

## 【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28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<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし |
|                                          | ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり |
|                                          | 4,500億円を上限とします。      |
|                                          | ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし |
|                                          | 4,500億円を上限とします。      |
| 【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27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。

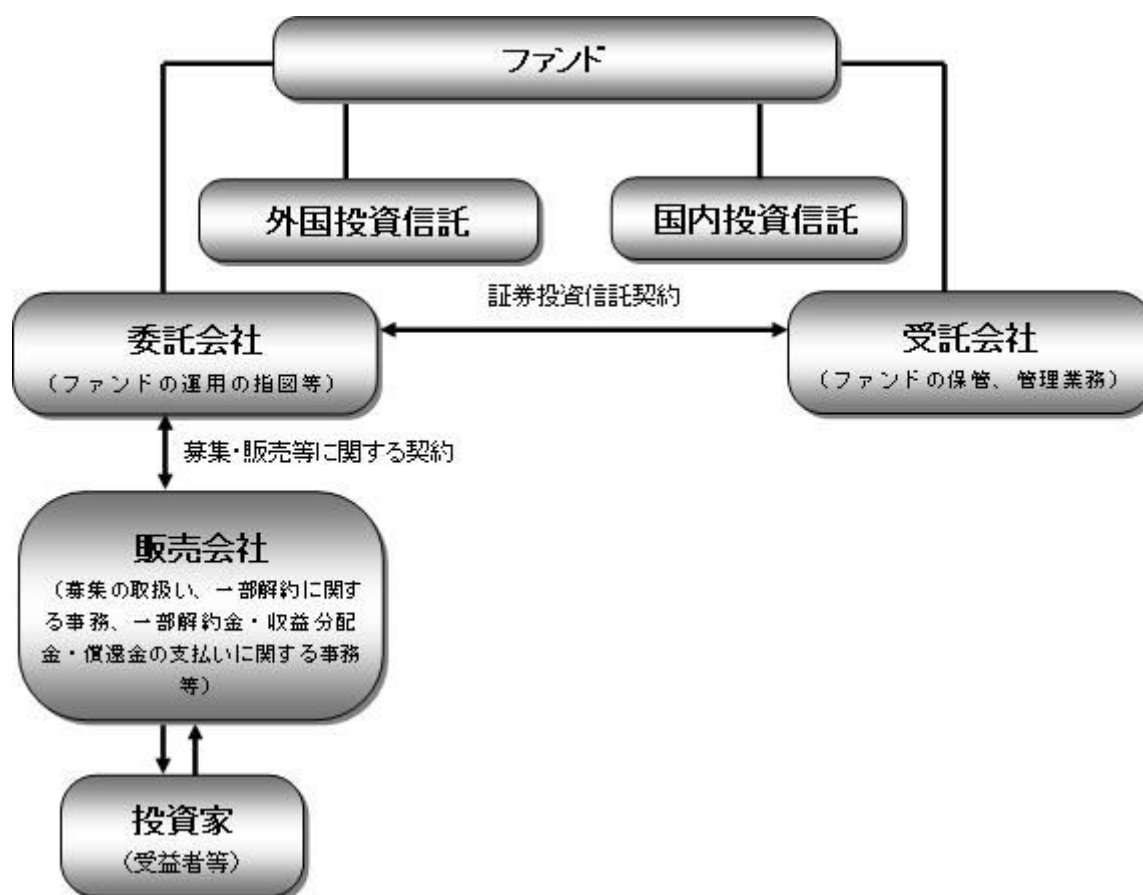
## 第二部【ファンド情報】

## 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

&lt; 更新後 &gt;



| ファンド      | ノルディック社債ファンド<br>為替ヘッジあり                                            | ノルディック社債ファンド<br>為替ヘッジなし                                            |
|-----------|--------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| 外国投資信託    | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ -<br>ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・<br>ファンド A JPYクラス | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ -<br>ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・<br>ファンド B JPYクラス |
| 国内投資信託    | 野村マネーインベストメント 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) | 三井住友信託銀行株式会社<br>(再信託受託者：株式会社日本カストディ銀行)                             |                                                                    |

●ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。



< 更新後 >

■ 委託会社の概況(2021年9月末現在) ■

・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

・ 資本金の額

17,180百万円

・ 会社の沿革

1959年12月 1 日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月 1 日

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

2000年11月 1 日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・ 大株主の状況

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

## 2 投資方針

### ( 2 ) 投資対象

< 更新後 >

北欧市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券）に投資する外国投資信託と、野村マネーインベストメント マザーファンドを主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

#### 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ハ．金銭債権（イ及びロに掲げるものに該当するものを除きます。）

## 2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

### 有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、円建ての外国投資信託受益証券および野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- 4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行なうことができるものとします。

### 金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

### (参考) ファンドが投資対象とする外国投資信託の概要

SuMi TRUST インベストメント・ファンズ-ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド

（A JPY クラス、B JPY クラス）

（アイルランド籍円建外国投資信託）

| <運用の基本方針> |                                                                                                              |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 主要投資対象    | 北欧（ノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランド）市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券） |

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資方針       | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ ファンドは北欧市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。なお、ファンドは北欧市場の優先証券、国債、政府保証債、地方債、短期金融商品等にも投資します。</li> <li>・ 投資にあたっては、北欧を含む欧州市場全体のマクロ経済環境、業種固有の要因、ファンダメンタルズ分析、格付、潜在的な損失リスク等を考慮して発行体の選定を行ないます。更に個別債券の残存期間、利回り、債券特性、流動性等を勘案し投資銘柄の選定を行ないます。</li> <li>運用にあたっては、ESGの視点も含めて投資対象銘柄の評価・分析を行ないます。</li> <li>・ A JPY クラスは、組入外貨建資産について、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。B JPY クラスは、組入外貨建資産について、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ 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。</li> </ul> |
| 主な投資制限     | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資対象の通貨はノルウェー・クローネ（NOK）、スウェーデン・クローナ（SEK）、デンマーク・クローネ（DKK）、アイスランド・クローナ（ISK）、ユーロ（EUR）、米ドル（USD）、ポンド（GBP）、円（JPY）建てとし、原則として信託財産の純資産総額の70%以上はNOK、SEK、DKK、ISK、EUR建ての資産に投資します。</li> <li>・ 投資対象とする債券は、取得時において、原則として格付機関からB-格相当以上の格付が付与されている、もしくは投資顧問会社が同等以上とみなす債券とします。</li> <li>・ 保有する債券の格付が引き下げられ、CCC+格相当以下となった債券、もしくは投資顧問会社が同等以下とみなす債券への投資比率は信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・ 株式への投資は、優先証券のうち株券または新株引受権証書の性質を有するものまたは転換社債を転換、新株予約権を行使したものおよび社債権者割当等により取得したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・ デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。</li> </ul>   |
| 収益分配方針     | 毎月、投資顧問会社と協議の上、管理会社の判断により、分配を行なう方針です。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 償還条項       | ファンドの純資産残高が30億円を下回った場合はファンドを、各クラスの純資産残高が30億円を下回った場合には当該クラスを、それぞれ償還する場合があります。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| < 主な関係法人 > |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 管理会社       | SMTファンド・サービシーズ(アイルランド)リミテッド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 受託会社       | SMTトラスティーズ(アイルランド)リミテッド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投資顧問会社     | DNBアセット・マネジメント・エーエス                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 保管銀行       | 三井住友信託銀行ロンドン支店                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| < 管理報酬等 >  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 信託報酬       | 純資産総額の0.65%（年率）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 申込手数料      | なし                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 信託財産留保額    | なし                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| その他の費用     | 信託財産に関する租税、組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する費用および信託財産の監査に要する費用、外貨建資産の保管などに要する費用、借入金の利息および立替金の利息など。ファンドの設立に係る費用（5年にわたり償却）。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

上記のほか、一般社団法人投資信託協会の定めるファンド・オブ・ファンズ組入投資信託および投資法人の要件を満たしております。

\* 上記は2021年10月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< ファンドが投資対象とする外国投資信託の運用体制等について >

DNBアセット・マネジメント・エーエスは、ノルウェー王国オスロにて設立された、株式、債券等の運用を行

う運用会社です。1967年より資産運用業務を開始し、Financial Supervisory Authority of Norwayの監督下にあります。

運用責任者は、隔月で開催されるクレジット委員会において各ファンドの信用リスク状況をCIO、運用チーム、リスク管理、コンプライアンス部門と共有し、モニタリングします。

## (参考)国内投資信託の概要

### 「野村マネーインベストメント マザーファンド」

#### 運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

##### 1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

###### (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行ないます。

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

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

### ■「野村マネーインベストメント マザーファンド」の運用体制等について■

経済調査部署による国内外の経済調査および発行体の信用力調査をもとに、運用担当者が債券・短期金融商品等の銘柄選定やポートフォリオの構築を行ないます。運用審査部署がファンドのリスク管理・分析を行ない、モニタリング・分析結果を運用チームに提供します。

## 3 投資リスク

&lt; 更新後 &gt;

