

**【表紙】**

|            |                                            |
|------------|--------------------------------------------|
| 【提出書類】     | 有価証券報告書                                    |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿                                    |
| 【提出日】      | 2021年10月15日提出                              |
| 【計算期間】     | 第32特定期間(自 2021年1月21日至 2021年7月20日)          |
| 【ファンド名】    | マイストーリー分配型（年6回）Aコース<br>マイストーリー分配型（年6回）Bコース |
| 【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                                      |
| 【連絡場所】     | 東京都江東区豊洲二丁目2番1号                            |
| 【電話番号】     | 03-6387-5000                               |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                                |

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

[1]世界の債券、国内の株式および世界の株式を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とし、インカムゲイン(利子・配当等収益)と中長期的な値上がり益の獲得によるトータル・リターンの追求を目指して運用を行ないます。

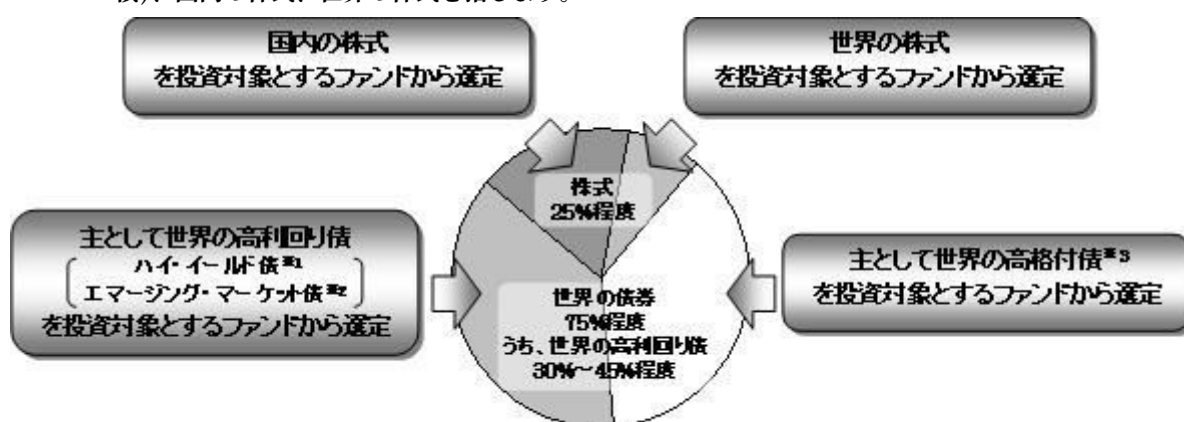
[2]野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社（NFR&T）<sup>(注)</sup>が行なう投資信託証券の評価等による助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案し、運用において優れていると判断した投資信託証券に分散投資を行なうことを基本とします。

（注）2021年12月1日付で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（NFR）に商号変更する予定です。

◆運用にあたっては、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社（NFR&T）の助言に基づ

き、各資産クラス<sup>※</sup>から選定したファンドに分散投資を行ないます。

※当ファンドにおいては、世界の高格付債、世界の高利回り債（ハイ・イールド債、エマージング・マーケット債）、国内の株式、世界の株式を指します。



※1 「ハイ・イールド債」とは、債券などの格付機関(S&P社、ムーディーズ社など)によって格付される債券の信用度でBB格以下に格付されている事業債をいいます。

※2 「エマージング・マーケット債」とは、エマージング・カントリー(いわゆる先進工業国や最貧国などを除く諸国で、一般に新興経済国、発展途上国、中所得国および低所得国などと認識される国々)の政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券をいいます。

※3 「高格付債」とは、債券などの格付機関(S&P社、ムーディーズ社など)によって格付される債券の信用度でBBB格以上に格付されている債券をいいます。

[3]年6回の決算時に分配を行なうことを基本とします。

◆ファンドは、年6回(原則として1、3、5、7、9、11月の各20日、同日が休業日の場合は翌営業日)に決算・分配を行なうことを基本とします。

[4]為替変動リスクをヘッジ(軽減)するAコースと、ヘッジしないBコースがあり、A/Bコース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては「Aコース」もしくは「Bコース」のどちらか一方のみのお取り扱いとなる場合、スイッチングのお取り扱いを行なわない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

指定投資信託証券は、ファミリーファンド方式<sup>※</sup>で運用するもの、直接有価証券等に投資するものがあります。

※ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみです。

指定投資信託証券の名称については、後述の「2 投資方針 (2)投資対象」をご覧ください。

指定投資信託証券の名称について「(適格機関投資家専用)」の部分を省略して記載する場合があります。

## ■信託金の限度額■

受益権の信託金限度額は、各々3兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

## <商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に網掛け表示しております。

(マイストーリー分配型（年6回）Aコース）

### 《商品分類表》

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
| 単位型     | 国 内    | 株 式               |
|         |        | 債 券               |
|         | 海 外    | 不動産投信             |
| 追加型     | 内 外    | その他資産<br>( )      |
|         |        | 資産複合              |

### 《属性区分表》

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|--------|------|--------|------|-------|
|--------|------|--------|------|-------|

|                                                              |                     |                          |                     |                       |
|--------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株                                      | 年1回                 | <b>グローバル<br/>(日本を含む)</b> |                     |                       |
|                                                              | 年2回                 | 日本                       |                     |                       |
|                                                              | 年4回                 | 北米                       | ファミリーファンド           | <b>あり<br/>(フルヘッジ)</b> |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( )              | <b>年6回<br/>(隔月)</b> | 欧州                       |                     |                       |
|                                                              | 年12回<br>(毎月)        | アジア                      |                     |                       |
|                                                              | 日々                  | オセアニア                    |                     |                       |
| 不動産投信                                                        | その他<br>( )          | 中南米                      | <b>ファンド・オブ・ファンズ</b> | なし                    |
| <b>その他資産<br/>(投資信託証券<br/>(資産複合<br/>(株式、債券)<br/>資産配分固定型))</b> |                     | アフリカ                     |                     |                       |
|                                                              |                     | 中近東<br>(中東)              |                     |                       |
| 資産複合<br>( )                                                  |                     | エマージング                   |                     |                       |
| 資産配分固定型<br>資産配分変更型                                           |                     |                          |                     |                       |

当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズです。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

（マイストーリー分配型（年6回）Bコース）

《商品分類表》

| 単位型・追加型    | 投資対象地域     | 投資対象資産<br>(収益の源泉) |
|------------|------------|-------------------|
| 単位型        | 国 内        | 株 式               |
|            |            | 債 券               |
|            | 海 外        | 不動産投信             |
| <b>追加型</b> | <b>内 外</b> | その他資産<br>( )      |
|            |            | <b>資産複合</b>       |

《属性区分表》

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|--------|------|--------|------|-------|
|--------|------|--------|------|-------|

|                                                                                      |                           |                                |                     |           |
|--------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|--------------------------------|---------------------|-----------|
| 株式                                                                                   | 年1回                       | <b>グローバル</b><br><b>(日本を含む)</b> |                     |           |
| 一般                                                                                   | 年2回                       |                                |                     |           |
| 大型株                                                                                  |                           | 日本                             |                     |           |
| 中小型株                                                                                 | 年4回                       | 北米                             | ファミリーファンド           | あり<br>( ) |
| 債券                                                                                   | <b>年6回</b><br><b>(隔月)</b> | 欧州                             |                     |           |
| 一般                                                                                   |                           | アジア                            |                     |           |
| 公債                                                                                   | 年12回<br>(毎月)              | オセアニア                          |                     |           |
| 社債                                                                                   | 日々                        | 中南米                            | <b>ファンド・オブ・ファンズ</b> | <b>なし</b> |
| その他債券                                                                                | その他<br>( )                | アフリカ                           |                     |           |
| クレジット属性<br>( )                                                                       |                           | 中近東<br>(中東)                    |                     |           |
| 不動産投信                                                                                |                           | エマージング                         |                     |           |
| <b>その他資産</b><br><b>(投資信託証券</b><br><b>(資産複合</b><br><b>(株式、債券)</b><br><b>資産配分固定型))</b> |                           |                                |                     |           |
| 資産複合<br>( )                                                                          |                           |                                |                     |           |
| 資産配分固定型                                                                              |                           |                                |                     |           |
| 資産配分変更型                                                                              |                           |                                |                     |           |

当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズです。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

