,745,956円
同期中における一部解約元本額	20,537,172,603円
期末元本額	234,869,473,660円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	83,487,503円
バランスセレクト50	83,894,400円
バランスセレクト70	79,199,142円

野村外国債券インデックスファンド	278,387,839円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,670,582,927円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,685,442,545円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,745,838,944円
野村資産設計ファンド2015	19,826,795円
野村資産設計ファンド2020	19,863,325円
野村資産設計ファンド2025	35,205,732円
野村資産設計ファンド2030	39,081,581円
野村資産設計ファンド2035	29,214,619円
野村資産設計ファンド2040	50,276,686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）	73,932,603,863円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	5,816,992,176円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	15,594,023,907円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	3,708,009,708円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	520,093,959円
野村資産設計ファンド2045	7,390,117円
野村インデックスファンド・外国債券	889,569,832円
マイ・ロード	9,016,794,612円
ネクストコア	238,859,565円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	210,069,565円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	8,496,212,143円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,314,722,841円
野村資産設計ファンド2050	8,164,231円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,764,979円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,082,938円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,422,657円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,069,694円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	636,752,652円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	561,137,940円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,054,103円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,551,320円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,226,037円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,374,521円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,861,434円
野村6資産均等バランス	1,682,069,227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）	6,291,197,331円
世界6資産分散ファンド	62,431,917円
野村資産設計ファンド2060	2,846,940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	6,259,628,451円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	3,294,270,053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）	6,367,795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）	1,191,591,337円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	190,808,689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）	1,380,426,999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）	1,001,230,348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）	2,383,073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）	8,021,803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)	476,381円
野村インデックス・バランス60V A(適格機関投資家専用)	3,193,733,140円
野村ワールド・インデックス・バランス35V A(適格機関投資家専用)	9,860,649円
野村ワールド・インデックス・バランス50V A(適格機関投資家専用)	53,150,604円
野村世界インデックス・バランス40V A(適格機関投資家専用)	13,817,588円
野村グローバル・インデックス・バランス25V A(適格機関投資家専用)	175,821,495円
野村グローバル・インデックス・バランス50V A(適格機関投資家専用)	163,112,066円
野村グローバル・インデックス・バランス75V A(適格機関投資家専用)	1,952,485,048円
野村世界バランス25V A(適格機関投資家専用)	90,545,863円
ノムラ外国債券インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	1,347,975,474円
ノムラF O F s用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,103,112,908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)	5,817,165円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,456,317円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,211,845円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,858,864円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	562,145,019円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,394,381,253円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,501,088,868円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,945,180,098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)	18,672,497,419円
マイバランスD C 30	1,915,760,620円
マイバランスD C 50	1,430,353,503円
マイバランスD C 70	966,131,878円
野村D C外国債券インデックスファンド	7,398,080,433円
野村D C運用戦略ファンド	4,963,890,879円
野村D C運用戦略ファンド(マイルド)	629,288,892円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	229,191,386円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	384,302,521円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	185,005,003円
野村世界6資産分散投信(D C)安定コース	15,679,531円
野村世界6資産分散投信(D C)インカムコース	35,660,079円
野村世界6資産分散投信(D C)成長コース	16,585,437円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2030	7,994,675円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040	5,605,827円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050	3,042,787円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	110,236,665円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	72,141,258円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	39,144,898円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	50,182,827円
野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2060	1,400,789円
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	8,199,643円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	30,485,270円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年7月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年7月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	38,800,000.00	43,627,263.20	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	47,767,241.06	
		US TREASURY BOND	65,000,000.00	80,498,437.50	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	19,758,984.00	
		US TREASURY BOND	48,600,000.00	63,354,653.82	
		US TREASURY BOND	48,000,000.00	62,133,748.80	
		US TREASURY BOND	28,200,000.00	36,660,000.00	
		US TREASURY BOND	100,000.00	140,335.93	
		US TREASURY BOND	500,000.00	588,574.20	
		US TREASURY BOND	200,000.00	268,523.42	
		US TREASURY N/B	21,700,000.00	22,117,894.26	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,574.21	
		US TREASURY N/B	200,000.00	203,304.68	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,964.84	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,018,437.50	
		US TREASURY N/B	900,000.00	914,871.06	
		US TREASURY N/B	400,000.00	405,953.12	
		US TREASURY N/B	43,500,000.00	44,347,906.35	
		US TREASURY N/B	8,200,000.00	8,335,812.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,605.46	
		US TREASURY N/B	900,000.00	917,789.04	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,634,124.96	
		US TREASURY N/B	600,000.00	609,375.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	102,226.56	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,536,035.10			
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,238,393.91			
US TREASURY N/B	100,000.00	102,515.62			