## ■ リスクの定量的比較（2016年9月末～2021年8月末：月次）

## ■ 為替ヘッジあり

## 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 (%) | 23.8   | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 6.2   | 11.4   | 19.3  |
| 最小値 (%) | △ 14.6 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 4.0 | △ 11.4 | △ 9.4 |
| 平均値 (%) | 4.8    | 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。2016年9月末を10,000として指数化しております。

\* 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。

\* 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。

\* 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。

## ■ 為替ヘッジなし

## 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 (%) | 41.2   | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 6.2   | 11.4   | 19.3  |
| 最小値 (%) | △ 22.6 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 4.0 | △ 11.4 | △ 9.4 |
| 平均値 (%) | 5.7    | 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。2016年9月末を10,000として指数化しております。

\* 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。

\* 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。

\* 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。

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>&lt;代表的な資産クラスの指数&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）</li> <li>○先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）</li> <li>○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）</li> <li>○日本国債：NOMURA-BPI 国債</li> <li>○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）</li> <li>○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）</li> </ul>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| <p>■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■</p> <p>○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に所有しています。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。</p> <p>○MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産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。</p> <p>○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。</p> <p>○FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。</p> <p>○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase &amp; Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。</p> <p>米国の J.P. 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）についての勧誘、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または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。</p> <p>JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPSI、J.P. Morgan Securities PLC、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。</p> <p>（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他）</p> |

#### 4 手数料等及び税金

#### （５）課税上の取扱い

##### < 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

##### ■個人、法人別の課税について■

個人の投資家に対する課税

##### < 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

##### < 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

##### 損益通算について

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

|        |                                 |        |
|--------|---------------------------------|--------|
| 《利子所得》 | 《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>（注2）</sup> | 《配当所得》 |
|--------|---------------------------------|--------|

|                                                      |                                                      |                                   |
|------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------------------------|
| ・ 特定公社債 <sup>(注1)</sup> の利子<br>・ 公募公社債投資信託の収益<br>分配金 | 特定公社債、公募公社債投資信託、上場株<br>式、公募株式投資信託の<br>・ 譲渡益<br>・ 譲渡損 | ・ 上場株式の配当<br>・ 公募株式投資信託の収益<br>分配金 |
|------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------------------------|

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

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

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

#### 法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### ■ 換金(解約)時および償還時の課税について ■

##### [個人の投資家の場合]

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

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

##### [法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

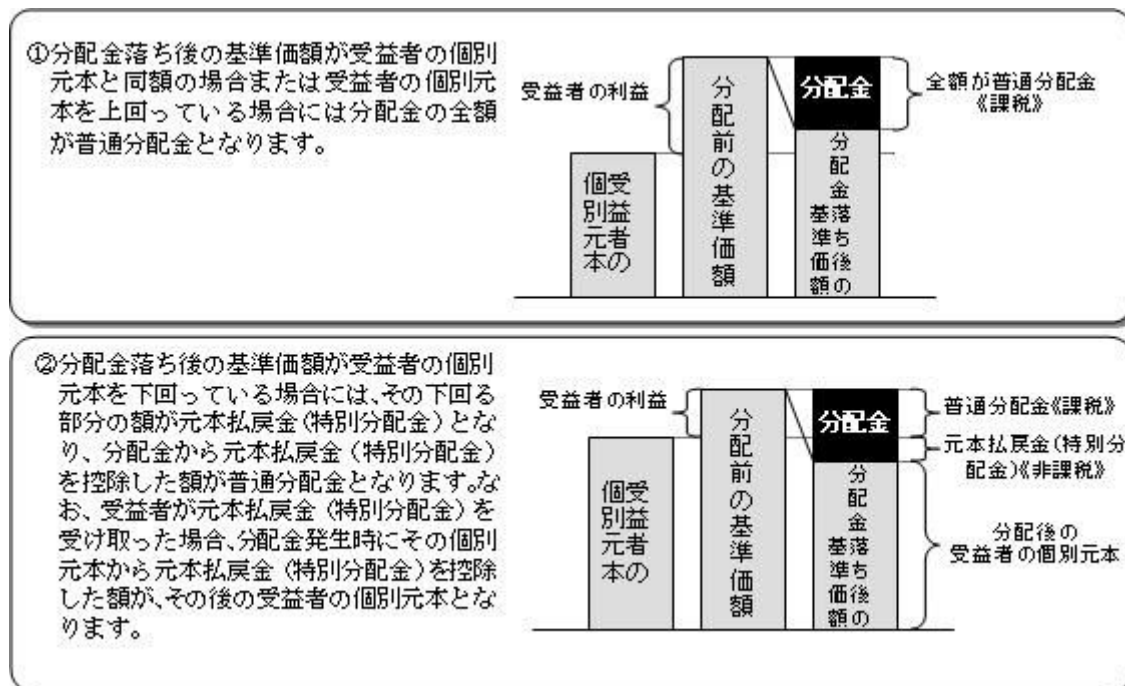
#### ■ 個別元本について ■

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

#### ■ 分配金の課税について ■

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



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

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

#### ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

| 資産の種類              | 国／地域   | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|--------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券           | アイルランド | 19,112,896,530 | 97.43   |
| 親投資信託受益証券          | 日本     | 9,978,105      | 0.05    |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —      | 493,963,093    | 2.51    |
| 合計（純資産総額）          |        | 19,616,837,728 | 100.00  |

#### ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

| 資産の種類     | 国／地域   | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|-----------|--------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券  | アイルランド | 3,108,626,913 | 97.63   |
| 親投資信託受益証券 | 日本     | 9,978,105     | 0.31    |

|                    |   |               |        |
|--------------------|---|---------------|--------|
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | — | 65,475,537    | 2.05   |
| 合計（純資産総額）          |   | 3,184,080,555 | 100.00 |

（参考）野村マネーインベストメント マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）    | 投資比率（％） |
|--------------------|------|------------|---------|
| 国債証券               | 日本   | 1,000,081  | 4.93    |
| 特殊債券               | 日本   | 10,017,840 | 49.43   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 9,248,312  | 45.63   |
| 合計（純資産総額）          |      | 20,266,233 | 100.00  |

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

| 順位 | 国／地域   | 種類        | 銘柄名                                                       | 数量        | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|--------|-----------|-----------------------------------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アイルランド | 投資信託受益証券  | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPYクラス | 2,472,561 | 7,745           | 19,152,375,760  | 7,730           | 19,112,896,530  | 97.43           |
| 2  | 日本     | 親投資信託受益証券 | 野村マネーインベストメント マザーファンド                                     | 9,952,230 | 1.0026          | 9,978,105       | 1.0026          | 9,978,105       | 0.05            |

種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券  | 97.43   |
| 親投資信託受益証券 | 0.05    |
| 合 計       | 97.48   |

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

| 順位 | 国／地域   | 種類        | 銘柄名                                                       | 数量        | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|--------|-----------|-----------------------------------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アイルランド | 投資信託受益証券  | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPYクラス | 541,667   | 5,745           | 3,112,233,896   | 5,739           | 3,108,626,913   | 97.63           |
| 2  | 日本     | 親投資信託受益証券 | 野村マネーインベストメント マザーファンド                                     | 9,952,230 | 1.0026          | 9,978,105       | 1.0026          | 9,978,105       | 0.31            |

種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券  | 97.63   |
| 親投資信託受益証券 | 0.31    |
| 合 計       | 97.94   |

（参考）野村マネーインベストメント マザーファンド

| 順位 | 国 / 地域 | 種類   | 銘柄名                                | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|------|------------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本     | 特殊債券 | 政保 地方公共<br>団体金融機構債<br>券（8年）第<br>2回 | 10,000,000 | 100.17          | 10,017,840      | 100.17          | 10,017,840      | 0.502     | 2021/12/24 | 49.43           |
| 2  | 日本     | 国債証券 | 国庫短期証券<br>第998回                    | 1,000,000  | 100.00          | 1,000,081       | 100.00          | 1,000,081       | —         | 2021/9/6   | 4.93            |

種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 4.93    |
| 特殊債券 | 49.43   |
| 合 計  | 54.36   |