◆一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（2013年2月21日現在）

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

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

##### [投資対象地域による区分]

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

##### [投資対象資産による区分]

- (1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資

信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

〔独立した区分〕

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

〔補足分類〕

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

＜属性区分表定義＞

〔投資対象資産による属性区分〕

株式

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

債券

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

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

〔決算頻度による属性区分〕

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

〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

- (1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

## [為替ヘッジによる属性区分]

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

## [インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数…上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

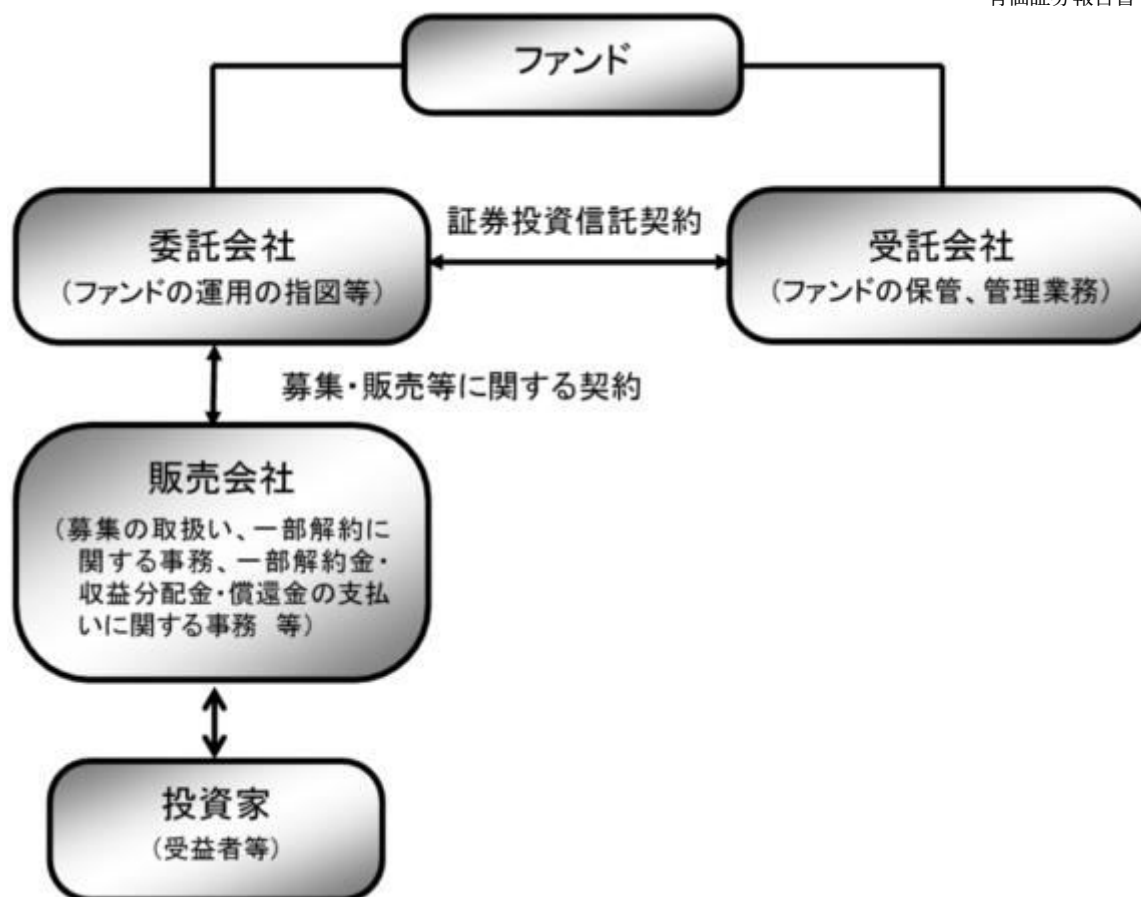
## [特殊型]

- (1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## (2) 【ファンドの沿革】

2005年5月30日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



| ファンド      | マイストーリーリー分配型(年6回)<br>Aコース | マイストーリーリー分配型(年6回)<br>Bコース |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 委託会社(委託者) | 野村アセットマネジメント株式会社          |                           |
| 受託会社(受託者) | 野村信託銀行株式会社                |                           |

- ファンドは、複数の投資信託証券（ファンド）を投資対象とするファンド・オブ・ファンズです。



#### ■委託会社の概況(2021年8月末現在)■

##### ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

##### ・資本金の額

17,180百万円

##### ・会社の沿革



1959年12月1日 野村證券投資信託委託株式会社として設立

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

2000年11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

[1]主として、世界の債券<sup>※</sup>を実質的な投資対象とする投資信託証券、国内の株式を実質的な投資対象とする投資信託証券および世界の株式を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資し、インカムゲイン(利子・配当等収益)と中長期的な値上がり益の獲得によるトータル・リターンの追求を目指して運用を行います。

※国債、政府機関債、地方債、国際機関債、社債など。世界の高利回り事業債(以下「ハイ・イールド債」)およびエマージング・カントリーの政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券(以下「エマージング・マーケット債」)を含みます。

[2]野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社(NFR&T)<sup>(注)</sup>が行なう投資信託証券の評価等による助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案し、運用において優れていると判断した投資信託証券に分散投資を行ないます。

(注) 2021年12月1日付で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(NFRC)に商号変更する予定です。

◆投資信託証券への投資にあたっては、指定投資信託証券の中から、定性評価、定量評価等を勘案して選択した投資信託証券に分散投資を行なうことを基本とします。

なお、組入投資信託証券については適宜見直しを行ないます。

[3]投資信託証券への投資は、高位を維持することを基本とします。また、投資信託証券への投資を通じて実質的に保有する株式への配分比率が信託財産の純資産総額の概ね25%程度となることを目指とします。

◆投資信託証券への投資を通じて実質的に保有する株式(当該投資信託証券が実質的に保有する株式を勘案します。)への配分比率が信託財産の純資産総額の概ね25%程度となることを目指として投資信託証券への投資を行なうことを基本とします。

◆また、投資信託証券への投資を通じて実質的に保有するハイ・イールド債およびエマージング・マーケット債(当該投資信託証券が実質的に保有するハイ・イールド債およびエマージング・マーケット債を勘案します。)への配分比率が信託財産の純資産総額の概ね30%～45%程度となることを目指として投資信託証券への投資を行なうことを基本とします。

[4]資産クラスもしくは債券の種別毎の代表的な指数を委託会社が独自に合成した指数をベンチマークとします。

| 資産クラス・債券種別    | 指数                                                                                                                       | 比率     |
|---------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| 国内株式          | 東証株価指数（TOPIX）                                                                                                            | 17.0%  |
| 外国株式          | MSCI KOKUSAI インデックス                                                                                                      | 8.0%   |
| 米国債券          | ブルームバーグ・米国総合インデックス                                                                                                       | 7.5%   |
| 欧州債券          | ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス                                                                                                      | 22.5%  |
| 豪州債券          | ブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス                                                                                                  | 7.5%   |
| ハイ・イールド債      | ICE BofA Global High Yield Constrained Index                                                                             | 18.75% |
| エマージング・マーケット債 | JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバルおよび 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を80%:20%の比率で委託会社が独自に合成した指数 | 18.75% |

◆Aコースのベンチマークの計算にあたっては、上記各指数を委託会社が為替ヘッジコストを考慮して円換算した指数(以下「円ヘッジベース」といいます。)を用います。

◆Bコースのベンチマークの計算にあたっては、上記各指数を委託会社が円換算した指数(以下「円換算ベース」といいます。)を用います。

「ICE BofA Global High Yield Constrained Index」の円ヘッジベース、円換算ベースの算出にあたっては、委託会社においてICE Data Indices, LLCが算出する指数に基づき、指数構成国の各通貨建てのハイ・イールド・コンストレインド・インデックスもしくはハイ・イールド・インデックスを用いて、組入資産・為替の評価時点やヘッジコスト等を考慮して独自に合成しています。

※ICE BofA Global High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLCが算出する、米国ドル、カナダドル、英ポンド、ユーロ建てで発行されたハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表す代表的な指数で、同一発行体の発行するハイ・イールド・ボンドの指数に占める構成比率を2%に制限した指数です。

※その他の指数・インデックスについては、後述の(参考)指定投資信託証券について「ベンチマークについて」をご覧ください。

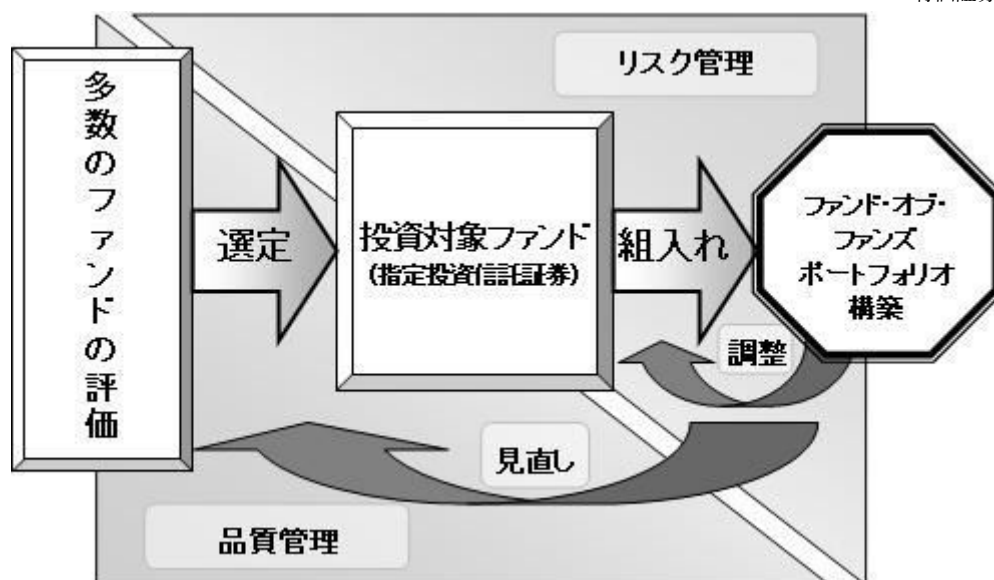
[5]投資対象ファンドの選定やポートフォリオ構築に際しては、定性評価を重視し、ファンド間の投資手法の違いにも着目して、幅広い収益機会を追求できるよう、配慮します。

[6]投資対象ファンドとファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、継続的に投資比率を調整し

ます。また、投資対象ファンドを適宜見直すことで、全体的な品質<sup>※</sup>の維持・向上を目指します。

※運用体制、運用プロセス、情報開示等の観点から、定性的に評価するファンドの期待度・信頼度をいいます。

[ファンド・オブ・ファンズの運用プロセス(イメージ図)]



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。

(参考)野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社（NFR&T）について

◆野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社(NFR&T)は、投資信託、年金運用機関、オルタナティブ(代替)投資商品など、様々な運用商品・運用機関の分析・評価を主たる業務とする、野村グループの投資顧問会社です。

## (2) 【投資対象】

主として有価証券に投資する投資信託証券<sup>※</sup>を主要投資対象とします。

※投資信託の受益証券(投資法人の投資証券を含みます。)とします。

各ファンドが投資する投資信託証券のうち、世界の債券に実質的に投資する投資信託証券および世界の株式に実質的に投資する投資信託証券については、外貨建資産の為替ヘッジ方針について、各々以下のものに限定することを基本とします。

### 【Aコース（為替ヘッジ付き）】

- 実質的な外貨建資産について、為替ヘッジを行なうことを基本とするもの。
- 実質的な外貨建資産の通貨配分の如何に関わらず、原則として当該投資信託または当該投資信託が組入れるマザーファンドのベンチマークの通貨配分をベースに対円での為替ヘッジを行なうことを基本とするもの。
- 上記に類するもの。