US TREASURY N/B	400,000.00	408,343.72	
US TREASURY N/B	24,100,000.00	24,794,757.21	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,632,312.48	
US TREASURY N/B	50,900,000.00	52,152,613.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,406.25	
US TREASURY N/B	400,000.00	411,437.48	
US TREASURY N/B	500,000.00	509,570.30	
US TREASURY N/B	66,000,000.00	67,410,228.60	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,612,502.34	
US TREASURY N/B	500,000.00	502,812.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	408,921.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,941.40	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,376,171.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	417,968.72	
US TREASURY N/B	37,200,000.00	38,236,075.80	
US TREASURY N/B	21,200,000.00	21,764,780.72	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,370,250.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	818,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,664.06	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,389,023.33	
US TREASURY N/B	37,100,000.00	38,999,924.39	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,802,909.75	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,159,300.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,052,617.10	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,051,121.92	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,057,265.60	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,923,382.68	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,058,828.10	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	45,036,187.50	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,594,952.32	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	31,072,878.54	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	45,044,177.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	844,937.44	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,507,944.99	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,480,468.75	

US TREASURY N/B	800,000.00	849,874.96	
US TREASURY N/B	500,000.00	523,398.40	
US TREASURY N/B	400,000.00	421,046.84	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,779,820.27	
US TREASURY N/B	500,000.00	522,617.15	
US TREASURY N/B	700,000.00	736,421.84	
US TREASURY N/B	46,600,000.00	49,372,331.86	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,299,859.32	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,523,464.18	
US TREASURY N/B	500,000.00	519,472.65	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,994,601.42	
US TREASURY N/B	500,000.00	520,039.05	
US TREASURY N/B	300,000.00	313,136.70	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,127,199.15	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	44,960,093.92	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,135,878.81	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,538,281.04	
US TREASURY N/B	500,000.00	516,523.40	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	36,179,858.52	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,424,792.94	
US TREASURY N/B	500,000.00	516,621.05	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,012,738.21	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,265.62	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,069,062.50	
US TREASURY N/B	18,100,000.00	19,030,452.22	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,049,699.10	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	17,649,378.69	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	35,169,105.06	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	37,474,276.05	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,515,390.62	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,087,226.50	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,441,452.92	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,663,937.24	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	29,004,978.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	760,210.92	

US TREASURY N/B	29,200,000.00	32,026,466.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,816.40	
US TREASURY N/B	50,600,000.00	53,983,875.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,939,843.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,844,531.00	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	19,207,956.81	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,081,015.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,080,351.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,349,609.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	200,078.12	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	45,520,417.44	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,873,898.28	
US TREASURY N/B	300,000.00	319,535.13	
US TREASURY N/B	800,000.00	842,874.96	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,588,406.16	
US TREASURY N/B	29,000,000.00	30,003,669.70	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,345,000.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,413,281.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,833,405.76	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,164,702.41	
US TREASURY N/B	31,400,000.00	32,695,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,812.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,914.06	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,149,265.06	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,419,796.84	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,614,842.90	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	41,176,560.60	
US TREASURY N/B	700,000.00	682,964.80	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,366,433.05	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,070.29	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,077,812.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,132.79	
US TREASURY N/B	500,000.00	488,105.45	
US TREASURY N/B	500,000.00	491,699.20	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	28,327,909.20	

US TREASURY N/B	100,000.00	100,675.78	
US TREASURY N/B	500,000.00	506,796.85	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,324.21	
US TREASURY N/B	55,600,000.00	62,311,092.36	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	11,114,683.47	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,370,437.44	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,218,937.50	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,200,589.83	
US TREASURY N/B	300,000.00	310,546.86	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,194,745.91	
US TREASURY N/B	600,000.00	579,000.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,738,781.25	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	18,512,812.50	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	15,746,655.42	
US TREASURY N/B	97,400,000.00	133,864,125.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	985,468.70	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,019.53	
US TREASURY N/B	20,400,000.00	28,488,279.72	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	9,198,765.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,496.09	
US TREASURY N/B	100,000.00	127,757.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	139,632.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,867.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,031.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	146,406.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,617.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,226.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,789.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	448,968.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,398.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	132,781.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,921.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	122,054.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,796.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	230,609.36	

US TREASURY N/B	100,000.00	115,265.62	
US TREASURY N/B	290,000.00	354,706.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,679.68	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	6,347,437.44	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	19,400,779.92	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	30,730,467.50	
US TREASURY N/B	35,100,000.00	42,331,147.56	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	44,290,556.10	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	28,295,717.58	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	20,758,006.50	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,486,538.97	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	57,299,780.65	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	31,383,514.92	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	36,681,852.45	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	16,924,625.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,439,140.60	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,075,328.04	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	13,327,757.10	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	10,873,733.91	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	11,631,562.50	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	6,388,746.03	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	12,882,597.00	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	8,000,054.23	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,038,196.33	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,390.62	
US TREASURY N/B	11,250,000.00	12,004,979.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	328,792.95	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,012,070.30	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,857,195.12	
US TREASURY N/B	9,100,000.00	7,929,085.71	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,397,323.96	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	14,963,687.12	
US TREASURY N/B	12,300,000.00	13,540,089.69	
小計	銘柄数：200	2,207,060,000.00	2,455,293,934.70 (269,787,697,544)