投資不動産物件

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

該当事項はありません。

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

該当事項はありません。

（参考）野村マネーインベストメント 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

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

該当事項はありません。

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

該当事項はありません。

## （参考）野村マネーインベストメント 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

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

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  | (2015年 8月 7日) | 1,438      | 1,443  | 0.9928       | 0.9958 |
| 第2特定期間  | (2016年 2月 8日) | 502        | 504    | 0.8647       | 0.8677 |
| 第3特定期間  | (2016年 8月 8日) | 482        | 484    | 0.9003       | 0.9033 |
| 第4特定期間  | (2017年 2月 7日) | 1,766      | 1,771  | 0.9515       | 0.9545 |
| 第5特定期間  | (2017年 8月 7日) | 6,521      | 6,541  | 0.9777       | 0.9807 |
| 第6特定期間  | (2018年 2月 7日) | 10,365     | 10,397 | 0.9825       | 0.9855 |
| 第7特定期間  | (2018年 8月 7日) | 10,879     | 10,912 | 0.9739       | 0.9769 |
| 第8特定期間  | (2019年 2月 7日) | 11,783     | 11,820 | 0.9573       | 0.9603 |
| 第9特定期間  | (2019年 8月 7日) | 15,610     | 15,659 | 0.9604       | 0.9634 |
| 第10特定期間 | (2020年 2月 7日) | 16,945     | 16,998 | 0.9549       | 0.9579 |
| 第11特定期間 | (2020年 8月 7日) | 15,384     | 15,436 | 0.8844       | 0.8874 |
| 第12特定期間 | (2021年 2月 8日) | 16,831     | 16,886 | 0.9312       | 0.9342 |
| 第13特定期間 | (2021年 8月10日) | 19,311     | 19,372 | 0.9507       | 0.9537 |
|         | 2020年 8月末日    | 15,811     | —      | 0.9009       | —      |
|         | 9月末日          | 15,948     | —      | 0.9031       | —      |
|         | 10月末日         | 15,930     | —      | 0.9031       | —      |
|         | 11月末日         | 16,054     | —      | 0.9136       | —      |
|         | 12月末日         | 16,175     | —      | 0.9200       | —      |
|         | 2021年 1月末日    | 16,966     | —      | 0.9314       | —      |
|         | 2月末日          | 17,076     | —      | 0.9377       | —      |
|         | 3月末日          | 17,188     | —      | 0.9424       | —      |
|         | 4月末日          | 17,373     | —      | 0.9460       | —      |
|         | 5月末日          | 17,898     | —      | 0.9495       | —      |
|         | 6月末日          | 18,459     | —      | 0.9519       | —      |
|         | 7月末日          | 19,157     | —      | 0.9524       | —      |
|         | 8月末日          | 19,616     | —      | 0.9542       | —      |

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

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  | (2015年 8月 7日) | 7,560      | 7,591 | 0.9751       | 0.9791 |
| 第2特定期間  | (2016年 2月 8日) | 4,320      | 4,342 | 0.7912       | 0.7952 |
| 第3特定期間  | (2016年 8月 8日) | 3,024      | 3,041 | 0.7130       | 0.7170 |
| 第4特定期間  | (2017年 2月 7日) | 2,980      | 2,995 | 0.8339       | 0.8379 |
| 第5特定期間  | (2017年 8月 7日) | 4,126      | 4,145 | 0.8782       | 0.8822 |
| 第6特定期間  | (2018年 2月 7日) | 5,184      | 5,208 | 0.8866       | 0.8906 |
| 第7特定期間  | (2018年 8月 7日) | 4,826      | 4,849 | 0.8492       | 0.8532 |
| 第8特定期間  | (2019年 2月 7日) | 3,871      | 3,891 | 0.8053       | 0.8093 |
| 第9特定期間  | (2019年 8月 7日) | 3,604      | 3,623 | 0.7593       | 0.7633 |
| 第10特定期間 | (2020年 2月 7日) | 3,545      | 3,563 | 0.7600       | 0.7640 |
| 第11特定期間 | (2020年 8月 7日) | 3,244      | 3,262 | 0.6968       | 0.7008 |
| 第12特定期間 | (2021年 2月 8日) | 3,307      | 3,325 | 0.7432       | 0.7472 |
| 第13特定期間 | (2021年 8月10日) | 3,149      | 3,165 | 0.7652       | 0.7692 |
|         | 2020年 8月末日    | 3,322      | —     | 0.7140       | —      |
|         | 9月末日          | 3,202      | —     | 0.6955       | —      |
|         | 10月末日         | 3,158      | —     | 0.6829       | —      |
|         | 11月末日         | 3,268      | —     | 0.7136       | —      |
|         | 12月末日         | 3,285      | —     | 0.7257       | —      |
|         | 2021年 1月末日    | 3,290      | —     | 0.7368       | —      |
|         | 2月末日          | 3,392      | —     | 0.7644       | —      |
|         | 3月末日          | 3,360      | —     | 0.7737       | —      |
|         | 4月末日          | 3,292      | —     | 0.7883       | —      |
|         | 5月末日          | 3,305      | —     | 0.7954       | —      |
|         | 6月末日          | 3,276      | —     | 0.7850       | —      |
|         | 7月末日          | 3,186      | —     | 0.7717       | —      |
|         | 8月末日          | 3,184      | —     | 0.7718       | —      |

## 分配の推移

### ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

|        | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第1特定期間 | 2015年 4月28日～2015年 8月 7日 | 0.0060円   |
| 第2特定期間 | 2015年 8月 8日～2016年 2月 8日 | 0.0180円   |
| 第3特定期間 | 2016年 2月 9日～2016年 8月 8日 | 0.0180円   |
| 第4特定期間 | 2016年 8月 9日～2017年 2月 7日 | 0.0180円   |
| 第5特定期間 | 2017年 2月 8日～2017年 8月 7日 | 0.0180円   |
| 第6特定期間 | 2017年 8月 8日～2018年 2月 7日 | 0.0180円   |

|         |                         |         |
|---------|-------------------------|---------|
| 第7特定期間  | 2018年 2月 8日～2018年 8月 7日 | 0.0180円 |
| 第8特定期間  | 2018年 8月 8日～2019年 2月 7日 | 0.0180円 |
| 第9特定期間  | 2019年 2月 8日～2019年 8月 7日 | 0.0180円 |
| 第10特定期間 | 2019年 8月 8日～2020年 2月 7日 | 0.0180円 |
| 第11特定期間 | 2020年 2月 8日～2020年 8月 7日 | 0.0180円 |
| 第12特定期間 | 2020年 8月 8日～2021年 2月 8日 | 0.0180円 |
| 第13特定期間 | 2021年 2月 9日～2021年 8月10日 | 0.0180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。

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第1特定期間  | 2015年 4月28日～2015年 8月 7日 | 0.0080円   |
| 第2特定期間  | 2015年 8月 8日～2016年 2月 8日 | 0.0240円   |
| 第3特定期間  | 2016年 2月 9日～2016年 8月 8日 | 0.0240円   |
| 第4特定期間  | 2016年 8月 9日～2017年 2月 7日 | 0.0240円   |
| 第5特定期間  | 2017年 2月 8日～2017年 8月 7日 | 0.0240円   |
| 第6特定期間  | 2017年 8月 8日～2018年 2月 7日 | 0.0240円   |
| 第7特定期間  | 2018年 2月 8日～2018年 8月 7日 | 0.0240円   |
| 第8特定期間  | 2018年 8月 8日～2019年 2月 7日 | 0.0240円   |
| 第9特定期間  | 2019年 2月 8日～2019年 8月 7日 | 0.0240円   |
| 第10特定期間 | 2019年 8月 8日～2020年 2月 7日 | 0.0240円   |
| 第11特定期間 | 2020年 2月 8日～2020年 8月 7日 | 0.0240円   |
| 第12特定期間 | 2020年 8月 8日～2021年 2月 8日 | 0.0240円   |
| 第13特定期間 | 2021年 2月 9日～2021年 8月10日 | 0.0240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

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

|        | 計算期間                    | 収益率   |
|--------|-------------------------|-------|
| 第1特定期間 | 2015年 4月28日～2015年 8月 7日 | 0.1%  |
| 第2特定期間 | 2015年 8月 8日～2016年 2月 8日 | 11.1% |
| 第3特定期間 | 2016年 2月 9日～2016年 8月 8日 | 6.2%  |
| 第4特定期間 | 2016年 8月 9日～2017年 2月 7日 | 7.7%  |
| 第5特定期間 | 2017年 2月 8日～2017年 8月 7日 | 4.6%  |
| 第6特定期間 | 2017年 8月 8日～2018年 2月 7日 | 2.3%  |
| 第7特定期間 | 2018年 2月 8日～2018年 8月 7日 | 1.0%  |
| 第8特定期間 | 2018年 8月 8日～2019年 2月 7日 | 0.1%  |
| 第9特定期間 | 2019年 2月 8日～2019年 8月 7日 | 2.2%  |

|         |                         |      |
|---------|-------------------------|------|
| 第10特定期間 | 2019年 8月 8日～2020年 2月 7日 | 1.3% |
| 第11特定期間 | 2020年 2月 8日～2020年 8月 7日 | 5.5% |
| 第12特定期間 | 2020年 8月 8日～2021年 2月 8日 | 7.3% |
| 第13特定期間 | 2021年 2月 9日～2021年 8月10日 | 4.0% |