### 【Bコース（為替ヘッジなし）】

- 実質的な外貨建資産について、為替ヘッジを行わないことを基本とするもの。
- 上記に類するもの。

なお、デリバティブの直接利用は行ないません。

※後述の指定投資信託証券は2021年10月15日現在の一覧です。今後、記載上の指定投資信託証券の一部が、名称変更となる場合、または繰上償還等により指定投資信託証券から除外される場合、あるいは、ここに記載された以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加となる場合があります。

※後述の指定投資信託証券のうち、同一行にある指定投資信託証券(例えば「グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF（適格機関投資家専用）」と「グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドFB（適格機関投資家専用）」)は、為替ヘッジ方針が異なるのみで、その他の実質的な運用方針は基本的に同一のものです。これら二つの指定投資信託証券をまとめて、例えば「グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF／FB（適格機関投資家専用）」と表記する場合があります。

為替ヘッジ、収益分配方針については以下の通りとなります。

|      | Aコース    | Bコース    |
|------|---------|---------|
|      | 為替ヘッジあり | 為替ヘッジなし |
| 分配なし | F       | FB      |
| 分配あり | FC      | FD      |

各ファンドは、以下に示す投資信託証券(以下「指定投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。

| Aコースの指定投資信託証券                           | Bコースの指定投資信託証券                            |
|-----------------------------------------|------------------------------------------|
| ノムラ・ジャパン・オープンF（適格機関投資家専用）               |                                          |
| ストラテジック・バリュー・オープンF（適格機関投資家専用）           |                                          |
| ノムラT&D J Flag日本株 F（適格機関投資家専用）           |                                          |
| シュローダー日本ファンドF（適格機関投資家専用）                |                                          |
| 日本フォーカス・グロースF（適格機関投資家専用）                |                                          |
| SJAMバリュー日本株F（適格機関投資家専用）                 |                                          |
| One国内株オープンF（FOFs用）（適格機関投資家専用）           |                                          |
| スパークス・厳選投資・日本株ファンドF（適格機関投資家専用）          |                                          |
| コムジェスト ジャパンエクイティファンドF（適格機関投資家専用）        |                                          |
| アムンディ・ターゲット・ジャパン・ファンドF（適格機関投資家専用）       |                                          |
| グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF（適格機関投資家専用）      | グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドFB（適格機関投資家専用）      |
| 野村DFA海外株式バリューファンドF（適格機関投資家専用）           | 野村DFA海外株式バリューファンドFB（適格機関投資家専用）           |
| サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）F（適格機関投資家専用）       | サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）FB（適格機関投資家専用）       |
| ウィリアム・ブレア・グローバル・リーダーズ（除く日本）F（適格機関投資家専用） | ウィリアム・ブレア・グローバル・リーダーズ（除く日本）FB（適格機関投資家専用） |
| ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）         | ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドFB（適格機関投資家専用）         |
| MFS欧州株ファンドF（適格機関投資家専用）                  | MFS欧州株ファンドFB（適格機関投資家専用）                  |
| ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドF（適格機関投資家専用）        | ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドFB（適格機関投資家専用）        |
| ノムラ・ワールド（除く日本）エクイティ・ファンドF＜外国籍投資信託＞      | ノムラ・ワールド（除く日本）エクイティ・ファンドFB＜外国籍投資信託＞      |
| ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FC（適格機関投資家専用）       | ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FD（適格機関投資家専用）        |
| ノムラAMP豪州債券ファンドFC（適格機関投資家専用）             | ノムラAMP豪州債券ファンドFD（適格機関投資家専用）              |
| NPEBパン・ヨーロピアン・ボンド・ファンドFC＜外国籍投資信託＞       | NPEBパン・ヨーロピアン・ボンド・ファンドFD＜外国籍投資信託＞        |
| LM・米国債券コア・プラスFC（適格機関投資家専用）              | LM・米国債券コア・プラスFD（適格機関投資家専用）               |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－米国債券FC＜外国籍投資信託＞  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－米国債券FD＜外国籍投資信託＞   |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－欧州債券FC＜外国籍投資信託＞  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－欧州債券FD＜外国籍投資信託＞   |

|                                                     |                                                     |
|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－<br>米国ハイ・イールド・ボンドFC＜外国籍投資信託＞ | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－<br>米国ハイ・イールド・ボンドFD＜外国籍投資信託＞ |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIV－<br>欧州ハイ・イールド・ボンドFC＜外国籍投資信託＞ | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIV－<br>欧州ハイ・イールド・ボンドFD＜外国籍投資信託＞ |
| 野村エマージング債券ファンドFC（適格機関投資家専用）                         | 野村エマージング債券ファンドFD（適格機関投資家専用）                         |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－<br>新興国債券FC＜外国籍投資信託＞         | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－<br>新興国債券FD＜外国籍投資信託＞         |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－<br>新興国現地通貨建債券FC＜外国籍投資信託＞    | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－<br>新興国現地通貨建債券FD＜外国籍投資信託＞    |

### ①投資の対象とする資産の種類(約款第20条)

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

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

### ②有価証券の指図範囲(約款第21条第1項)

委託者は、信託金を、主として別に定める投資信託証券(以下「指定投資信託証券」といいます。)のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くものとし、本邦通貨表示のものに限り、)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、)

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。

### ③金融商品の指図範囲(約款第21条第2項)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(上記「(2)投資対象②有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

**(参考)指定投資信託証券について**

以下はファンドが投資を行なう投資信託証券(以下「指定投資信託証券」といいます。 )の投資方針、関係法人、信託報酬等について、2021年10月15日現在で委託会社が知りうる情報等を基に記載したものです(個別に時点の記載がある場合を除きます。 )。

今後、指定投資信託証券の各委託会社(運用会社)の都合等により、記載の内容が変更となる場合があります。

また、ここに記載した指定投資信託証券は上記日付現在のものであり、今後、繰上償還等により指定投資信託証券から除外される場合、あるいは、ここに記載された以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加となる場合等があります。

投資の基本方針のうち＜収益分配方針＞につきましては、以下の通りです。

**[各F／FB]**

- ・運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

**[各FC／FD]**

- ・各投資信託証券により異なります。

詳しくは、各投資信託証券の「(E)投資方針等 (4)収益分配方針」をご覧ください。

※指定投資信託証券の名称について、「(適格機関投資家専用)」の部分を省略して記載する場合があります。

また、「ファンド」という場合があります。

※指定投資信託証券の一部の受託会社について、信託事務処理の一部を他の信託銀行に再信託する場合があります。

**ノムラ・ジャパン・オープンF (適格機関投資家専用)****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるノムラ・ジャパン・オープン マザーファンドへの投資を通じて、主としてわが国の株式に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、当面、TOPIXをベンチマークとします。

ファンドは、「ノムラ・ジャパン・オープン マザーファンド」(「マザーファンド」といいます。)を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、直接株式に投資する場合があります。

**(B) 信託期間**

無期限 (2001年8月28日設定)

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係   | 名称               |
|------|------------------|
| 委託会社 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社       |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.74%の率を乗じて得た額とします。上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等**

**(1) 投資対象**

わが国の株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①運用については、ボトムアップ・アプローチをベースとしたアクティブ運用を行ないます。
- ②わが国の株式への投資にあたっては、上場株式および店頭登録銘柄の中から、株価の割安性をベースに企業の収益性、成長性、安定性等を総合的に勘案して銘柄を選定し、投資を行なうことを基本とします。なお、一部、アジア諸国の株式に投資を行なう場合があります。
- ③株式の実質組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行なう場合があります。
- ④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もあります。

**(3) 主な投資制限**

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ③外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。
- ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑤同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑧一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。
- ⑨一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。

**ストラテジック・バリュー・オープンF（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるストラテジック・バリュー・オープン マザーファンドへの投資を通じて、主としてわが国の株式に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「ストラテジック・バリュー・オープン マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。

**(B) 信託期間**

無期限（2007年10月11日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係   | 名称               |
|------|------------------|
| 委託会社 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社     |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.60%の率を乗じて得た額とします。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等**



**(1) 投資対象**

わが国の株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①株式への投資にあたっては、わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）している株式の中から、資産・利益等に比較して株価が割安と判断され、今後の株価上昇が期待できる銘柄を厳選し、投資を行なうことを基本とします。
- ②株式の実質的な組入にあたっては、フルインベストメントを基本とします。非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。ただし、投資環境、資金動向などを勘案して、運用担当者が適切と判断した際等には先物取引の利用も含めて株式組入比率を引き下げることがあります。
- ③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) 主な投資制限**

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑤同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑧投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑨一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。
- ⑩一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。

**ノムラーT&D J Flag日本株 F (適格機関投資家専用)****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるノムラーT&D J Flag日本株 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、主としてわが国の株式に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「ノムラーT&D J Flag日本株 マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、直接株式に投資する場合があります。

**(B) 信託期間**

無期限（2016年10月13日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係             | 名称                 |
|----------------|--------------------|
| 委託会社           | 野村アセットマネジメント株式会社   |
| 受託会社           | 野村信託銀行株式会社         |
| マザーファンドの投資顧問会社 | T&D アセットマネジメント株式会社 |

**(D) 管理報酬等**



信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年1.0%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬の中の委託会社が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

わが国の株式を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ① 株式への実質的な投資にあたっては、主として個別企業の調査・分析等を中心とした「ボトムアップアプローチ」に基づいて、個別銘柄選定、ポートフォリオの構築等を行なうことを基本とします。
- ② 株式の実質組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。ただし、市況動向等を勘案して、委託者が適切と判断した際には先物取引等の活用も含めて株式組入比率を引き下げることがあります。
- ③ T&Dアセットマネジメント株式会社にマザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限の一部を委託します。
- ④ 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) 主な投資制限

- ① 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ④ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

## シュローダー日本ファンドF (適格機関投資家専用)

### (A) ファンドの特色

ファンドは、親投資信託であるシュローダー日本マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ファンドは、TOPIX（東証株価指数）をベンチマークとします。ファンドのベンチマークは、株式市場の構造変化等によっては見直す場合があります。

### (B) 信託期間

無期限（2015年4月9日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係   | 名称                         |
|------|----------------------------|
| 委託会社 | シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社               |

### (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に税抜年0.74%を乗じて得た額とします。上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等および信託事務の諸費用（監査費用を含みます）を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