	組入時価比率：45.2%		45.6%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	299,976.60
	CANADIAN GOVERNMENT	12,000,000.00	12,099,552.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,328,821.00
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,548,263.40
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,134,801.80
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	521,715.50
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,638,060.40
	CANADIAN GOVERNMENT	26,900,000.00	27,407,791.30
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,914,896.00
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	340,173.40
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	308,881.80
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,403,738.00
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,378,499.20
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	200,351.80
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	850,545.60
	CANADIAN GOVERNMENT	11,380,000.00	15,340,592.78
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,086,160.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	611,578.20
	CANADIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	15,022,488.60
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	3,866,790.20
	CANADIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	5,742,132.00
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	13,475,185.50
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,582,263.80
CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,265,344.70	
CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	127,440.40	
小計	銘柄数：25	112,540,000.00	132,496,043.98 (11,521,855,984)
	組入時価比率：1.9%		1.9%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,300,000.00	17,611,400.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	93,500,000.00	98,306,835.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	72,421,115.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,300,000.00	64,371,989.37
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,300,000.00	56,467,808.04
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	85,120,433.27
			68,100,000.00

	MEX BONOS DESARR FIX RT		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	423,876.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,300,000.00	52,184,445.67
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	28,561,159.86
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	70,286,688.12
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	45,335,889.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	107,700,000.00	112,698,540.09
小計	銘柄数：13	728,200,000.00	775,891,735.42 (4,275,861,764)
	組入時価比率：0.7%		0.7%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	635,640.00
	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	4,017,617.64
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,938,760.00
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,388,400.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,038,647.30
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,796,237.00
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	8,330,692.90
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,555,676.41
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,153,330.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,083,551.00
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,116,460.00
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	7,786,590.00
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	2,447,564.12
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	114,730.00
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	591,517.50
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	125,974.90
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	5,338,448.00
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	6,852,429.20
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,374,134.00
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,393,645.93
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,932,952.84
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,473,326.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,195,841.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	17,510,125.50
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,454,000.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,500,000.00	16,923,830.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,275,175.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	8,128,922.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	17,716,171.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,728,690.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	498,106.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	969,831.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,300,000.00	16,049,362.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,551,450.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,439,940.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	29,466,169.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,600,000.00	8,363,040.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,200,803.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,507,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,500,000.00	15,829,750.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,318,384.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,566,400.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,162,321.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	3,252,450.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	7,940,270.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	18,509,498.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,449,779.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	14,206,353.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	6,722,717.40	
BUNDES OblIGATION	250,000.00	252,155.00	
BUNDES OblIGATION	500,000.00	506,275.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,047,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	409,456.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	307,539.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	403,638.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	2,913,624.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,727,705.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	25,600,000.00	30,055,936.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,810,398.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,000,000.00	12,769,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	8,117,417.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,821,203.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,748,102.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	21,538,524.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,034,410.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	735,399.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	29,029,016.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	213,774.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	25,759,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	643,806.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	11,328,710.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	29,615,292.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	13,288,884.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000.00	18,399,510.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	17,762,256.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	6,840,699.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000.00	3,097,195.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,921,406.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,161,332.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	18,724,488.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,700,000.00	25,769,767.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	913,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	405,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,240,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,533,444.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	26,660,000.00	28,694,158.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,820,608.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,804,434.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,243.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	6,638,196.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,060,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	22,699,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,100,000.00	19,252,890.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	318,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	635,220.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	7,423,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,959,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,091,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,900,000.00	24,825,145.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	847,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,190,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	431,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,500,000.00	8,337,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,271,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,800,000.00	15,482,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,204,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,800,000.00	25,947,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	223,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	222,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	23,000,000.00	31,990,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	222,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	15,975,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	41,587,910.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,094,055.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,350,000.00	24,696,675.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	546,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,811,070.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,650,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	21,500,000.00	32,093,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,200,000.00	17,094,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,782,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	629,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,994,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	257,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,200,000.00	18,113,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	14,382,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,388,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,896,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	11,651,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	10,131,660.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,654,681.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	102,657.12	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,840.30	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	406,052.80	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	752,220.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,274,100.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,285.30	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,105,604.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,051,693.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,561,330.40	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	873,813.60	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	228,443.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,998,112.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	597,537.20	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	379,274.40	
FRANCE (GOVT OF)	4,200,000.00	4,244,310.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,628,756.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,640,712.80	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,760.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	10,946,470.90	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,840,305.60	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	13,557,102.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,891,391.40	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,835,551.10	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,685,280.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	7,430,899.80	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,519,184.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,120,428.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	11,658,903.66	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,519,331.79	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	114,410.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	124,391.50	
FRANCE (GOVT OF)	10,400,000.00	13,861,172.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,415,400.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	499,069.50	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,298,032.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,100,000.00	12,911,142.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,600,000.00	28,488,960.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,242,355.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	12,214,425.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,415,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,800,000.00	40,402,830.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,408,325.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	39,342,712.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,000,000.00	15,040,376.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000.00	33,728,074.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,800,000.00	35,534,915.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	486,138.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	8,871,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,550,000.00	40,992,573.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,250,000.00	12,273,920.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	21,209,933.04	
IRISH GOVERNMENT	4,630,000.00	5,648,854.65	
IRISH GOVERNMENT	6,500,000.00	7,048,775.50	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	662,453.40	
IRISH TSY 1.3% 2033	3,900,000.00	4,454,993.40	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,278,432.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	3,141,054.80	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,758,136.20	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,937,525.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	6,000,000.00	7,363,362.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	2,115,568.00	
IRISH TSY 2022	2,200,000.00	2,217,316.20	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,755,414.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	103,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	213,504.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	3,934,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	419,720.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	101,840.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,700,000.00	8,332,293.20	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,555,428.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,007,065.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,698,140.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,184,330.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,087,050.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	2,522,160.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	8,900,000.00	11,693,832.82	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,036,827.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	541,755.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,100,000.00	7,196,828.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,900,000.00	11,479,467.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,433,788.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	100,816.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	211,010.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	912,069.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	158,358.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,325,675.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	753,755.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,402,077.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,792,660.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,136,610.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,722,840.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,600,000.00	10,194,240.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,916,008.04	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	649,920.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	7,183,305.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	7,083,440.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,149,122.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	2,055,841.80	
	REPUBLIC OF IRELAND	9,850,000.00	10,596,728.50	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,273,424.00	
	SPANISH GOVERNMENT	28,200,000.00	44,671,620.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,900,000.00	8,967,256.60	
小計	銘柄数：234	1,405,560,000.00	1,836,169,829.95 (238,132,865,246)	