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

|         | 計算期間                    | 収益率   |
|---------|-------------------------|-------|
| 第1特定期間  | 2015年 4月28日～2015年 8月 7日 | 1.7%  |
| 第2特定期間  | 2015年 8月 8日～2016年 2月 8日 | 16.4% |
| 第3特定期間  | 2016年 2月 9日～2016年 8月 8日 | 6.9%  |
| 第4特定期間  | 2016年 8月 9日～2017年 2月 7日 | 20.3% |
| 第5特定期間  | 2017年 2月 8日～2017年 8月 7日 | 8.2%  |
| 第6特定期間  | 2017年 8月 8日～2018年 2月 7日 | 3.7%  |
| 第7特定期間  | 2018年 2月 8日～2018年 8月 7日 | 1.5%  |
| 第8特定期間  | 2018年 8月 8日～2019年 2月 7日 | 2.3%  |
| 第9特定期間  | 2019年 2月 8日～2019年 8月 7日 | 2.7%  |
| 第10特定期間 | 2019年 8月 8日～2020年 2月 7日 | 3.3%  |
| 第11特定期間 | 2020年 2月 8日～2020年 8月 7日 | 5.2%  |
| 第12特定期間 | 2020年 8月 8日～2021年 2月 8日 | 10.1% |
| 第13特定期間 | 2021年 2月 9日～2021年 8月10日 | 6.2%  |

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

## （４）設定及び解約の実績

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

|        | 計算期間                    | 設定口数          | 解約口数          | 発行済み口数         |
|--------|-------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 第1特定期間 | 2015年 4月28日～2015年 8月 7日 | 1,525,037,696 | 75,961,659    | 1,449,076,037  |
| 第2特定期間 | 2015年 8月 8日～2016年 2月 8日 | 52,597,584    | 920,676,860   | 580,996,761    |
| 第3特定期間 | 2016年 2月 9日～2016年 8月 8日 | 46,968,222    | 91,781,034    | 536,183,949    |
| 第4特定期間 | 2016年 8月 9日～2017年 2月 7日 | 1,686,216,638 | 366,386,731   | 1,856,013,856  |
| 第5特定期間 | 2017年 2月 8日～2017年 8月 7日 | 6,899,355,226 | 2,085,016,901 | 6,670,352,181  |
| 第6特定期間 | 2017年 8月 8日～2018年 2月 7日 | 6,068,223,208 | 2,188,149,732 | 10,550,425,657 |
| 第7特定期間 | 2018年 2月 8日～2018年 8月 7日 | 3,165,230,915 | 2,544,585,291 | 11,171,071,281 |
| 第8特定期間 | 2018年 8月 8日～2019年 2月 7日 | 3,124,711,708 | 1,987,205,300 | 12,308,577,689 |

|         |                         |               |               |                |
|---------|-------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 第9特定期間  | 2019年 2月 8日～2019年 8月 7日 | 5,504,954,373 | 1,559,876,846 | 16,253,655,216 |
| 第10特定期間 | 2019年 8月 8日～2020年 2月 7日 | 3,317,324,927 | 1,826,558,674 | 17,744,421,469 |
| 第11特定期間 | 2020年 2月 8日～2020年 8月 7日 | 954,611,336   | 1,304,527,765 | 17,394,505,040 |
| 第12特定期間 | 2020年 8月 8日～2021年 2月 8日 | 2,420,014,633 | 1,739,526,211 | 18,074,993,462 |
| 第13特定期間 | 2021年 2月 9日～2021年 8月10日 | 4,006,792,045 | 1,767,860,304 | 20,313,925,203 |

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

|         | 計算期間                    | 設定口数          | 解約口数          | 発行済み口数        |
|---------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 第1特定期間  | 2015年 4月28日～2015年 8月 7日 | 7,959,414,803 | 205,750,619   | 7,753,664,184 |
| 第2特定期間  | 2015年 8月 8日～2016年 2月 8日 | 250,943,046   | 2,543,900,955 | 5,460,706,275 |
| 第3特定期間  | 2016年 2月 9日～2016年 8月 8日 | 189,299,721   | 1,407,507,524 | 4,242,498,472 |
| 第4特定期間  | 2016年 8月 9日～2017年 2月 7日 | 555,438,249   | 1,223,629,408 | 3,574,307,313 |
| 第5特定期間  | 2017年 2月 8日～2017年 8月 7日 | 2,206,384,325 | 1,081,881,371 | 4,698,810,267 |
| 第6特定期間  | 2017年 8月 8日～2018年 2月 7日 | 2,979,283,666 | 1,830,395,146 | 5,847,698,787 |
| 第7特定期間  | 2018年 2月 8日～2018年 8月 7日 | 774,138,894   | 938,042,845   | 5,683,794,836 |
| 第8特定期間  | 2018年 8月 8日～2019年 2月 7日 | 325,767,312   | 1,201,600,548 | 4,807,961,600 |
| 第9特定期間  | 2019年 2月 8日～2019年 8月 7日 | 571,346,661   | 632,078,597   | 4,747,229,664 |
| 第10特定期間 | 2019年 8月 8日～2020年 2月 7日 | 326,115,534   | 408,593,654   | 4,664,751,544 |
| 第11特定期間 | 2020年 2月 8日～2020年 8月 7日 | 153,916,288   | 162,912,292   | 4,655,755,540 |
| 第12特定期間 | 2020年 8月 8日～2021年 2月 8日 | 142,075,460   | 347,208,067   | 4,450,622,933 |
| 第13特定期間 | 2021年 2月 9日～2021年 8月10日 | 526,221,792   | 861,762,363   | 4,115,082,362 |

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）

■ 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） ■ 純資産総額（右軸）

#### ■ 為替ヘッジあり



#### ■ 為替ヘッジなし



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

#### ■ 為替ヘッジあり

|         |         |
|---------|---------|
| 2021年8月 | 30 円    |
| 2021年7月 | 30 円    |
| 2021年6月 | 30 円    |
| 2021年5月 | 30 円    |
| 2021年4月 | 30 円    |
| 直近1年間累計 | 360 円   |
| 設定来累計   | 2,220 円 |

#### ■ 為替ヘッジなし

|         |         |
|---------|---------|
| 2021年8月 | 40 円    |
| 2021年7月 | 40 円    |
| 2021年6月 | 40 円    |
| 2021年5月 | 40 円    |
| 2021年4月 | 40 円    |
| 直近1年間累計 | 480 円   |
| 設定来累計   | 2,960 円 |

### ■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

| 順位 | 銘柄                                              | 業種    | 投資比率（％） |         |
|----|-------------------------------------------------|-------|---------|---------|
|    |                                                 |       | 為替ヘッジあり | 為替ヘッジなし |
| 1  | IJsbeer Energie Europa FRN 07.09.2023           | 公共    | 2.2     | 2.2     |
| 2  | Stena AB 7 01.02.2024                           | 多角経営  | 1.4     | 1.4     |
| 3  | Norican Group ApS 4.5 15.05.2023                | 工業    | 1.3     | 1.3     |
| 4  | Secop Group Holding GmbH FRN 28.01.2024         | 一般消費財 | 1.3     | 1.3     |
| 5  | SGL TransGroup International A/S FRN 04.11.2024 | 工業    | 1.3     | 1.3     |
| 6  | Kistefos AS FRN 11.09.2024                      | 金融    | 1.3     | 1.3     |
| 7  | Stolt-Nielsen Limited FRN 20.02.2024            | 工業    | 1.2     | 1.2     |
| 8  | Axactor AB FRN 12.01.2024                       | 金融    | 1.2     | 1.2     |
| 9  | Independent Oil & Gas FRN 20.09.2024            | エネルギー | 1.2     | 1.2     |
| 10 | R-Logitech Srl 8.5 29.03.2023                   | 工業    | 1.2     | 1.2     |

### ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

#### ■ 為替ヘッジあり



- ・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。
- ・2015年は設定日（2015年4月28日）から年末までの収益率。

#### ■ 為替ヘッジなし



- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

## 第3【ファンドの経理状況】

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり  
ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

(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2月9日から2021年8月10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

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

## (1) 貸借対照表

| (単位：円)          |                       |                       |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 前期<br>(2021年 2月 8日現在) | 当期<br>(2021年 8月10日現在) |
| <b>資産の部</b>     |                       |                       |
| 流動資産            |                       |                       |
| コール・ローン         | 279,201,411           | 412,388,286           |
| 投資信託受益証券        | 16,651,810,824        | 19,005,275,760        |
| 親投資信託受益証券       | 9,981,091             | 9,978,105             |
| 未収入金            | 49,800,000            | -                     |
| 流動資産合計          | 16,990,793,326        | 19,427,642,151        |
| 資産合計            | 16,990,793,326        | 19,427,642,151        |
| <b>負債の部</b>     |                       |                       |
| 流動負債            |                       |                       |
| 未払収益分配金         | 54,224,980            | 60,941,775            |
| 未払解約金           | 89,474,973            | 36,151,687            |
| 未払受託者報酬         | 477,290               | 584,775               |
| 未払委託者報酬         | 14,636,883            | 17,933,090            |
| 未払利息            | 90                    | 365                   |
| その他未払費用         | 31,807                | 38,974                |
| 流動負債合計          | 158,846,023           | 115,650,666           |
| 負債合計            | 158,846,023           | 115,650,666           |
| <b>純資産の部</b>    |                       |                       |
| 元本等             |                       |                       |
| 元本              | 18,074,993,462        | 20,313,925,203        |
| 剰余金             |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 1,243,046,159         | 1,001,933,718         |
| (分配準備積立金)       | 1,295,018,814         | 1,420,588,511         |
| 元本等合計           | 16,831,947,303        | 19,311,991,485        |
| 純資産合計           | 16,831,947,303        | 19,311,991,485        |
| 負債純資産合計         | 16,990,793,326        | 19,427,642,151        |