主として、シュローダー日本ファンドF（適格機関投資家専用）と実質的に同一の運用の基本方針を有する親投資信託であるシュローダー日本マザーファンド受益証券に投資し、信託財産の成長を目指します。なお、直接株式に投資する場合があります。

**(2) 投資態度**

- ①マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式に投資し、信託財産の成長を目的として、積極的な運用を行います。
- ②運用にあたっては、TOPIX（東証株価指数）をベンチマークとします。
- ③株式への投資にあたっては、企業業績、収益成長力、市場性、株価水準等を勘案し、中長期的に成長性が見込める銘柄を中心に投資を行う予定です。
- ④株式等の実質組入比率については原則としてフルインベストメントで積極的な運用を行います。
- ⑤株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ⑥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) 主な投資制限**

- ①株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ②デリバティブの直接利用は行いません。
- ③投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外貨建資産への投資は行いません。
- ⑤一般社団法人投資信託協会の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取引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、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

**日本フォーカス・グロースF（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託である日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券への投資を通じて、主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行い、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。

ファンドは、マザーファンドを親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。

**(B) 信託期間**

原則として無期限（2020年4月9日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                    | 名称                                           |
|-----------------------|----------------------------------------------|
| 委託会社                  | ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社                  |
| 受託会社                  | みずほ信託銀行株式会社                                  |
| ファンドおよびマザーファンドの投資顧問会社 | ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッド |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.65%の率を乗じて得た額とします。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。その他、信託財産に係る監査費用等として信託財産の純資産総額に対して年率0.10%を上限として信託財産から支払います（なお、当該率については、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、信託の設定時または期中に、随時かかる諸費用の定率を見直し、年率0.10%を上限として変更する場合があります。）

## (Ⅷ) 投資方針等

### (1) 投資対象

日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入比率を引き下げる場合もあります。）。
- ②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。
- ③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。
- ④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。
- ⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。
- ⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

### (3) 主な投資制限

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が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ないものとします。
- ⑨一般社団法人投資信託協会の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取引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%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## SJAMバリュー日本株F (適格機関投資家専用)

### (A) ファンドの特色

ファンドは、親投資信託であるSJAMバリュー日本株・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に実質的に投資を行い、信託財産の長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。

独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスク管理を行いつつ最適なポートフォリオを構築し、「東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。

ファンドは、SJAMバリュー日本株・マザーファンドを親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、わが国の株式に直接投資する場合があります。

## (B) 信託期間

無期限 (2017年4月12日設定)

## (C) ファンドの関係法人

| 関係   | 名称                  |
|------|---------------------|
| 委託会社 | SOMPOアセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社          |

## (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.50%の率を乗じて得た額とします。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

**(1) 投資対象**

わが国の株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① SJAMバリュー日本株・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式へ投資し、信託財産の長期的な成長を目指して、積極的な運用を行います。なお、わが国の株式に直接投資する場合があります。
- ② 独自の調査分析に基づいて算出した理論株価と市場価格を比較し、割安となっている銘柄に投資することを基本にリスク管理を行いつつ最適なポートフォリオを構築し、「東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)」を中長期的に上回る運用成果を目指します。
- ③ 株式 (他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式を含みます。) の組入比率は原則として信託財産総額の50%超 (高位に維持) を基本とします。なお、株式以外の資産 (他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。) への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ④ 資金動向、市況動向、その他特殊な状況等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

**(3) 主な投資制限**

- ① 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ④ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑧ 投資信託証券 (親投資信託受益証券および上場投資信託証券等を除きます。) への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑨ 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言います。) の利用は行いません。
- ⑩ 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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

**One国内株オープンF (FOFs用) (適格機関投資家専用)****(A) ファンドの特色**

ファンドは、主として親投資信託であるOne国内株オープンマザーファンドへの投資を通じて、わが国の上場株式に実質的に投資を行い、マクロの投資環境の変化に応じて、その時々で最適と判断される投資スタイルで運用を行います。

ファンドは、「東証株価指数 (TOPIX)」を運用に当たってのベンチマークとし、ベンチマークを上回る投資効果をめざします。

**(B) 信託期間**

無期限 (2019年10月9日設定)

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係   | 名称                |
|------|-------------------|
| 委託会社 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社      |

**(D) 管理報酬等**

純資産総額に対して、税抜年0.61%

<内訳>

委託会社 税抜年0.57%

販売会社 税抜年0.02%

受託会社 税抜年0.02%

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

「One国内株オープンマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の上場株式に実質的に投資します。
- ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。
- ③「東証株価指数（TOPIX）」を運用に当たってのベンチマークとし、ベンチマークを上回る投資効果をめざします。
- ④実質非株式割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ⑤実質外貨建資産割合は、原則として信託財産総額の30%以下とします。
- ⑥ファンドの資金動向、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。
- ⑦当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのように取得させることを目的とするものです。

### (3) 主な投資制限

- ①マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ③マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤一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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## スパークス・厳選投資・日本株ファンドF（適格機関投資家専用）

### (A) ファンドの特色

ファンドは、わが国の上場株式の中から、魅力的なビジネスと卓越した経営陣をあわせ持つ企業を投資対象とします。これらの企業に対して、割安な価格で集中的に投資を行い、長期で保有することを基本とします。

### (B) 信託期間

無期限（2016年10月11日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係   | 名称                    |
|------|-----------------------|
| 委託会社 | スパークス・アセット・マネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社          |

### (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、日々の信託財産の純資産総額に対して税抜年0.74%を乗じて得た額とします。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

### (E) 投資方針等

**(1) 投資対象**

わが国の株式を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所をいいます。以下同じ。）に上場している株式の中から、魅力的なビジネスと卓越した経営陣をあわせ持つ企業を投資対象とします。これらの企業に対して、割安な価格で集中的に投資を行い、長期で保有することを基本とします。
- ②ファンドの資金動向や市況動向等に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準になったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

**(3) 主な投資制限**

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は行いません。
- ③新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑤同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑧投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑨金融商品取引法第2条第20項に定める取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）については、ヘッジ目的に限定して行うものとし、一般社団法人投資信託協会の規則の定めに従い、デリバティブ取引等（デリバティブ取引および新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）の残高に係る想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。
- ⑩一般社団法人投資信託協会の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及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、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

**コムジエスト ジャパンエクイティファンドF（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託である「コムジエスト日本株式マザーファンド」への投資を通じて、日本の株式市場に上場する企業が発行する株式等を中心に投資を行います。

徹底したファンダメンタル分析に基づいて、高い利益成長が期待される企業を中心に個別銘柄を選定し、集中的に投資することで信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

**(B) 信託期間**

無期限（2020年4月9日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                                                                                                                      |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社               | コムジエスト・アセットマネジメント株式会社                                                                                                   |
| 受託会社               | 野村信託銀行株式会社                                                                                                              |
| マザーファンドの<br>投資顧問会社 | コムジエスト・エス・エー<br>＊コムジエスト・エス・エーは当ファンドの運用に当たり、当社（コムジエスト・アセットマネジメント株式会社）から日本市場に上場する企業が発行する株式および新株予約権、不動産投資信託にかかる投資助言を受領します。 |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.65%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬の中の委託会社が受ける報酬から支払われます。上記のほか、ファンドの組入の有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

コムジェスト日本株式マザーファンド（以下「親投資信託」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①主として親投資信託の受益証券への投資を通じて日本株式に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
- ②親投資信託の受益証券への組入比率は、原則として高位を維持することを基本としますが、相場環境によっては親投資信託の組入比率の調整を行います。
- ③有価証券先物取引等を行いません。
- ④有価証券の貸付は行いません。
- ⑤資金動向、投資対象である日本国の非常事態（金融危機、デフォルト、政治体制の変更等）などによる市況動向等、償還の準備に入った場合、信託財産の規模、あるいはやむを得ない事情が発生した場合は、上記の運用が行われないときがあります。

### (3) 主な投資制限

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑥投資信託証券（親投資信託の受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資は行いません。
- ⑧一般社団法人投資信託協会規則に規定す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。

## アムンディ・ターゲット・ジャパン・ファンドF (適格機関投資家専用)

### (A) ファンドの特色

ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目標として積極的な運用を行うことを目指します。

ファンドは、親投資信託であるアムンディ・ターゲット・ジャパン・マザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）への投資を通して、国内株式に分散投資を行うことにより、積極的に収益の獲得を目指します。

ファンドは、「アムンディ・ターゲット・ジャパン・マザーファンド」を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。

### (B) 信託期間

無期限（2004年3月4日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係   | 名称             |
|------|----------------|
| 委託会社 | アムンディ・ジャパン株式会社 |



|      |               |
|------|---------------|
| 受託会社 | 三菱UFJ信託銀行株式会社 |
|------|---------------|

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.85%の率を乗じて得た額とします。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

わが国の金融商品取引所に上場されている株式および金融商品取引所に準ずる市場に上場されている株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①企業の資産価値や収益力等から算出される投資価値と比較した株価の割安度（バリュウ）に着目した銘柄選択を行い、さらに株主価値の増大を図る余力があると思われる銘柄を厳選し投資します。
- ②株式の実質組入比率は原則として高位を保ちます。
- ③資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

**(3) 主な投資制限**

- ①株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%以内とします。
- ③投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。

**グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF／FB（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるグローバル・エクイティ（除く日本）・マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、主として日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。

グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF（「F」といいます。）は、MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジあり)<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、

グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドFB（「FB」といいます。）は、MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

※1 「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2 MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

ファンドは、「グローバル・エクイティ（除く日本）・マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、株式等に直接投資する場合があります。

**(B) 信託期間**

無期限（2009年4月9日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係             | 名称                |
|----------------|-------------------|
| 委託会社           | 野村アセットマネジメント株式会社  |
| 受託会社           | 野村信託銀行株式会社        |
| マザーファンドの投資顧問会社 | GQG・パートナーズ・エルエルシー |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.785%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①株式への投資にあたっては、企業の財務状況および収益性、株式の流動性等の観点から、定量的に投資候補銘柄を選別します。
- ②投資候補銘柄について、個別銘柄のファンダメンタルズ分析に基づき、国・地域や業種の分散を勘案したポートフォリオを構築します。
- ③株式の実質組入比率については、原則として高位を基本とします。
- ④Fの実質組入外貨建資産については、原則として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。
- ⑤FBの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑥GQG・パートナーズ・エルエルシーにマザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限を委託します。
- ⑦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) 主な投資制限