	組入時価比率：39.9%		40.3%
英ポンド	UK TREASURY	2,100,000.00	2,100,273.00
	UK TREASURY	17,500,000.00	17,724,735.00
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,404,765.00
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,636,400.00
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,042,409.10
	UK TREASURY	14,920,000.00	17,488,472.03
	UK TREASURY	200,000.00	202,890.04
	UK TREASURY	200,000.00	214,260.80
	UK TREASURY	1,910,000.00	2,019,696.64
	UK TREASURY	400,000.00	419,840.00
	UK TREASURY	8,680,000.00	10,765,260.63
	UK TREASURY	200,000.00	216,289.60
	UK TREASURY	4,800,000.00	6,706,819.20
	UK TREASURY	8,900,000.00	12,238,030.44
	UK TREASURY	7,800,000.00	10,659,901.20
	UK TREASURY	12,300,000.00	17,888,952.72
	UK TREASURY	2,450,000.00	3,571,068.55
	UK TREASURY	100,000.00	160,369.60
	UK TREASURY	600,000.00	922,104.00
	UK TREASURY	500,000.00	781,956.20
	UK TREASURY	470,000.00	778,066.20
	UK TREASURY	18,440,000.00	27,593,800.40
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,991,296.00
	UK TREASURY	8,200,000.00	8,907,222.94
	UK TREASURY	16,100,000.00	18,529,122.92
	UK TREASURY	5,350,000.00	9,458,158.00
	UK TREASURY	6,750,000.00	11,445,907.50
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,489,670.00
	UK TREASURY	700,000.00	842,086.00
	UK TREASURY	1,950,000.00	3,776,958.90
	UK TREASURY	100,000.00	152,425.00
	UK TREASURY	200,000.00	386,446.00
UK TSY 3 1/4% 2044	21,800,000.00	31,143,480.00	
UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,200,000.00	11,839,706.00	

小計	銘柄数：34 組入時価比率：6.4%	188,370,000.00	252,498,839.61 (38,160,149,630) 6.5%
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,233,318.38
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	40,144,940.00
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,729,840.00
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,670,676.80
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	19,948,005.00
	SWEDISH GOVERNMENT	6,100,000.00	6,067,457.11
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	32,022,294.33
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	119,350,000.00	136,816,531.62 (1,732,097,290) 0.3%
ノルウェークロ ーネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,431,368.45
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	39,952,710.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,862,000.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,825,563.02
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,938,880.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,931,570.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	22,953,920.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,493,240.00
小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	109,700,000.00	114,389,251.47 (1,414,995,040) 0.2%
デンマーククロ ーネ	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	403,760.00
	KINGDOM OF DENMARK	20,870,000.00	21,846,716.00
	KINGDOM OF DENMARK	29,300,000.00	32,150,890.00
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,530,530.00
	KINGDOM OF DENMARK	28,450,000.00	30,182,605.00
	KINGDOM OF DENMARK	36,500,000.00	65,508,535.60
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	131,220,000.00	166,623,036.60 (2,905,905,758) 0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	49,800,000.00	51,544,842.60
	POLAND GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	34,668,984.90
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	799,354.16

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,831,530.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	34,800,000.00	38,088,600.00	
	銘柄数：5	121,000,000.00	127,933,311.66	(3,618,376,233)
	組入時価比率：0.6%			0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,020,000.00	3,191,022.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	82,383.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,650,000.00	3,999,414.13	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,476,635.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	10,401,784.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,976,030.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,400,000.00	15,204,539.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,459,739.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,237,835.06	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	9,094,300.02	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,044,960.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	24,729,456.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,590,760.07	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,331,198.57	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,354,302.82	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	11,419,251.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,498,378.31	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	10,649,335.95	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	853,090.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,711,883.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	5,826,100.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,770,800.00		
小計	銘柄数：22	129,480,000.00	148,903,200.87	(12,061,159,270)
	組入時価比率：2.0%			2.0%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,700,000.00	2,783,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	510,577.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,100,000.00	4,287,780.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,505,825.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,472,960.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,171,610.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,483,405.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,429,230.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	547,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	335,850.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,850,000.00	3,209,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,429,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	2,049,715.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,168,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,169,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,016,155.00	
小計	銘柄数：16	28,970,000.00	31,569,757.70	
			(2,553,993,397)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	421,151.24	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,822,335.62	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,702,155.14	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	433,760.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	508,897.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	512,139.85	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,847,870.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,023,895.59	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,279,232.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,114,557.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	634,131.06	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	16,815,683.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,860,617.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,244,669.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,304,779.18	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	295,175.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	16,887,727.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,784,361.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	810,850.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,421,822.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,668,677.89	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,356,916.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	325,969.95	