## (2) 損益及び剰余金計算書

|                                           | 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日 | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日 |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                      |                                      |
| 受取配当金                                     | 687,542,560                          | 674,869,200                          |
| 有価証券売買等損益                                 | 536,206,718                          | 116,261,950                          |
| 営業収益合計                                    | 1,223,749,278                        | 791,131,150                          |
| 営業費用                                      |                                      |                                      |
| 支払利息                                      | 44,600                               | 55,018                               |
| 受託者報酬                                     | 2,683,106                            | 2,940,094                            |
| 委託者報酬                                     | 82,281,985                           | 90,162,810                           |
| その他費用                                     | 178,812                              | 195,946                              |
| 営業費用合計                                    | 85,188,503                           | 93,353,868                           |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 1,138,560,775                        | 697,777,282                          |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 1,138,560,775                        | 697,777,282                          |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 1,138,560,775                        | 697,777,282                          |
| 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（ ） | 12,249,820                           | 5,062,952                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 2,010,183,256                        | 1,243,046,159                        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 154,647,877                          | 104,460,590                          |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 154,647,877                          | 104,460,590                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 195,554,118                          | 214,996,803                          |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 195,554,118                          | 214,996,803                          |
| 分配金                                       | 318,267,617                          | 341,065,676                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 1,243,046,159                        | 1,001,933,718                        |

## （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     | 投資信託受益証券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。<br>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。<br>親投資信託受益証券<br>基準価額で評価しております。 |
| 2.費用・収益の計上基準          | 受取配当金<br>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。<br>有価証券売買等損益<br>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 2月 9日から2021年 8月10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<br>2021年 2月 8日現在                                                          | 当期<br>2021年 8月10日現在                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>18,074,993,462口                                      | 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>20,313,925,203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<br><br>元本の欠損 1,243,046,159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<br><br>元本の欠損 1,001,933,718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<br>1口当たり純資産額 0.9312円<br>(10,000口当たり純資産額) (9,312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<br>1口当たり純資産額 0.9507円<br>(10,000口当たり純資産額) (9,507円) |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                           |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|-----------------|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|----|--------|---|----------------|----------|---|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|-----------------|-------------------|----------------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|-----|---------|----------------|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|---|----|--------------|---|----------------|---------------------------|---|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|-----------------|-------------------|----------------|----------------|--------------|---|-----------------|-------------------|----------------|--------|----------------|---|-----|---------|----------------|-------------|
| 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日      |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 1. 分配金の計算過程<br>2020年 8月 8日から2020年 9月 7日まで                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 1. 分配金の計算過程<br>2021年 2月 9日から2021年 3月 8日まで |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>117,882,326円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,002,149,639円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,099,768,749円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>3,219,800,714円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>17,532,988,094口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>1,836円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>30円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>52,598,964円</td></tr></table> | 項目                                        |                 |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 117,882,326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 | 2,002,149,639円 | 分配準備積立金額 | D | 1,099,768,749円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,219,800,714円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 17,532,988,094口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 1,836円 | 10,000口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | H  | 30円 | 収益分配金金額 | I=F × H/10,000 | 52,598,964円 | <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>98,607,717円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,281,045,581円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,278,150,291円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>3,657,803,589円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>18,248,185,105口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>2,004円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>30円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>54,744,555円</td></tr></table> | 項目                        |   |    | 費用控除後の配当等収益額 | A | 98,607,717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         | 2,281,045,581円 | 分配準備積立金額     | D | 1,278,150,291円  | 当ファンドの分配対象収益額     | E=A+B+C+D      | 3,657,803,589円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 18,248,185,105口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 2,004円 | 10,000口当たり分配金額 | H | 30円 | 収益分配金金額 | I=F × H/10,000 | 54,744,555円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                           |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | A                                         | 117,882,326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                                         | 2,002,149,639円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                         | 1,099,768,749円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                                 | 3,219,800,714円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                         | 17,532,988,094口 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 10,000口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | G=E/F × 10,000                            | 1,836円          |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 10,000口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | H                                         | 30円             |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 収益分配金金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | I=F × H/10,000                            | 52,598,964円     |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                           |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | A                                         | 98,607,717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                                         | 2,281,045,581円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                         | 1,278,150,291円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                                 | 3,657,803,589円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                         | 18,248,185,105口 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 10,000口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | G=E/F × 10,000                            | 2,004円          |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 10,000口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | H                                         | 30円             |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 収益分配金金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | I=F × H/10,000                            | 54,744,555円     |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 2020年 9月 8日から2020年10月 7日まで                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 2021年 3月 9日から2021年 4月 7日まで                |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>110,765,046円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,041,999,004円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,156,212,554円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>3,308,976,604円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>17,700,419,870口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>1,869円</td></tr></table>                                                                                                                           | 項目                                        |                 |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 110,765,046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 | 2,041,999,004円 | 分配準備積立金額 | D | 1,156,212,554円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,308,976,604円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 17,700,419,870口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 1,869円 | <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>97,395,168円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,312,678,109円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,292,331,380円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>3,702,404,657円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>18,252,131,805口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>2,028円</td></tr></table> | 項目 |     |         | 費用控除後の配当等収益額   | A           | 97,395,168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 | 2,312,678,109円 | 分配準備積立金額                  | D | 1,292,331,380円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,702,404,657円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 18,252,131,805口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 2,028円         |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                           |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | A                                         | 110,765,046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                                         | 2,041,999,004円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                         | 1,156,212,554円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                                 | 3,308,976,604円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                         | 17,700,419,870口 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 10,000口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | G=E/F × 10,000                            | 1,869円          |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                           |                 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | A                                         | 97,395,168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                                         | 2,312,678,109円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                         | 1,292,331,380円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                                 | 3,702,404,657円  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                         | 18,252,131,805口 |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |
| 10,000口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | G=E/F × 10,000                            | 2,028円          |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |     |         |                |             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                           |   |    |              |   |                |                           |   |                |               |           |                |              |   |                 |                   |                |                |              |   |                 |                   |                |        |                |   |     |         |                |             |

|                |                       |             |
|----------------|-----------------------|-------------|
| 10,000口当たり分配金額 | H                     | 30円         |
| 収益分配金金額        | $I=F \times H/10,000$ | 53,101,259円 |

2020年10月 8日から2020年11月 9日まで

| 項目                        |                       |                 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 109,839,742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                     | 2,037,275,419円  |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 1,200,655,075円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 3,347,770,236円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 17,601,673,951口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 1,901円          |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 30円             |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 52,805,021円     |

2020年11月10日から2020年12月 7日まで

| 項目                        |                       |                 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 99,667,277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                     | 2,057,857,029円  |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 1,243,887,807円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 3,401,412,113円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 17,634,966,083口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 1,928円          |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 30円             |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 52,904,898円     |

2020年12月 8日から2021年 1月 7日まで

| 項目                        |                       |                 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 96,329,979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                     | 2,068,549,720円  |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 1,263,131,077円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 3,428,010,776円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 17,544,165,091口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 1,953円          |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 30円             |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 52,632,495円     |

2021年 1月 8日から2021年 2月 8日まで

| 項目                        |   |                |
|---------------------------|---|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A | 95,391,345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 | 2,229,715,176円 |

|                |                       |             |
|----------------|-----------------------|-------------|
| 10,000口当たり分配金額 | H                     | 30円         |
| 収益分配金金額        | $I=F \times H/10,000$ | 54,756,395円 |

2021年 4月 8日から2021年 5月 7日まで

| 項目                        |                       |                 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 97,492,232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                     | 2,388,372,025円  |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 1,308,404,370円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 3,794,268,627円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 18,491,454,474口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,051円          |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 30円             |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 55,474,363円     |

2021年 5月 8日から2021年 6月 7日まで

| 項目                        |                       |                 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 98,995,826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                     | 2,488,764,199円  |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 1,324,521,830円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 3,912,281,855円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 18,851,166,122口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,075円          |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 30円             |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 56,553,498円     |

2021年 6月 8日から2021年 7月 7日まで

| 項目                        |                       |                 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 98,972,322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                     | 2,645,169,344円  |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 1,352,195,161円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 4,096,336,827円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 19,531,696,889口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,097円          |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 30円             |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 58,595,090円     |