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ④投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑥新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ⑦同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑧同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑨一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。）の利用は行いません。
- ⑩一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DFA海外株式バリュートファンドF/FB（適格機関投資家専用）

### (A) ファンドの特色

ファンドは、親投資信託である野村DFA海外株式バリュートマザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、主として日本を除く世界各国の株式に実質的に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。

### (B) 信託期間

無期限（2020年10月8日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係             | 名称                                                                                                                        |
|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社           | 野村アセットマネジメント株式会社                                                                                                          |
| 受託会社           | 野村信託銀行株式会社                                                                                                                |
| マザーファンドの投資顧問会社 | ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・エル・ピー<br>ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッド<br>ディエフイー・オーストラリア・リミテッド<br>ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・ピーティーイー・リミテッド |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.40%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

日本を除く世界各国の株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①株式への投資にあたっては、企業の収益性および時価総額、株式の割安性等の観点から定量的に投資候補銘柄を選別します。
- ②株式の実質組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ③Fの実質組入外貨建資産については、原則として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。FBの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ④下記投資顧問会社にマザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限を委託します。
  - ・ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・エル・ピー
  - ・ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・リミテッド
  - ・ディエフエー・オーストラリア・リミテッド
  - ・ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズ・ピーティーイー・リミテッド
- ⑤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) 主な投資制限**

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ④投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑥外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑦新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ⑧同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑨同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑩一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。
- ⑪一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。

**サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）F/FB（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるサンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、主として日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。

**(B) 信託期間**

無期限（2021年4月8日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                        |
|--------------------|---------------------------|
| 委託会社               | 野村アセットマネジメント株式会社          |
| 受託会社               | 野村信託銀行株式会社                |
| マザーファンドの<br>投資顧問会社 | サンズ・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シー |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.65%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①株式への投資にあたっては、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。
- ②株式の実質組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ③Fの実質組入外貨建資産については、原則として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。FBの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ④サンズ・キャピタル・マネジメント・エル・エル・シーにマザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限を委託します。
- ⑤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) 主な投資制限**

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ④投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑥外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑦新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ⑧同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑨同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑩一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。）の利用は行いません。
- ⑪一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。

**ウィリアム・ブレア・グローバル・リーダーズ（除く日本）F/FB（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるウィリアム・ブレア・グローバル・リーダーズ（除く日本）マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、主として日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）に

実質的に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。

## (B) 信託期間

無期限（2021年10月7日設定）

## (C) ファンドの関係法人

| 関係                 | 名称                                 |
|--------------------|------------------------------------|
| 委託会社               | 野村アセットマネジメント株式会社                   |
| 受託会社               | 三菱UFJ信託銀行株式会社                      |
| マザーファンドの<br>投資顧問会社 | ウィリアム・ブレア・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー |

## (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.65%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

日本を除く世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①株式への投資にあたっては、定量分析により銘柄群の絞込みを行なった後、マクロ経済見通し等を考慮しつつ、企業の質、バリュエーション、収益のトレンドなどの観点から分析を行ない、成長力とバリュエーションのバランスを勘案して組入銘柄を決定します。
- ②株式の実質組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ③Fの実質組入外貨建資産については、原則として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。FBの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ④ウィリアム・ブレア・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シーにマザーファンドの株式等の運用の指図に関する権限を委託します。
- ⑤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) 主な投資制限

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ④投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑥外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑦新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ⑧同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑨同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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。
- ⑪一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。

**ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドF／FB（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは親投資信託である三菱UFJ国際 ベイリー・ギフォード米国成長株マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、主に米国の金融商品取引所等に上場や登録等をされている株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に実質的に投資を行い、主として中長期的な値上がり益の獲得をめざします。なお、米国外の金融商品取引所等に上場や登録等をされている、収益の源泉や資産の大部分を米国に置く企業の株式等にも、信託財産の純資産総額の15%を上限として実質的に投資を行う場合があります。株式等の運用にあたっては、ベイリー・ギフォード・オーバーシーズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。また、ベイリー・ギフォード・オーバーシーズ・リミテッドは委託を受けた運用の指図に関する権限の一部を、ベイリー・ギフォード・アジア（香港）・リミテッドに更に委託することができます。

**(B) 信託期間**

無期限（2021年4月8日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                       |
|--------------------|--------------------------|
| 委託会社               | 三菱UFJ国際投信株式会社            |
| 受託会社               | 三菱UFJ信託銀行株式会社            |
| マザーファンドの<br>投資顧問会社 | ベイリー・ギフォード・オーバーシーズ・リミテッド |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.65%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託会社が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

三菱UFJ国際 ベイリー・ギフォード米国成長株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

①三菱UFJ国際 ベイリー・ギフォード米国成長株マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場や登録等をされている株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資を行います。なお、マザーファンド受益証券への投資を通じて、米国外の金融商品取引所等に上場や登録等をされている、収益の源泉や資産の大部分を米国に置く企業の株式等にも、信託財産の純資産総額の15%を上限として投資を行う場合があります。

②マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

③

「F」実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。

「FB」実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

④市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

**(3) 主な投資制限**

①株式への実質投資割合に制限を設けません。

②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とし

ます。

⑦外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。

⑧有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。

⑨スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。

⑩外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑪デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、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ないこととします。

⑫一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## MFS欧州株ファンドF／FB（適格機関投資家専用）

### (A) ファンドの特色

各ファンドは、MFS欧州株 マザーファンド受益証券への投資を通じて、欧州の証券取引所に上場（これに準じるものを含みます。）されている株式を中心に投資し、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

MFS欧州株ファンドF（「F」といいます。）はMSCI ヨーロッパ インデックス（円ヘッジベース）をベンチマークとし、MFS欧州株ファンドFB（「FB」といいます。）はMSCI ヨーロッパ インデックス（円ベース）をベンチマークとします。

各ファンドは、「MFS欧州株 マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。

### (B) 信託期間

無期限（2007年4月5日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係                         | 名称                            |
|----------------------------|-------------------------------|
| 委託会社                       | MFS インベストメント・マネジメント株式会社       |
| 受託会社                       | 三井住友信託銀行株式会社                  |
| Fおよび<br>マザーファンドの<br>投資顧問会社 | マサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニー |

### (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に税抜年0.649%の率を乗じて得た金額とします。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、投資信託財産に係る監査費用等を投資信託財産から支払います。

### (E) 投資方針等

**(1) 投資対象**

欧州の証券取引所に上場（これに準じるものを含みます。）されている株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① 欧州の証券取引所に上場（これに準じるものを含みます。）されている株式を実質的な主要投資対象とし、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ② マザーファンドにおける具体的な銘柄の選定にあたっては、「独自のリサーチによる個別企業のファンダメンタル分析に基づく銘柄選択こそが、優れた運用成果を中長期的に獲得するための最良の運用手法である」との投資哲学のもと、徹底したボトムアップ・アプローチによりアクティブに投資を行います。実際に企業リサーチを行うアナリスト自身が“ベスト・アイデア銘柄”を持ち寄ってポートフォリオを運用します。
- ③ 株式の実質組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
- ④ Fの実質外貨建資産については、原則として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。なお、為替ヘッジは、原則としてマザーファンドのベンチマークであるMSCIヨーロッパ インデックスの通貨配分に準じて行います。FBの実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑤ マサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニーにマザーファンドの運用の指図（国内の短期金融資産の運用の指図に係る権限を除きます。）ならびにFの為替ヘッジの指図に関する権限を委託します。
- ⑥ 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) 主な投資制限**

- ① 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ③ 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ④ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。
- ⑤ 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%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

**ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドF／FB（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

ファンドは、親投資信託であるティー・ロウ・プライス 海外株式マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界各国の株式（エマージング・マーケットも含みます。）に実質的に投資し、信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。

ファンドは、「ティー・ロウ・プライス 海外株式マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。

**(B) 信託期間**

無期限（2019年4月4日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                                                                                                                                                                                                           |
|--------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社               | ティー・ロウ・プライス・ジャパン株式会社                                                                                                                                                                                         |
| 受託会社               | 三菱UFJ信託銀行                                                                                                                                                                                                    |
| Fおよびマザーファンドの投資顧問会社 | ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ、インク<br>ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド<br>ティー・ロウ・プライス・香港・リミテッド<br>ティー・ロウ・プライス・シンガポール・プライベート・リミテッド<br>ティー・ロウ・プライス・オーストラリア・リミテッド<br>ティー・ロウ・プライス（カナダ）、インク <sup>*</sup><br><sup>*</sup> マザーファンドのみ |



**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.792%以内の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託会社が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。その他、信託財産に係る監査費用等として信託財産の純資産総額に対して税抜年0.1%を上限として信託財産から支払います。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

日本を除く世界各国の株式（エマージング・マーケットも含みます。）を実質的な投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の株式（エマージング・マーケットも含みます）の中で、成長性が高いと判断される企業の株式を中心に投資を行います。
- ② マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として、上場会社の普通株式および優先株、新株予約権付社債、米国預託証券(ADR)、欧州預託証券(EDR)、グローバル預託証券(GDR)といった株関連の証券へ投資をします。
- ③ マザーファンド受益証券における銘柄選択に関しては、個別企業分析に基づく「ボトム・アップ・アプローチ」を重視した運用を行います。個別企業分析にあたっては、ティール・ロウ・プライス<sup>\*</sup>のアナリストによる独自の企業調査情報を活用します。

<sup>\*</sup>委託会社およびその関連会社をいいます。

- ④ Fの実質組入外貨建資産については、原則として対円への為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、為替ヘッジが困難な一部の通貨については、当該通貨との相関等を勘案し、他の通貨による代替ヘッジを行う場合があります。FBの実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
- ⑤ 市場動向、資金動向、信託財産の規模等により、上記のような運用ができない場合があります。

**(3) 主な投資制限**

- ① 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ③ デリバティブの実質利用はヘッジ目的に限定せず、効率性の運用のために用いることがあります。
- ④ 外国為替予約取引の実質利用は為替変動リスクを回避するために行うことができます。
- ⑤ 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会の規則の定めるところに従い、デリバティブ取引等については、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ないものとします。
- ⑦ 一般社団法人投資信託協会の規則に定める一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取引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%以下とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