小計	銘柄数：23 組入時価比率：0.5%	100,780,000.00	107,077,377.78 (2,794,130,634) 0.5%	
新シケル	ISRAEL FIXED BOND	9,800,000.00	9,873,955.70	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,082,945.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,356,709.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,163,034.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	6,472,881.74	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,312,308.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,456,415.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,397,613.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,490,000.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,500,000.00	5,460,599.65	
	ISRAEL FIXED BOND	1,700,000.00	1,625,091.71	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	9,580,105.20	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,496,243.00	
小計	銘柄数：13 組入時価比率：0.4%	70,400,000.00	79,767,901.50 (2,664,614,842) 0.5%	
合計			591,623,702,632 (591,623,702,632)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2021年 7月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	12,920,000	
		US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	3,775,000	
		US TREASURY N/B	15,000,000	
		US TREASURY N/B	14,000,000	
		US TREASURY BOND	425,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	7,586,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	

US TREASURY N/B	21,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	16,300,000
US TREASURY BOND	5,000,000
US TREASURY BOND	18,000,000
US TREASURY BOND	40,000,000
US TREASURY N/B	18,600,000
US TREASURY N/B	15,000,000
US TREASURY N/B	12,000,000
US TREASURY N/B	22,000,000
US TREASURY BOND	40,000,000
US TREASURY BOND	50,000,000
US TREASURY BOND	12,000,000
US TREASURY BOND	32,000,000
US TREASURY N/B	850,000
US TREASURY N/B	14,705,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	10,200,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	10,000,000
US TREASURY N/B	45,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	250,000
US TREASURY N/B	75,000
US TREASURY N/B	25,000,000
US TREASURY N/B	31,000,000
US TREASURY N/B	1,785,000
US TREASURY N/B	40,000,000
US TREASURY N/B	27,000,000
US TREASURY N/B	255,000
US TREASURY N/B	950,000
US TREASURY N/B	22,000,000
US TREASURY N/B	15,000,000
US TREASURY N/B	11,050,000
US TREASURY N/B	7,000,000
US TREASURY N/B	85,000
US TREASURY N/B	1,870,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	15,045,000
US TREASURY N/B	36,000,000
US TREASURY N/B	1,020,000
US TREASURY N/B	9,000,000
US TREASURY N/B	7,395,000
US TREASURY N/B	9,605,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	3,341,000
US TREASURY N/B	39,000,000
US TREASURY N/B	35,000,000
US TREASURY N/B	1,550,000

	US TREASURY BOND	335,000
	US TREASURY BOND	30,618,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	340,000
	US TREASURY N/B	25,000,000
	US TREASURY N/B	1,339,000
	US TREASURY N/B	17,000,000
	US TREASURY N/B	765,000
	US TREASURY N/B	19,000,000
	US TREASURY N/B	1,105,000
	US TREASURY N/B	1,700,000
	US TREASURY N/B	155,000
	US TREASURY N/B	3,000,000
	US TREASURY N/B	12,750,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	680,000
	US TREASURY N/B	20,000,000
	US TREASURY N/B	210,000
	US TREASURY N/B	36,000,000
	US TREASURY N/B	30,000,000
	US TREASURY N/B	7,735,000
	US TREASURY N/B	8,415,000
	US TREASURY N/B	10,000,000
	US TREASURY N/B	23,000,000
	US TREASURY N/B	2,000,000
	US TREASURY N/B	27,000,000
	US TREASURY N/B	24,000,000
	US TREASURY N/B	850,000
	US TREASURY N/B	16,000,000
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000
メキシコペソ	MEXICAN FIXED RATE BONDS	500,000
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	200,000
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000
	ISRAEL FIXED BOND	2,250,000
	ISRAEL FIXED BOND	4,250,000
	ISRAEL FIXED BOND	5,100,000
	ISRAEL FIXED BOND	4,225,000
	ISRAEL FIXED BOND	1,300,000
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,218,708
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	360,000

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,020,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000	
	FRANCE (GOVT OF)	1,530,000	
	FRANCE (GOVT OF)	7,000,000	
	BELGIUM KINGDOM	3,800,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,925,000	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 7月19日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	27,118,365	-	27,060,859	57,506
米ドル	16,468,537	-	16,481,850	13,313
英ポンド	10,649,828	-	10,579,009	70,819
売建	217,245,259	-	216,793,545	451,714
米ドル	109,995,000	-	109,879,000	116,000
ユーロ	75,332,140	-	75,220,780	111,360
英ポンド	15,206,200	-	15,112,870	93,330
スウェーデンクローナ	4,445,969	-	4,430,895	15,074
豪ドル	12,265,950	-	12,150,000	115,950
合計	-	-	-	394,208