2021年 7月 8日から2021年 8月10日まで

| 項目                        |   |                |
|---------------------------|---|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A | 101,396,842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 | 2,821,241,624円 |

|                   |              |                 |                   |              |                 |
|-------------------|--------------|-----------------|-------------------|--------------|-----------------|
| 分配準備積立金額          | D            | 1,253,852,449円  | 分配準備積立金額          | D            | 1,380,133,444円  |
| 当ファンドの分配対象収益額     | E=A+B+C+D    | 3,578,958,970円  | 当ファンドの分配対象収益額     | E=A+B+C+D    | 4,302,771,910円  |
| 当ファンドの期末残存口数      | F            | 18,074,993,462口 | 当ファンドの期末残存口数      | F            | 20,313,925,203口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 1,980円          | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 2,118円          |
| 10,000口当たり分配金額    | H            | 30円             | 10,000口当たり分配金額    | H            | 30円             |
| 収益分配金金額           | I=F×H/10,000 | 54,224,980円     | 収益分配金金額           | I=F×H/10,000 | 60,941,775円     |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日                                                                       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、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なっております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 前期<br>2021年 2月 8日現在 | 当期<br>2021年 8月10日現在 |
|---------------------|---------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額  | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額  |

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日                                  | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10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<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日 | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日 |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 期首元本額 17,394,505,040円                | 期首元本額 18,074,993,462円                |
| 期中追加設定元本額 2,420,014,633円             | 期中追加設定元本額 4,006,792,045円             |
| 期中一部解約元本額 1,739,526,211円             | 期中一部解約元本額 1,767,860,304円             |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類        | 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日 | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10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）                       |
| 投資信託受益証券  | 150,433,481                          | 21,339,535                           |
| 親投資信託受益証券 | 0                                    | 996                                  |
| 合計        | 150,433,481                          | 21,340,531                           |

## 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8月10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8月10日現在)

( 単位:円 )

| 種類        | 通貨  | 銘柄                                                          | 券面総額      | 評価額                     | 備考 |
|-----------|-----|-------------------------------------------------------------|-----------|-------------------------|----|
| 投資信託受益証券  | 日本円 | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ - ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPYクラス | 2,453,560 | 19,005,275,760          |    |
|           | 小計  | 銘柄数：1<br>組入時価比率：98.4%                                       | 2,453,560 | 19,005,275,760<br>99.9% |    |
|           | 合計  |                                                             |           | 19,005,275,760          |    |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 野村マネーインベストメント マザーファンド                                       | 9,952,230 | 9,978,105               |    |
|           | 小計  | 銘柄数：1<br>組入時価比率：0.1%                                        | 9,952,230 | 9,978,105<br>0.1%       |    |
|           | 合計  |                                                             |           | 9,978,105               |    |
| 合計        |     |                                                             |           | 19,015,253,865          |    |

(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。

## ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位:円 )

|           | 前期<br>(2021年 2月 8日現在) | 当期<br>(2021年 8月10日現在) |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部      |                       |                       |
| 流動資産      |                       |                       |
| コール・ローン   | 69,747,672            | 65,873,397            |
| 投資信託受益証券  | 3,250,992,148         | 3,102,690,604         |
| 親投資信託受益証券 | 9,981,091             | 9,978,105             |
| 未収入金      | 13,200,000            | -                     |

|                 | 前期<br>(2021年 2月 8日現在) | 当期<br>(2021年 8月10日現在) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 流動資産合計          | 3,343,920,911         | 3,178,542,106         |
| 資産合計            | 3,343,920,911         | 3,178,542,106         |
| 負債の部            |                       |                       |
| 流動負債            |                       |                       |
| 未払収益分配金         | 17,802,491            | 16,460,329            |
| 未払解約金           | 15,263,526            | 9,956,596             |
| 未払受託者報酬         | 95,714                | 97,896                |
| 未払委託者報酬         | 2,935,286             | 3,002,174             |
| 未払利息            | 22                    | 58                    |
| その他未払費用         | 6,370                 | 6,518                 |
| 流動負債合計          | 36,103,409            | 29,523,571            |
| 負債合計            | 36,103,409            | 29,523,571            |
| 純資産の部           |                       |                       |
| 元本等             |                       |                       |
| 元本              | 4,450,622,933         | 4,115,082,362         |
| 剰余金             |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,142,805,431         | 966,063,827           |
| （分配準備積立金）       | 555,455,621           | 529,012,243           |
| 元本等合計           | 3,307,817,502         | 3,149,018,535         |
| 純資産合計           | 3,307,817,502         | 3,149,018,535         |
| 負債純資産合計         | 3,343,920,911         | 3,178,542,106         |

## （２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

|                                           | 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日 | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日 |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                      |                                      |
| 受取配当金                                     | 208,851,900                          | 197,109,240                          |
| 有価証券売買等損益                                 | 130,179,478                          | 21,295,470                           |
| 営業収益合計                                    | 339,031,378                          | 218,404,710                          |
| 営業費用                                      |                                      |                                      |
| 支払利息                                      | 8,094                                | 9,285                                |
| 受託者報酬                                     | 546,837                              | 544,694                              |
| 委託者報酬                                     | 16,769,573                           | 16,703,975                           |
| その他費用                                     | 36,405                               | 36,257                               |
| 営業費用合計                                    | 17,360,909                           | 17,294,211                           |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 321,670,469                          | 201,110,499                          |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 321,670,469                          | 201,110,499                          |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 321,670,469                          | 201,110,499                          |
| 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（ ） | 2,208,168                            | 3,693,482                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 1,411,725,279                        | 1,142,805,431                        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 100,011,077                          | 198,570,171                          |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 100,011,077                          | 198,570,171                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 40,870,391                           | 117,686,403                          |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 40,870,391                           | 117,686,403                          |
| 分配金                                       | 109,683,139                          | 101,559,181                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 1,142,805,431                        | 966,063,827                          |

## （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     | 投資信託受益証券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。<br>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。<br>親投資信託受益証券<br>基準価額で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準          | 受取配当金<br>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。<br>有価証券売買等損益<br>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 2月 9日から2021年 8月10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<br>2021年 2月 8日現在                                                          | 当期<br>2021年 8月10日現在                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>4,450,622,933口                                       | 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>4,115,082,362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<br><br>元本の欠損 1,142,805,431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<br><br>元本の欠損 966,063,827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<br>1口当たり純資産額 0.7432円<br>(10,000口当たり純資産額) (7,432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<br>1口当たり純資産額 0.7652円<br>(10,000口当たり純資産額) (7,652円) |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                                                                                                   |                                           |             |  |              |   |             |                                                                                                                   |    |  |  |              |   |             |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|-------------|--|--------------|---|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|-------------|
| 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日                                                                              | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日      |             |  |              |   |             |                                                                                                                   |    |  |  |              |   |             |
| 1. 分配金の計算過程<br>2020年 8月 8日から2020年 9月 7日まで                                                                         | 1. 分配金の計算過程<br>2021年 2月 9日から2021年 3月 8日まで |             |  |              |   |             |                                                                                                                   |    |  |  |              |   |             |
| <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>33,724,650円</td></tr></table> | 項目                                        |             |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 33,724,650円 | <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>32,897,613円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 32,897,613円 |
| 項目                                                                                                                |                                           |             |  |              |   |             |                                                                                                                   |    |  |  |              |   |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                      | A                                         | 33,724,650円 |  |              |   |             |                                                                                                                   |    |  |  |              |   |             |
| 項目                                                                                                                |                                           |             |  |              |   |             |                                                                                                                   |    |  |  |              |   |             |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                      | A                                         | 32,897,613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            | 377,866,741円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 504,030,094円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 915,621,485円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,645,404,958口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 1,971円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H            | 40円            |
| 収益分配金金額                   | I=F×H/10,000 | 18,581,619円    |

2020年 9月 8日から2020年10月 7日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 31,930,164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            | 375,911,258円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 513,217,362円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 921,058,784円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,604,376,529口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,000円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H            | 40円            |
| 収益分配金金額                   | I=F×H/10,000 | 18,417,506円    |

2020年10月 8日から2020年11月 9日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 31,813,371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            | 381,643,152円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 524,454,306円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 937,910,829円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,621,196,679口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,029円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H            | 40円            |
| 収益分配金金額                   | I=F×H/10,000 | 18,484,786円    |

2020年11月10日から2020年12月 7日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 34,206,277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            | 378,917,412円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 529,946,476円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 943,070,165円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,568,084,889口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,064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            | 382,699,725円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 542,279,920円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 957,877,258円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,421,682,902口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,166円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H            | 40円            |
| 収益分配金金額                   | I=F×H/10,000 | 17,686,731円    |

2021年 3月 9日から2021年 4月 7日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 31,360,766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            | 389,476,300円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 531,102,439円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 951,939,505円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,327,846,323口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,199円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H            | 40円            |
| 収益分配金金額                   | I=F×H/10,000 | 17,311,385円    |

2021年 4月 8日から2021年 5月 7日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 30,648,709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            | 379,205,328円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 519,966,043円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 929,820,080円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,163,286,923口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,233円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H            | 40円            |
| 収益分配金金額                   | I=F×H/10,000 | 16,653,147円    |

2021年 5月 8日から2021年 6月 7日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 30,083,430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            | 391,910,574円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 520,863,244円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 942,857,248円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 4,158,974,356口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,267円         |

|                |                       |             |
|----------------|-----------------------|-------------|
| 10,000口当たり分配金額 | H                     | 40円         |
| 収益分配金金額        | $I=F \times H/10,000$ | 18,272,339円 |