**ノムラ・ワールド (除く日本) エクイティ・ファンドF/FB****(A) ファンドの特色**

ファンドは、主として日本を除く世界各国の上場株式に実質的に投資を行うことにより、ベンチマーク指数を上回る収益の確保を目指します。ファンドは、ケイマン諸島籍契約型外国投資信託（円建て）であり、以下の2つのクラスがあります。

- ① F:円以外の外貨建て通貨については、対円での為替ヘッジを実質的に行うことを基本とします。Fのベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（円ヘッジベース）です。
- ② FB:円以外の外貨建て通貨については、対円での為替ヘッジを実質的に行わないことを基本とします。FBのベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）です。

**(B) 信託期間**

無期限（2015年4月9日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

|                    | 名称                                |
|--------------------|-----------------------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社                  |
| 副投資顧問会社            | ホチキス・アンド・ワイリー・キャピタル・マネジメント・エルエルシー |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー             |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー             |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額の0.60%（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

ファンドは、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等を負担する場合があります。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

日本を除く先進国の株式を実質的な主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① 独自のリサーチに基づき、将来のキャッシュフローの割引現在価値に対して割安な銘柄に投資します。
- ② 株式の実質組入比率は、原則として高位を基本とします。
- ③ Fの実質組入外貨建資産については、原則として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。FBの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ④ ホチキス・アンド・ワイリー・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに運用の権限の一部を委託します。
- ⑤ 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) 主な投資制限**

- ① 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ③ 投資信託証券への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ④ 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。

**ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FC／FD（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

各ファンドは、親投資信託であるノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、主として日本を除く世界の公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行なうことを基本とします。

ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FC（「FC」といいます。）はブルームバーグ・米国総合インデックス（円ヘッジベース）、ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円ヘッジベース）、およびブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス

（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>を20%：60%：20%の比率で委託者が独自に合成した指数をベンチマークとします。また、ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FD（「FD」といいます。）はブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）、ブルームバーグ・汎

欧州総合インデックス（円換算ベース）、およびブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス（円換算ベース）<sup>※2</sup>を20%：60%：20%の比率で委託者が独自に合成した指数をベンチマークとします。

※1 「ブルームバーグ・米国総合インデックス（円ヘッジベース）」、「ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円ヘッジベース）」、「ブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス（円ヘッジベース）」は、各々「ブルームバーグ・米国総合インデックス（米国ドルベース）」、「ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（現地通貨ベース）」、「ブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス（現地通貨ベース）」を委託会社が為替ヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2 「ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）」、「ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円換算ベース）」、「ブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス（円換算ベース）」は、各々「ブルームバーグ・米国総合インデックス（米国ドルベース）」、「ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（現地通貨ベース）」、「ブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス（現地通貨ベース）」をもとに、委託会社が円換算したものです。

各ファンドは、「ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、公社債等に直接投資する場合があります。

## (B) 信託期間

無期限（2009年4月9日設定）

## (C) ファンドの関係法人

| 関係             | 名称                       |
|----------------|--------------------------|
| 委託会社           | 野村アセットマネジメント株式会社         |
| 受託会社           | 野村信託銀行株式会社               |
| マザーファンドの投資顧問会社 | ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド |

## (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.37%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

日本を除く世界の公社債（国債、政府保証債、政府機関債、準政府債（州政府債）、国際機関債、社債、モーゲージ証券等）を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①ポートフォリオの構築にあたっては、原則として、投資時点においてBBB-格相当以上の格付（投資適格格付）を有する公社債、または同等の信用度を有すると判断される公社債を組入れることを基本とします。
  - ②ポートフォリオのデュレーションは、ベンチマーク±2年程度の範囲内に維持することを基本とします。
  - ③ポートフォリオのデュレーションのコントロール等のために債券先物取引等のデリバティブを活用する場合があります。
  - ④マザーファンドにおける外貨のエクスポージャーの調整にあたっては、為替予約取引等を利用し、ロング・ポジションとショート・ポジションを構築します。
  - ⑤FCの実質組入外貨建資産については、原則としてマザーファンドの通貨配分の如何に関わらず、マザーファンドのベンチマーク<sup>※</sup>の通貨配分をベースに対円で為替ヘッジを行なうことを基本とします。FDの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ※マザーファンドのベンチマークは、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）、ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円換算ベース）、ブルームバーグ・オーストラリア総合インデックス（円換算ベース）を20%：60%：20%の比率で委託者が独自に合成した指数です。
- ⑥マザーファンドの運用にあたっては、ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドおよびノムラ・グローバル・アルファ・エルエルシーに運用の指図に関する権限の一部を委託します。
  - ⑦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) 主な投資制限**

- ①外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ③外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ④株式への直接投資は行ないません。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および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）を行使したものに限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑤同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑦投資信託証券への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑧一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。
- ⑨一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。

**(4) 収益分配方針**

収益分配金額は、分配原資の範囲で委託者が決定するものとし、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行ないます。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。

**ノムラーAMP豪州債券ファンドFC／FD（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

各ファンドは、親投資信託であるノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンドへの投資を通じて、主としてオーストラリアドル建ての公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。

ノムラーAMP豪州債券ファンドFC（「FC」といいます。）は、ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、ノムラーAMP豪州債券ファンドFD（「FD」といいます。）は、ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

※1「ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円ヘッジベース）」は、Bloomberg AusBond Composite 0+ Yr Index（オーストラリアドルベース）をもとに、委託会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2「ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円換算ベース）」は、Bloomberg AusBond Composite 0+ Yr Index（オーストラリアドルベース）をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

各ファンドは、「ノムラーAMP豪州債券ファンド マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、公社債等に直接投資する場合があります。

**(B) 信託期間**

無期限（2006年9月14日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                     |
|--------------------|------------------------|
| 委託会社               | 野村アセットマネジメント株式会社       |
| 受託会社               | 三井住友信託銀行株式会社           |
| マザーファンドの<br>投資顧問会社 | AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.55%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

オーストラリアドル建ての公社債（国債、政府機関債、準政府債（州政府債）、国際機関債、社債等）を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①投資する公社債については、ファンド全体の加重平均格付をA-格相当以上とすることを基本とします。なお、BB+格相当以下の格付が付与されている債券（格付がない場合は同等の信用度を有すると判断されるものを含みます。）に投資する場合があります。
- ②モーゲージ証券、アセットバック証券、転換社債および優先証券等を実質的に投資を行なう場合があります。
- ③公社債への投資にあたっては、ポートフォリオの効率的なリスク配分（＝リスク・バジェットリング）を決定し、付加価値の源泉の分散を図り、マクロ経済分析および個別発行体の信用リスク分析等に基づき、デュレーション、イールドカーブ戦略、セクター配分（種別の配分）、個別銘柄選定等をアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。
- ④ファンド全体のデュレーションは、通常、豪州債券の市場全体のデュレーションを中心として±1.5年程度の範囲内に維持することを基本とします。ただし、投資環境、市況動向、資金動向等を勘案し、委託者が必要と判断した場合は、一時的に上記の範囲を超える場合があります。
- ⑤マザーファンドにおいては、オーストラリアドル建て以外の外貨建資産への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以内とします。オーストラリアドル建て以外の外貨建資産に投資を行なった場合は、当該資産について、原則としてオーストラリアドルに為替ヘッジを行ないます。
- ⑥FCの実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ることを目指します。FDの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ⑦AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドにマザーファンドの海外の公社債等（含む短期金融商品）の運用の指図に関する権限を委託します。
- ⑧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) 主な投資制限

- ①外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ③外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ④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および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）を行使したものに限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。
- ⑤同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑦投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑧一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。
- ⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

### (4) 収益分配方針

収益分配金額は、分配対象額の範囲内で委託者が決定するものとし、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行ないます。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。

**(A) ファンドの特色**

ファンドは、主に汎欧州市場の債券へ分散投資することにより、ベンチマークを上回る収益の確保を目指して運用を行ないます。

NPEBパン・ヨーロピアン・ボンド・ファンドFC（「FC」といいます。）は、ブルームバーグ汎欧州総合インデックス（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、NPEBパン・ヨーロピアン・ボンド・ファンドFD（「FD」といいます。）は、ブルームバーグ汎欧州総合インデックス（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

※1「ブルームバーグ汎欧州総合インデックス（円ヘッジベース）」は、ブルームバーグ汎欧州総合インデックス（現地通貨ベース）をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2「ブルームバーグ汎欧州総合インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ汎欧州総合インデックス（現地通貨ベース）をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島契約型外国籍投資信託です。

**(B) 信託期間**

ファンドの設定日（2015年4月9日）から149年

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                               |
|--------------------|----------------------------------|
| 投資顧問会社             | ブラックロック・ジャパン株式会社                 |
| 副投資顧問会社            | ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー            |
| 管理事務代行会社<br>保管受託銀行 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー            |

**(D) 管理報酬等**

管理報酬は純資産総額の0.46%（年率）とします。

上記のほか、ファンドは、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用、外貨建資産の保管などに要する費用等を負担します。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

汎欧州市場の債券を主要な投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①主としてベンチマーク指数に含まれる債券に投資します。
- ②FC の実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図ります。FDの実質外貨建て資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ③現物債への投資に加えて、先物やデリバティブをヘッジ目的に限定せずに、ポジション造成に活用し、投資収益の向上に努めます。
- ④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) 主な投資制限**

- ①少なくともファンドの純資産額の50%以上を金融商品取引法で定義される有価証券に投資します。
- ②有価証券（現物に限る）の空売りは行いません。
- ③株式への直接投資は行ないません。株式への投資は転換社債を転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り）を行使したものに限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。
- ④資金の借入れは、合併等による一時的な場合を除き、ファンド純資産総額の10%以下とします。
- ⑤投資信託証券（除く上場投資信託証券および上場不動産投資信託証券）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

**(4) 収益分配方針**

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

**LM・米国債券コア・プラスFC／FD（適格機関投資家専用）****(A) ファンドの特色**

各ファンドは、親投資信託であるLM・米国債券コア・プラス・マザーファンドへの投資を通じて、主として幅広いセクターの米国ドル建ての公社債に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指します。