(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。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 7月19日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	230,655,346
コール・ローン	124,061,135
国債証券	24,802,457,463
派生商品評価勘定	19,688
未収利息	282,604,068
前払費用	25,216,712
流動資産合計	25,465,014,412
資産合計	
25,465,014,412	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	86,544
未払金	248,239,358
未払解約金	6,368,803
未払利息	113
その他未払費用	65,700
流動負債合計	254,760,518
負債合計	
254,760,518	
純資産の部	
元本等	
元本	12,023,887,870
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	13,186,366,024
元本等合計	25,210,253,894
純資産合計	
25,210,253,894	
負債純資産合計	
25,465,014,412	

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	<p>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。</p>
--------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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。 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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 7月19日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0967円
(10,000口当たり純資産額)	(20,967円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（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、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 7月19日現在	
期首	2021年 1月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	10,894,289,899円
同期中における追加設定元本額	2,778,818,624円
同期中における一部解約元本額	1,649,220,653円
期末元本額	12,023,887,870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	629,267,216円
ネクストコア	35,172,464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	895,191,083円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,073,092円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,038,603円
インデックス・ブレンド(タイプ)	14,337,329円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,815,680円
インデックス・ブレンド(タイプ)	12,609,697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)	853,357,294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)	1,349,256,997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	574,650,038円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	666,934,773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)	5,598,589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)	2,142,886円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	1,208,253,110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)	4,883,891,508円
野村DC運用戦略ファンド	726,178,274円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	79,794,858円
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	74,324,379円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年7月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年7月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	BRAZIL GLOBAL	650,000.00	811,694.00	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,485,352.60	
		BRAZIL GLOBAL	1,200,000.00	1,522,098.00	
		COLOMBIA GLOBAL	1,420,000.00	1,870,850.00	
		CROATIA	1,100,000.00	1,193,054.50	
		CROATIA	700,000.00	792,967.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000.00	2,471,256.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	300,000.00	350,599.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	2,061,908.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,607,460.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,700,000.00	1,715,538.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000.00	1,304,868.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000.00	1,821,447.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	3,400,000.00	3,709,689.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	700,000.00	679,819.00	
		HUNGARY	700,000.00	755,699.70	
		HUNGARY	1,250,000.00	1,402,165.00	
		HUNGARY	1,400,000.00	1,577,651.60	
		INDONESIA GLOBAL	900,000.00	1,016,310.15	
		MEXICO GLOBAL	1,080,000.00	1,453,755.60	
		PANAMA GLOBAL	700,000.00	871,507.00	
		PANAMA GLOBAL	1,550,000.00	2,137,922.75	
		PERU GLOBAL	1,070,000.00	1,497,245.65	
		PHILIPPINES GLOBAL	300,000.00	324,802.77	
		PHILIPPINES GLOBAL	1,750,000.00	2,771,378.05	
		PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	1,481,679.90	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	2,775,113.00	1,066,170.66	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	10,365,309.00	3,744,260.57	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	14,537,686.00	4,710,355.64	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	5,686,159.00	2,228,576.29	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,100,000.00	2,276,154.00			

REPUBLIC OF ARGENTINA	1,000,000.00	331,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,527,547.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,418,391.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	880,987.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,369,550.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,720,000.00	2,037,340.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000.00	1,924,383.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	2,659,375.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,094,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,040,600.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	800,000.00	1,332,678.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	631,039.44	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,439,430.46	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,175,251.29	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,249,556.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	446,330.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	658,651.26	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	340,939.02	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,411,875.12	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	435,126.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	313,444.83	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	896,831.92	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,550,000.00	2,377,450.14	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,527,337.32	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,847,518.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,010,018.56	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,900,000.00	2,664,639.42	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,737,253.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000.00	2,119,298.56	
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	760,557.00	
REPUBLIC OF PANAMA	1,300,000.00	1,442,798.50	
REPUBLIC OF PANAMA	1,600,000.00	1,685,600.00	
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	680,757.00	
REPUBLIC OF PANAMA	1,000,000.00	1,152,760.00	
REPUBLIC OF PANAMA	2,000,000.00	2,310,500.00	
REPUBLIC OF PERU	300,000.00	309,900.00	
REPUBLIC OF PERU	700,000.00	786,492.00	
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	519,830.00	
REPUBLIC OF PERU	2,600,000.00	2,680,600.00	
REPUBLIC OF PERU	1,500,000.00	2,127,750.00	
REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,016,961.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	546,228.95	
	800,000.00	969,153.04	