2020年12月 8日から2021年 1月 7日まで

| 項目                        |                       |                |
|---------------------------|-----------------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 33,270,166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                     | 378,457,099円   |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 538,934,004円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 950,661,269円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 4,531,099,674口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,098円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 40円            |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 18,124,398円    |

2021年 1月 8日から2021年 2月 8日まで

| 項目                        |                       |                |
|---------------------------|-----------------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 32,637,040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                     | 375,465,283円   |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 540,621,072円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 948,723,395円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 4,450,622,933口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,131円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 40円            |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 17,802,491円    |

|                |                       |             |
|----------------|-----------------------|-------------|
| 10,000口当たり分配金額 | H                     | 40円         |
| 収益分配金金額        | $I=F \times H/10,000$ | 16,635,897円 |

2021年 6月 8日から2021年 7月 7日まで

| 項目                        |                       |                |
|---------------------------|-----------------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 29,214,591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                     | 416,162,019円   |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 520,428,090円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 965,804,700円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 4,202,923,111口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,297円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 40円            |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 16,811,692円    |

2021年 7月 8日から2021年 8月10日まで

| 項目                        |                       |                |
|---------------------------|-----------------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A                     | 28,946,865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                     | 412,717,872円   |
| 分配準備積立金額                  | D                     | 516,525,707円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | $E=A+B+C+D$           | 958,190,444円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F                     | 4,115,082,362口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | $G=E/F \times 10,000$ | 2,328円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H                     | 40円            |
| 収益分配金金額                   | $I=F \times H/10,000$ | 16,460,329円    |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日                                                                                                                              | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10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>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>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なっております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>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>前期</p> <p>2021年 2月 8日現在</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>当期</p> <p>2021年 8月10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>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>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 )

| <p>前期</p> <p>自 2020年 8月 8日</p> <p>至 2021年 2月 8日</p> | <p>当期</p> <p>自 2021年 2月 9日</p> <p>至 2021年 8月10日</p> |
|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|

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

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日 |                | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10日 |                |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------------------|----------------|
| 期首元本額                                | 4,655,755,540円 | 期首元本額                                | 4,450,622,933円 |
| 期中追加設定元本額                            | 142,075,460円   | 期中追加設定元本額                            | 526,221,792円   |
| 期中一部解約元本額                            | 347,208,067円   | 期中一部解約元本額                            | 861,762,363円   |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類        | 前期<br>自 2020年 8月 8日<br>至 2021年 2月 8日 | 当期<br>自 2021年 2月 9日<br>至 2021年 8月10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）                       |
| 投資信託受益証券  | 38,726,392                           | 55,978,446                           |
| 親投資信託受益証券 | 0                                    | 996                                  |
| 合計        | 38,726,392                           | 55,979,442                           |

## 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8月10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8月10日現在)

（単位：円）

| 種類       | 通貨  | 銘柄                                                        | 券面総額    | 評価額           | 備考 |
|----------|-----|-----------------------------------------------------------|---------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | 日本円 | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ－ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPYクラス | 539,974 | 3,102,690,604 |    |

|           |     |                           |           |                        |  |
|-----------|-----|---------------------------|-----------|------------------------|--|
|           | 小計  | 銘柄数：1<br>組入時価比率：98.5%     | 539,974   | 3,102,690,604<br>99.7% |  |
|           | 合計  |                           |           | 3,102,690,604          |  |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 野村マネーインベストメント マ<br>ザーファンド | 9,952,230 | 9,978,105              |  |
|           | 小計  | 銘柄数：1<br>組入時価比率：0.3%      | 9,952,230 | 9,978,105<br>0.3%      |  |
|           | 合計  |                           |           | 9,978,105              |  |
| 合計        |     |                           |           | 3,112,668,709          |  |

(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）

「ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり」および「ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし」は「野村マネーインベストメント 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。

## 野村マネーインベストメント マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

(2021年 8月10日現在)

|                 |            |
|-----------------|------------|
| 資産の部            |            |
| 流動資産            |            |
| コール・ローン         | 9,227,378  |
| 国債証券            | 1,000,123  |
| 特殊債券            | 10,021,032 |
| 未収利息            | 18,221     |
| 流動資産合計          | 20,266,754 |
| 資産合計            | 20,266,754 |
| 負債の部            |            |
| 流動負債            |            |
| 未払利息            | 8          |
| 流動負債合計          | 8          |
| 負債合計            | 8          |
| 純資産の部           |            |
| 元本等             |            |
| 元本              | 20,213,480 |
| 剰余金             |            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 53,266     |
| 元本等合計           | 20,266,746 |
| 純資産合計           | 20,266,746 |
| 負債純資産合計         | 20,266,754 |

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                        |                                                                                                                       |
|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法     | 国債証券、特殊債券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。                                                 |
| 2. 費用・収益の計上基準          | 有価証券売買等損益<br>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。 |

## （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 8月10日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.0026円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (10,026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 2月 9日<br>至 2021年 8月10日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、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>○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 8月10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、特殊債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月10日現在

|                                  |             |
|----------------------------------|-------------|
| 期首                               | 2021年 2月 9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 | 20,014,038円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 199,442円    |
| 同期中における一部解約元本額                   | 0円          |
| 期末元本額                            | 20,213,480円 |
| 期末元本額の内訳*                        |             |
| ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり             | 9,952,230円  |
| ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし             | 9,952,230円  |
| ダブル・ブレイン                         | 99,612円     |
| ノムラ日本株ベータヘッジ戦略ファンド（SMA専用）        | 9,966円      |
| ダブル・ブレイン（マイルド）                   | 99,721円     |
| ダブル・ブレイン（ブル）                     | 99,721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8月10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8月10日現在)

(単位:円)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                          | 券面総額       | 評価額        | 備考   |
|------|-----|-----------------------------|------------|------------|------|
| 国債証券 | 日本円 | 国庫短期証券 第998回                | 1,000,000  | 1,000,123  |      |
|      | 小計  | 銘柄数: 1<br>組入時価比率: 4.9%      | 1,000,000  | 1,000,123  | 9.1% |
|      | 合計  |                             |            | 1,000,123  |      |
| 特殊債券 | 日本円 | 政保 地方公共団体金融機構債券<br>(8年) 第2回 | 10,000,000 | 10,021,032 |      |

|  |    |                       |            |                     |  |
|--|----|-----------------------|------------|---------------------|--|
|  | 小計 | 銘柄数：1<br>組入時価比率：49.4% | 10,000,000 | 10,021,032<br>90.9% |  |
|  | 合計 |                       |            | 10,021,032          |  |
|  | 合計 |                       |            | 11,021,155          |  |

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

#### ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり

2021年8月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 19,806,549,073円 |
| 負債総額           | 189,711,345円    |
| 純資産総額（ - ）     | 19,616,837,728円 |
| 発行済口数          | 20,558,249,158口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.9542円         |

#### ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし

2021年8月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 3,205,118,623円 |
| 負債総額           | 21,038,068円    |
| 純資産総額（ - ）     | 3,184,080,555円 |
| 発行済口数          | 4,125,743,248口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.7718円        |

#### （参考）野村マネーインベストメント マザーファンド

2021年8月31日現在

|                |             |
|----------------|-------------|
| 資産総額           | 20,266,241円 |
| 負債総額           | 8円          |
| 純資産総額（ - ）     | 20,266,233円 |
| 発行済口数          | 20,213,480口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0026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9月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### (a) 会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