LM・米国債券コア・プラスFC（「FC」といいます。）は、ブルームバーグ米国総合インデックス（円ヘッジベース）<sup>※</sup>をベンチマークとします。また、LM・米国債券コア・プラスFD（「FD」といいます。）は、ブルームバーグ米国総合インデックス（円ベース）<sup>※</sup>をベンチマークとします。

※ 「Bloomberg」<sup>(R)</sup> は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）の商標およびサービスマークです。ブルームバーグまたはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

各ファンドは、「LM・米国債券コア・プラス・マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。

**(B) 信託期間**

無期限（2006年4月13日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係             | 名称                                                              |
|----------------|-----------------------------------------------------------------|
| 委託会社           | フランクリン・テンプレートン・ジャパン株式会社                                         |
| 受託会社           | 三井住友信託銀行株式会社                                                    |
| マザーファンドの投資顧問会社 | ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー<br>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.42%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託会社が受ける報酬から支払われます。上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等を信託財産から支払います。その他、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

米国ドル建ての公社債を実質的な主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

- ①米国ドル建ての高格付の公社債（モーゲージ証券及び資産担保証券を含みます。）及び米国のハイ・イールド社債またはエマージング・マーケット債に分散投資を行います。
- ②原則として信託財産の純資産総額の70%以上を、S & P社、ムーディーズ社、フィッチ・レーティングス社のうち1社以上の格付機関から投資適格（BBB－またはBaa3以上）以上の格付を付与された公社債に投資します。組入れ公社債の格下げにより投資適格債の組入比率が信託財産の純資産総額の70%を下回った場合には、投資適格未満の格付けを付与された公社債への追加投資は行いません。
- ③ポートフォリオ全体の加重平均デュレーションは、ベンチマークの加重平均デュレーションを基準として、デュレーション戦略に基づき一定の範囲内で機動的に変動させます。
- ④長期的観点に基づくバリュエーション（債券価値）志向の投資を行うことを基本とし、複数の投資戦略に分散することで、信託財産の成長を目指します。
- ⑤米国ドル建て以外の外貨建資産への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の20%以内とします。  
FCの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。  
FDの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
マザーファンドにおいては、外貨建資産のうち、米国ドル建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。米国ドル建て以外の外貨建資産については、当該資産を米国ドルに為替ヘッジを行うことと同等の効果が得られる為替予約を行うことができます。
- ⑥債券及び金利等の派生商品を効率的運用のため使用します。
- ⑦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。
- ⑧運用の指図に関する権限のうち、米国ドル建ての公社債を中心とする有価証券等（派生商品を含みます。）の運用の指図に関する権限をウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに、米国ドル以外の通貨建ての公社債を中心とする有価証券等（派生商品を含みます。）及び外国為替の運用の指図に関する権限をウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッドに委託します。

### (3) 主な投資制限

- ①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ②投資信託証券（親投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ④為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。
- ⑤一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及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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (4) 収益分配方針

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。但し、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合もあります。

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡー米国債券FC/FD

### (A) ファンドの特色



ファンドは、米ドル建ての公社債（以下、「米国債券」といいます。）を主要投資対象とし、安定的なインカムゲインの確保と信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。

投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、米国債券の運用を行なう運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国債券FC（「FC」といいます。）は、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国債券FD（「FD」といいます。）

は、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島籍契約型外国籍投資信託です。

※1「ブルームバーグ・米国総合インデックス（円ヘッジベース）」はブルームバーグ・米国総合インデックス（米ドルベース）をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2「ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ・米国総合インデックス（米ドルベース）をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

## (B) 信託期間

無期限（2011年10月6日設定）

## (C) ファンドの関係法人

| 関係                 | 名称                    |
|--------------------|-----------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社      |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー |

## 副投資顧問会社

副投資顧問会社は、投資顧問会社との契約に基づきファンドの投資運用業務を行ないます。

| 名称                             |
|--------------------------------|
| Wells Capital Management, Inc. |

## (D) 管理報酬等

信託報酬は純資産総額の0.35%（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

信託財産留保額は、1口につき純資産価格の0.1%とします。

ファンドは、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、副投資顧問会社の追加に要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担し、5年を超えない期間にわたり償却します。

## (E) 投資方針等

**(1) 投資対象**

米ドル建ての公社債を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①米ドル建ての公社債（以下、「米国債券」といいます。）を主要投資対象とし、安定的なインカムゲインの確保と信託財産の成長を目標に運用を行うことを目指します。
- ②投資顧問会社が、米国債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。
- ③副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、米国債券の運用において優れていると判断した運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。
- ④投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。
- ⑤FCの外貨建資産については、原則としてブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）の通貨配分をベースに、対円を為替ヘッジを行うことを基本とします。FDの外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑥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) 主な投資制限**

- ①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ②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および新株予約権を行使したものならびに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ファンドの純資産総額の30%以内とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥一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。

**(4) 収益分配方針**

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

**ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－欧州債券FC/FD****(A) ファンドの特色**

ファンドは、汎欧州通貨建ての債券（以下、「欧州債券」といいます。）を主要投資対象とし、安定的なインカムゲインの確保と信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。

投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、欧州債券の運用を行なう運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－欧州債券FC（「FC」といいます。）は、ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－欧州債券FD（「FD」といいます。）

は、ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島籍契約型外国籍投資信託です。

<sup>※1</sup>「ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円ヘッジベース）」はブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（ユーロベース）をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

<sup>※2</sup>「ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（ユーロベース）をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

**(B) 信託期間**

無期限（2011年10月6日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                    |
|--------------------|-----------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社      |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー |

**副投資顧問会社**

副投資顧問会社は、投資顧問会社との契約に基づきファンドの投資運用業務を行ないます。

|                                                |
|------------------------------------------------|
| 名称                                             |
| Insight Investment Management (Global) Limited |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬は純資産総額の0.45%（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

信託財産留保額は、1口につき純資産価格の0.1%とします。

ファンドは、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、副投資顧問会社の追加に要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担し、5年を超えない期間にわたり償却します。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

汎欧州通貨建ての債券を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① 汎欧州通貨建ての債券（以下、「欧州債券」といいます。）を主要投資対象とし、安定的なインカムゲインの確保と信託財産の成長を目標に運用を行うことを目指します。
- ② 投資顧問会社が、欧州債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。
- ③ 副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、欧州債券の運用において優れていると判断した運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。
- ④ 投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。
- ⑤ FCの外貨建資産については、原則としてブルームバーグ・汎欧州総合インデックス（円換算ベース）の通貨配分をベースに対円で為替ヘッジを行うことを基本とします。FDの外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑥ 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) 主な投資制限**

- ① 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ② 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および新株予約権を行使したものならびに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ファンドの純資産総額の30%以内とします。
- ③ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥ 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。

**(4) 収益分配方針**

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－米国ハイ・イールド・ボンドFC/FD

### (A) ファンドの特色

ファンドは、米ドル建てのハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。

投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、米ドル建てのハイ・イールド債券の運用を行なう運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－米国ハイ・イールド・ボンドFC（「FC」といいます。）は、ICE BofA US High Yield Constrained Index（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－米国ハイ・イールド・ボンドFD（「FD」といいます。）は、ICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島籍契約型外国籍投資信託です。

※1 「ICE BofA US High Yield Constrained Index（円ヘッジベース）」は、ICE BofA US High Yield Constrained Index（US\$ベース）をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2 「ICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）」は、ICE BofA US High Yield Constrained Index（US\$ベース）をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

### (B) 信託期間

無期限（2011年4月7日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係                 | 名称                    |
|--------------------|-----------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社      |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー |

### 副投資顧問会社

副投資顧問会社は、投資顧問会社との契約に基づきファンドの投資運用業務を行ないます。

| 名称                                                  |
|-----------------------------------------------------|
| Nomura Corporate Research and Asset Management Inc. |
| PGIM, Inc.                                          |
| MacKay Shields LLC                                  |

### (D) 管理報酬等

信託報酬は純資産総額の0.55%以内（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

信託財産留保額は、1口につき純資産価格の0.3%とします。

ファンドは、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、副投資顧問会社の追加に要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担し、5年を超えない期間にわたり償却します。

### (E) 投資方針等

**(1) 投資対象**

米ドル建てのハイ・イールド債券を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①米ドル建てのハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。
- ②投資顧問会社が、米ドル建てのハイ・イールド債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。
- ③副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、米ドル建てのハイ・イールド債券の運用において優れていると判断した運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。
- ④投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。
- ⑤FCの外貨建資産については、原則としてICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）の通貨配分をベースに円建て為替ヘッジを行うことを基本とします。FDの外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑥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) 主な投資制限**

- ①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ②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券の性質を有するものまたは転換社債を転換および新株予約権を行使したものならびに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ファンドの純資産総額の30%以内とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥一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。

**(4) 収益分配方針**

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

**ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・ボンドFC/FD****(A) ファンドの特色**

ファンドは、欧州のハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。

投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、欧州のハイ・イールド債券の運用を行なう運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・ボンドFC（「FC」といいます。）は、ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・ボンドFD（「FD」といいます。）は、ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島籍契約型外国籍投資信託です。

※1 「ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（円ヘッジベース）」は、ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（ユーロベース）をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2 「ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（円換算ベース）」は、ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（ユーロベース）をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

**(B) 信託期間**

無期限（2011年10月6日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                    |
|--------------------|-----------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社      |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー |

**副投資顧問会社**

副投資顧問会社は、投資顧問会社との契約に基づきファンドの投資運用業務を行ないます。

| 名称                                                  |
|-----------------------------------------------------|
| Threadneedle Asset Management Limited               |
| Nomura Corporate Research and Asset Management Inc. |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬は純資産総額の0.75%（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

信託財産留保額は、1口につき純資産価格の0.3%とします。

ファンドは、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、副投資顧問会社の追加に要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担し、5年を超えない期間にわたり償却します。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

欧州のハイ・イールド債券を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① 欧州のハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。
- ② 投資顧問会社が、欧州のハイ・イールド債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。
- ③ 副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、欧州のハイ・イールド債券の運用において優れていると判断した運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。
- ④ 投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。

- ⑤FCの外貨建資産については、原則としてICE BofA European Currency High Yield Constrained Index（円換算ベース）の通貨配分をベースに対円で為替ヘッジを行うことを基本とします。FDの外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑥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) 主な投資制限