REPUBLIC OF PHILIPPINES			
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,362,960.12	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	1,774,862.73	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,419,938.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,014,325.92	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,236,270.75	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000.00	2,187,877.20	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	393,209.92	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	350,000.00	366,390.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,150,000.00	1,303,844.70	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	982,827.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,500,000.00	1,558,515.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	852,444.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,300,000.00	1,488,565.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	718,777.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	770,084.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,850,889.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,772,336.70	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	973,718.10	
REPUBLIC OF TURKEY	2,000,000.00	2,108,980.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,481,544.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,582,239.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,284,138.70	
REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000.00	2,373,731.10	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,078,947.10	
REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000.00	1,441,013.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000.00	2,987,001.90	
REPUBLIC OF TURKEY	1,000,000.00	962,555.00	
REPUBLIC OF TURKEY	800,000.00	794,891.20	
REPUBLIC OF TURKEY	1,150,000.00	1,143,824.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,103,145.60	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,780,240.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,600,000.00	2,510,003.60	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,912,262.00	
ROMANIA	400,000.00	440,443.60	
ROMANIA	1,600,000.00	1,665,376.00	
ROMANIA	800,000.00	1,101,718.40	
ROMANIA	600,000.00	746,262.00	
ROMANIA	1,000,000.00	1,064,860.00	
RUSSIA	787,500.00	907,195.27	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,029,038.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,175,254.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,594,355.00	

	RUSSIAN FEDERATION	3,000,000.00	3,362,445.00	
	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	2,040,300.00	
	RUSSIAN FEDERATION	2,800,000.00	3,367,000.00	
	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,601,380.00	
	RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,350,710.00	
	RUSSIAN FEDERATION	4,000,000.00	5,091,920.00	
	TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,562,224.50	
	TURKEY GLOBAL	3,200,000.00	3,482,169.60	
	UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	664,080.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000.00	2,396,230.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,481,200.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,700,000.00	1,781,227.70	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	755,220.90	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,313,010.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	200,000.00	219,398.80	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	771,330.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,583,088.00	
	UNITED MEXICAN STATES	206,000.00	223,614.03	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,321,620.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,359,492.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000.00	2,738,436.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,433,646.50	
	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000.00	2,514,875.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,360,658.00	
	UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	394,340.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,849,600.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,810,000.00	2,310,836.05	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,357,675.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,860,599.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,857,088.50	
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,629,540.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000.00	2,789,352.00	
小計	銘柄数：148	227,327,767.00	225,723,129.45	
			(24,802,457,463)	
	組入時価比率：98.4%		100.0%	
合計			24,802,457,463	
			(24,802,457,463)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建所有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年 7月19日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建	102,253,678	-	102,186,822	66,856
米ドル	102,253,678	-	102,186,822	66,856
合計	102,253,678	-	102,186,822	66,856

(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。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

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）

2021年8月31日現在

資産総額	19,164,503,686円
負債総額	14,034,492円
純資産総額（ - ）	19,150,469,194円
発行済口数	19,256,694,766口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9945円

(参考) 外国債券マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	611,899,003,057円
負債総額	1,709,732,246円
純資産総額（ - ）	610,189,270,811円
発行済口数	238,556,489,531口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5578円

（参考）新興国債券マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	26,883,755,902円
負債総額	71,672,151円
純資産総額（ - ）	26,812,083,751円
発行済口数	12,645,408,627口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1203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

2021年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

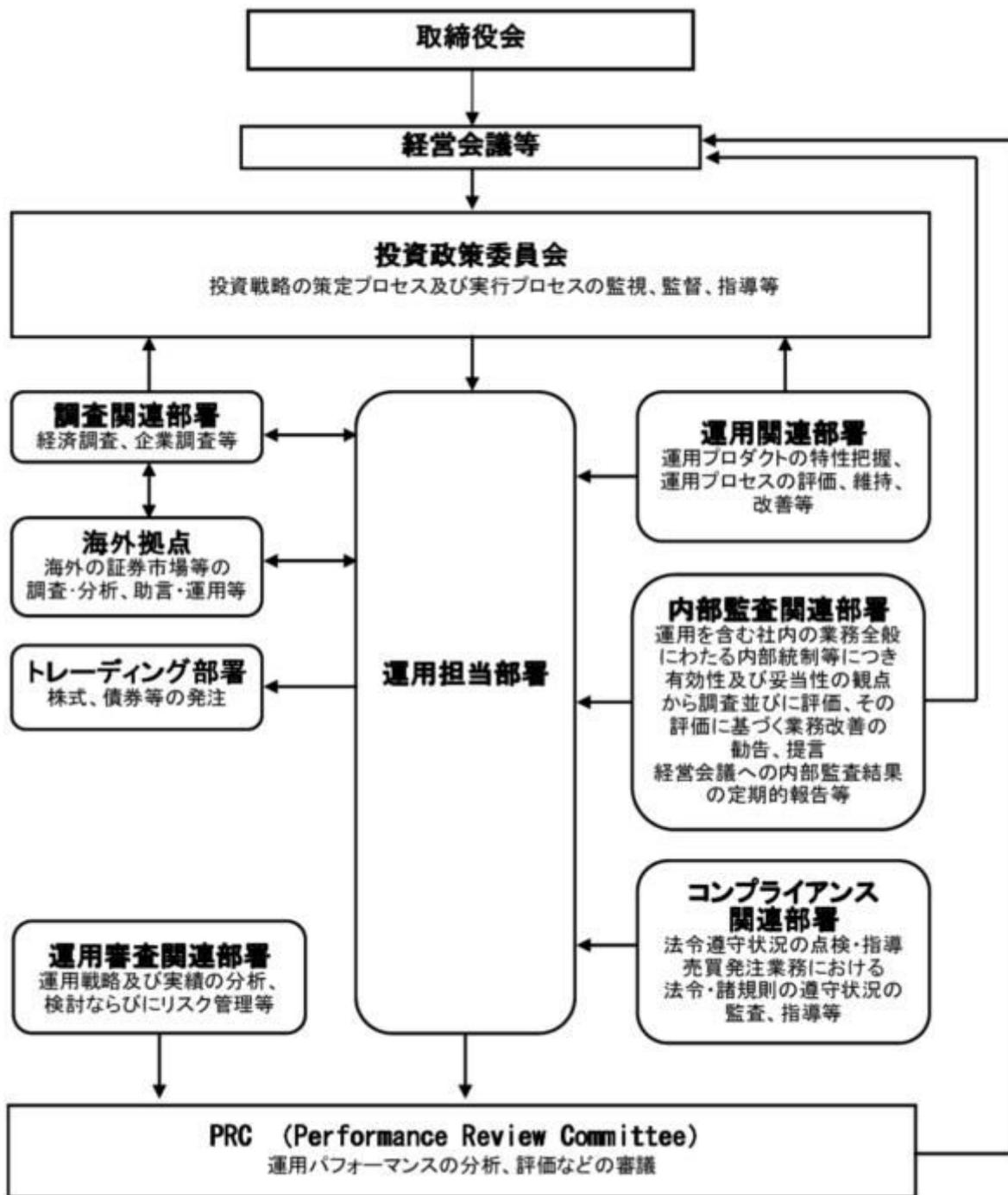
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