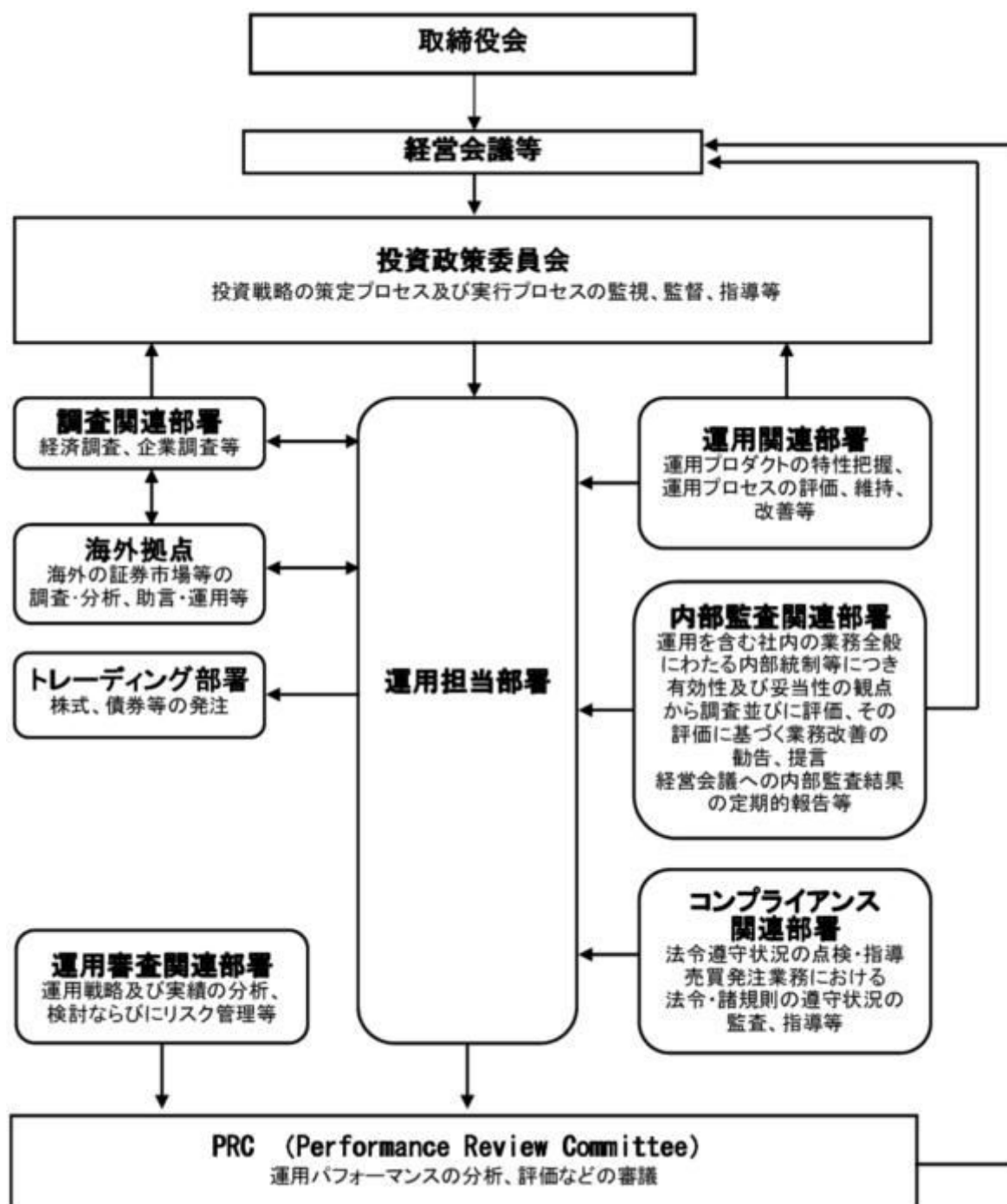
###### 代表取締役・業務執行取締役

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

###### 監査等委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2 事業の内容及び営業の概況

## &lt; 更新後 &gt;

「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8月31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  | 991   | 38,257,481 |
| 単位型株式投資信託  | 196   | 822,500    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 6,278,884  |
| 単位型公社債投資信託 | 503   | 1,622,437  |
| 合計         | 1,704 | 46,981,302 |

### 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

|          |          | 前事業年度<br>(2020年3月31日) | 当事業年度<br>(2021年3月31日) |
|----------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 区分       | 注記<br>番号 | 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 |

|           |          | 前事業年度<br>(2020年3月31日) |        | 当事業年度<br>(2021年3月31日) |        |
|-----------|----------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
| 区分        | 注記<br>番号 | 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      |          |                       | 85,270 |                       | 87,596 |
| 資本金       |          |                       | 17,180 |                       | 17,180 |
| 資本剰余金     |          |                       | 13,729 |                       | 13,729 |
| 資本準備金     |          | 11,729                |        | 11,729                |        |
| その他資本剰余金  |          | 2,000                 |        | 2,000                 |        |
| 利益剰余金     |          |                       | 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

|           |          | 前事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |         | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |         |
|-----------|----------|----------------------------------------|---------|----------------------------------------|---------|
| 区分        | 注記<br>番号 | 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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |        | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |        |
|--------------|----------|----------------------------------------|--------|----------------------------------------|--------|
| 区分           | 注記<br>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<br>資本<br>合計 |
|-------|--------|-----------|------------------|-----------------|-----------|---------------|---------------------|-----------------|----------------|
|       | 資本金    | 資本剰余金     |                  |                 | 利益剰余金     |               |                     |                 |                |
|       |        | 資本<br>準備金 | その他<br>資本<br>剰余金 | 資本<br>剰余金<br>合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金      |                     | 利益<br>剰余金<br>合計 |                |
|       |        |           |                  |                 |           | 別<br>途<br>積立金 | 繰<br>越<br>利益<br>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<br>資 本<br>合 計 |
|---------------------------------|--------|------------|-------------------|-------------------|------------|------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                                 | 資本金    | 資本剰余金      |                   |                   | 利益剰余金      |            |                   |                   |                   |
|                                 |        | 資 本<br>準備金 | その他<br>資 本<br>剰余金 | 資 本<br>剰余金<br>合 計 | 利 益<br>準備金 | その他利益剰余金   |                   | 利 益<br>剰余金<br>合 計 |                   |
|                                 |        |            |                   |                   |            | 別 途<br>積立金 | 繰 越<br>利 益<br>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<br>の項目の当期<br>変動額（純<br>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<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |        |
| 当期末残高                       | 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<br>の当期変動額（純<br>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<br/>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<br/>(評価差額は全部純資産直入法により処理し、<br/>売却原価は移動平均法により算定しております。)<br/>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<br/>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。<br/>主な耐用年数は以下の通りであります。<br/> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>建物</div> <div>6年</div> </div> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>附属設備</div> <div>6～15年</div> </div> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>器具備品</div> <div>4～15年</div> </div> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産<br/>定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> |
| 4．引当金の計上基準         | <p>(1) 貸倒引当金<br/>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<br/>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</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>確定給付型企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。</p> <p>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</p> <p>時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>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す。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

## (1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

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

## 損益計算書関係

| 前事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
|----------------------------------------|----------------------------------------|

|                                                                       |                                                                       |
|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|
| 1. 関係会社に係る注記<br>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。<br>受取配当金 4,931百万円 | 1. 関係会社に係る注記<br>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。<br>受取配当金 4,334百万円 |
| 2. 固定資産除却損<br>器具備品 7百万円<br>ソ フ ト ウ エ 59<br>ア<br>合計 67                 | 2. 固定資産除却損<br>器具備品 2百万円<br>ソ フ ト ウ エ 102<br>ア<br>合計 105               |

## 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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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 |        |             |              |      |
| その他有価証券      | 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．その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

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<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(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</p> <p>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<br>(2020年3月31日)                         |       | 当事業年度末<br>(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<br>至 2020年3月31日 | 自        | 2020年4月 1日<br>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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との<br>関係                                   | 取引の内容                 | 取引<br>金額<br>(百万円) | 科目       | 期末<br>残高<br>(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<br>(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<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1) | 31,378            | 未払手数料    | 5,536             |
|         |          |        |                 |       |                    |                                                 | コマーシャル・ペーパーの購入(*2)    | 20,000            | 有価証券     | 19,999            |
|         |          |        |                 |       |                    |                                                 | 有価証券受取利息              | 0                 | その他営業外収益 | 0                 |

## （エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## （１）親会社情報

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

## （２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                       | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円) | 科目       | 期末残高<br>(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<br>(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<br>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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日)        |            | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>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                            |            | 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳                            |            |
| 該当事項はありません。                                   |            | 該当事項はありません。                                   |            |
| 普通株式の期中平均株式数                                  | 5,150,693株 | 普通株式の期中平均株式数                                  | 5,150,693株 |

## 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 <sup>*</sup> | (c) 事業の内容                                                  |
|--------------------------------------------|------------------------|------------------------------------------------------------|
| 三井住友信託銀行株式会社<br>(再信託受託者：株式会社日本カスト<br>ディ銀行) | 342,037百万円             | 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8月末現在

## (2) 販売会社

| (a)名称                                                                   | (b)資本金の額 <sup>*</sup>                                               | (c)事業の内容                            |
|-------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|
| 北洋証券株式会社<br>三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー<br>証券株式会社                                   | 500百万円<br>40,500百万円                                                 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融<br>商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社東京スター銀行<br>株式会社北洋銀行<br>三井住友信託銀行株式会社<br>株式会社三菱ＵＦＪ銀行<br>三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 | 26,000百万円<br>121,101百万円<br>342,037百万円<br>1,711,958百万円<br>324,279百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。                  |

\* 2021年8月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2021年9月17日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

## 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」に掲げられているノルディック社債ファンド 為替ヘッジありの2021年2月9日から2021年8月10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、ノルディック社債ファンド 為替ヘッジありの2021年8月10日現在の信託財産の状況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9月17日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

## 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」に掲げられているノルディック社債ファンド 為替ヘッジなしの2021年2月9日から2021年8月10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、ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなしの2021年8月10日現在の信託財産の状況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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 亀井 純子 |
|--------------------|-------|-------|

|                    |       |        |
|--------------------|-------|--------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 津村 健二郎 |
|--------------------|-------|--------|

|                    |       |         |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 水 永 真太郎 |
|--------------------|-------|---------|

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の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。