< 更新後 >

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

委託者の運用する証券投資信託は2021年7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	994	37,262,236
単位型株式投資信託	195	817,802
追加型公社債投資信託	14	6,310,987
単位型公社債投資信託	503	1,626,966
合計	1,706	46,017,992

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。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 貸借対照表

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

ソフトウェア		5,893		5,428	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,486		16,487
投資有価証券		1,437		1,767	
関係会社株式		10,171		9,942	
従業員長期貸付金		16		-	
長期差入保証金		329		330	
長期前払費用		19		15	
前払年金費用		1,545		1,301	
繰延税金資産		2,738		3,008	
その他		229		122	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			23,026		24,583
資産合計			120,536		125,080

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

評価・換算差額等		10	57
その他有価証券評価差額金		10	57
純資産合計		85,281	87,654
負債・純資産合計		120,536	125,080

(2) 損益計算書

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

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,936		4,540	
受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	
為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
経常利益			35,555		36,157
特別利益					
投資有価証券等売却益		21		71	
株式報酬受入益		59		48	
移転補償金		-		2,077	
特別利益計			81		2,197
特別損失					
投資有価証券等評価損		119		36	
関係会社株式評価損		1,591		582	
固定資産除却損	2	67		105	
事務所移転費用		-		406	
特別損失計			1,778		1,129
税引前当期純利益			33,858		37,225
法人税、住民税及び事業税			9,896		11,239
法人税等調整額			34		290
当期純利益			23,996		26,276

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									

剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>						
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	<p>(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 style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>						

<p>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。 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。</p>
---------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

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

<p>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</p> <p>2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 ア 合計 67</p>	<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円</p> <p>2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソフトウェア 102 ア 合計 105</p>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバ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、過年度に計上してありました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
其他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．其他有価証券(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其他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
<p>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。</p>
<p>2．確定給付制度</p>

(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	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企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	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2020年3月31日)	当事業年度末 (2021年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,235	賞与引当金 1,176
退職給付引当金 1,026	退職給付引当金 1,022
関係会社株式評価減 762	関係会社株式評価減 784
未払事業税 285	未払事業税 430
投資有価証券評価減 462	投資有価証券評価減 428
減価償却超過額 171	減価償却超過額 223
時効後支払損引当金 177	時効後支払損引当金 179
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 148
ゴルフ会員権評価減 167	ゴルフ会員権評価減 135
未払社会保険料 97	未払社会保険料 95
その他 219	その他 341
繰延税金資産小計 4,754	繰延税金資産小計 4,968
評価性引当額 1,532	評価性引当額 1,530
繰延税金資産合計 3,222	繰延税金資産合計 3,437
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 4	その他有価証券評価差額金 25
前払年金費用 478	前払年金費用 403
繰延税金負債合計 483	繰延税金負債合計 429
繰延税金資産の純額 2,738	繰延税金資産の純額 3,008
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 31.0%	法定実効税率 31.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 4.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.5%
タックスヘイブン税制 2.6%	タックスヘイブン税制 1.9%
外国税額控除 0.7%	外国税額控除 0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.2%
その他 0.4%	その他 0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.4%

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）				
	前事業年度		当事業年度	
	自	2019年4月 1日	自	2020年4月 1日
	至	2020年3月31日	至	2021年3月31日
期首残高		-		-
有形固定資産の取得に伴う増加		-		1,371
時の経過による調整額		-		-
期末残高		-		1,371

セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売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(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマースナル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

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

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。

* 2021年7月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 2021年7月末現在

独立監査人の監査報告書

2021年9月3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 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村外国債券（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）の2021年1月19日から2021年7月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村外国債券（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）の2021年7月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中**EY新日本有限責任監査法人**
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 亀井 純子
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 津村 健二郎
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水 永 真太郎
業務執行社員**監査意見**

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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