- ①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ②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および新株予約権を行使したものならびに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ファンドの純資産総額の30%以内とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥一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。

### (4) 収益分配方針

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

## 野村エマージング債券ファンドFC／FD（適格機関投資家専用）

### (A) ファンドの特色

各ファンドは、親投資信託である野村エマージング債券マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国<sup>※</sup>の政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券（以下、「新興国債券」といいます。）に実質的に投資を行ない、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。

※ 新興国とは、いわゆる先進国を除く諸国で、一般にエマージング・カンントリー、発展途上国、中所得国および低所得国などと認識される国々をいいます。

野村エマージング債券ファンドFC（「FC」といいます。）は、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、野村エマージング債券ファンドFD（「FD」といいます。）は、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

※1 「JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円ヘッジベース）」はJP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Global (US\$ベース) をもとに、委託会社がヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2 「JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円換算ベース）」は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Global (US\$ベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

各ファンドは「野村エマージング債券マザーファンド」（「マザーファンド」といいます。）を親投資信託とするファミリーファンド方式で運用します。なお、公社債等に直接投資する場合もあります。

### (B) 信託期間

無期限（2007年10月11日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係             | 名称                          |
|----------------|-----------------------------|
| 委託会社           | 野村アセットマネジメント株式会社            |
| 受託会社           | 野村信託銀行株式会社                  |
| マザーファンドの投資顧問会社 | ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー |

### (D) 管理報酬等

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に税抜年0.75%の率を乗じて得た額とします。なお、マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、ファンドの信託報酬中の委託者が受ける報酬から支払われます。

上記のほか、ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託財産に係る監査費用等を信託財産から支払います。

## (E) 投資方針等

### (1) 投資対象

新興国の政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券を実質的な主要投資対象とします。なお、償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

### (2) 投資態度

- ①新興国債券を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの安定的確保に加え、キャピタルゲインの獲得を目指します。なお、投資する債券の格付については制限を設けません。
- ②新興国債券への投資にあたっては、ファンダメンタルズ分析やセクター・国別のバリュエーション分析、テクニカル分析に基づき、国別配分、個別銘柄選定等を決定し、ポートフォリオの構築を行ないます。
- ③マザーファンドにおける投資にあたっては、原則として次の範囲内で行ないます。
  - ・単一国の発行する債券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします（OECD加盟国の国債、政府機関債、国際機関債等を除く。）。
  - ・企業が発行する債券への投資割合は、合計で信託財産の純資産総額の30%以内とします。
  - ・新興国の現地通貨建資産への投資割合は、合計で信託財産の純資産総額の40%以内とします。
- ④マザーファンドにおける通貨配分については、為替予約取引等を用いて債券の国別配分とは独立した通貨配分戦略を行なう場合があります。
- ⑤マザーファンド全体のデュレーションは、新興国債券の市場全体のデュレーションを中心として±2年程度の範囲内に維持することを基本とします。ただし、投資環境、市況動向、資金動向等を勘案し、委託者が必要と判断した場合は、一時的に上記の範囲を超える場合があります。
- ⑥FCにおける、実質組入外貨建資産については、原則として現地通貨による為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、現地通貨による為替ヘッジが困難な一部の通貨については、当該現地通貨との連動性等を勘案し、先進主要国通貨等他の通貨を用いた代替ヘッジを行なう場合があります。FDの実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ⑦投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- ⑧投資環境によっては防衛的な観点から運用者の判断で主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。
- ⑨ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーにマザーファンドの海外の公社債等（含む金融商品等）の運用の指図に関する権限を委託します。



**(3) 主な投資制限**

- ①外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ③外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ④株式への直接投資は行ないません。株式への投資は転換社債を転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）を行使したものに限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%未満とします。
- ⑤同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑦投資信託証券への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑧一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。
- ⑨一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。

**(4) 収益分配方針**

収益分配金額は、分配原資の範囲内で委託者が決定するものとし、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行ないます。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。

**ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－新興国債券FC/FD****(A) ファンドの特色**

ファンドは、新興国の政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券（以下、「新興国債券」といいます。）を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。

投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、新興国債券の運用を行なう運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－新興国債券FC（「FC」といいます。）は、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>をベンチマークとします。また、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－新興国債券FD（「FD」といいます。）は、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島籍契約型外国籍投資信託です。

<sup>※1</sup>「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円ヘッジベース）」はJP Morgan Emerging Markets Bond Index Global (US\$ベース) をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

<sup>※2</sup>「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円換算ベース）」は、JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global (US\$ベース) をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

**(B) 信託期間**

無期限（2011年4月7日設定）

**(C) ファンドの関係法人**

| 関係                 | 名称                    |
|--------------------|-----------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社      |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー |

**副投資顧問会社**

副投資顧問会社は、投資顧問会社との契約に基づきファンドの投資運用業務を行ないます。

| 名称                                              |
|-------------------------------------------------|
| Pictet Asset Management Limited                 |
| Pictet Asset Management (Singapore) Pte Limited |
| Pacific Investment Management Company LLC       |
| Marathon Asset Management, L.P.                 |
| Neuberger Berman Investment Advisers LLC        |

**(D) 管理報酬等**

信託報酬は純資産総額の0.60%以内（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

信託財産留保額は、1口につき純資産価格の0.3%とします。

ファンドは、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、副投資顧問会社の追加に要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担し、5年を超えない期間にわたり償却します。

**(E) 投資方針等****(1) 投資対象**

新興国の政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ①新興国の政府、政府機関、もしくは企業の発行する債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。
- ②投資顧問会社が、新興国債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。
- ③副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、新興国債券の運用において優れていると判断した運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。
- ④投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。
- ⑤FCの外貨建資産については、原則としてJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（円換算ベース）の通貨配分をベースに対円で為替ヘッジを行うことを基本とします。FDの外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑥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) 主な投資制限**

- ①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ②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および新株予約権を行使したものならびに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ファンドの純資産総額の30%以内とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥一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。

**(4) 収益分配方針**

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－新興国現地通貨建債券FC/FD

### (A) ファンドの特色

ファンドは、新興国の政府、政府機関、もしくは企業の発行する現地通貨建ての債券（以下、「新興国現地通貨建債券」といいます。）を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。

投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、新興国現地通貨建債券の運用を行なう運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－新興国現地通貨建債券FC（「FC」といいます。）は、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジベース）<sup>※1</sup>を参考指数とします。また、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII－新興国現地通貨建債券FD（「FD」といいます。）は、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）<sup>※2</sup>をベンチマークとします。

ファンドは、円建てオープン・エンド型の英領ケイマン諸島籍契約型外国籍投資信託です。

※1 「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（円ヘッジベース）」は、JP Morgan GBI-EM Global Diversified（US\$ベース）をもとに、投資顧問会社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。

※2 「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）」は、JP Morgan GBI-EM Global Diversified（US\$ベース）をもとに、投資顧問会社が独自に円換算したものです。

### (B) 信託期間

無期限（2011年4月7日設定）

### (C) ファンドの関係法人

| 関係                 | 名称                    |
|--------------------|-----------------------|
| 投資顧問会社             | 野村アセットマネジメント株式会社      |
| 受託会社               | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー |
| 保管受託銀行<br>管理事務代行会社 | ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー |

### 副投資顧問会社

副投資顧問会社は、投資顧問会社との契約に基づきファンドの投資運用業務を行ないます。

| 名称                                |
|-----------------------------------|
| Wellington Management Company LLP |

### (D) 管理報酬等

信託報酬は純資産総額の0.80%（年率）とします。

申込手数料は発生しません。

信託財産留保額は、1口につき純資産価格の0.3%とします。

ファンドは、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、副投資顧問会社の追加に要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担し、5年を超えない期間にわたり償却します。

### (E) 投資方針等

#### (1) 投資対象

新興国の政府および政府機関等の発行する現地通貨建債券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ①新興国の政府および政府機関等の発行する現地通貨建債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。
- ②投資顧問会社が、新興国現地通貨建債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。
- ③副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、新興国現地通貨建債券の運用において優れていると判断した運用会社を選定します（選定する運用会社は複数になる場合があります）。
- ④投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。
- ⑤FCの外貨建資産については、原則として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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の通貨配分をベースに対円で為替ヘッジを行うことを基本とします。ただし、該当通貨での為替ヘッジが困難である場合、先進国通貨による代替ヘッジを行う場合があります。また、代替ヘッジによるリスク低減効果が小さい場合には、為替ヘッジを行わない場合があります。FD の外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- ⑥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) 主な投資制限

- ①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ②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および新株予約権を行使したものならびに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ファンドの純資産総額の30%以内とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。
- ⑥一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。

#### (4) 収益分配方針

毎月、受託会社の判断により、分配を行う方針です。ただし、必ず分配を行うものではありません。

### ■ベンチマークについて■

※東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止、またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

※MSCI-KOKUSAI指数、MSCI ヨーロッパ インデックスは、MSCIが開発した指数で、当該指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、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。

- ※「Bloomberg<sup>(R)</sup>」は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）の商標およびサービスマークです。ブルームバーグまたはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。
- ※ブルームバーグおよびブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(円ヘッジベース)、ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(円換算ベース)（以下、当該指数といいます。）は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標またはサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーが、当該指数に対する全ての権利を保有しています。ブルームバーグは、当該指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。ブルームバーグは、当該指数、または当該指数に関連するデータもしくは価値または当該指数から得ることができる結果に関して、明示または黙示を問わず如何なる保証も行わず、当該指数の商品性および特定の目的に対する適合性に関するあらゆる保証を明示的に否定します。指数に対して直接投資を行うことはできません。バックテストされたパフォーマンスは、実際のパフォーマンスではありません。法律上認められる最大限の範囲で、ブルームバーグ、ブルームバーグのライセンサー、およびこれらのそれぞれの従業員、業務受託者、代理人、サプライヤーおよびベンダーは、当該指数またはこれに関連するデータもしくは価値に関係して生じるいかなる傷害または損害についても、直接的、間接的、結果的、付随的、懲罰的またはその他であるかを問わず、何らの債務も責任も負いません（これらの者の過失その他に起因するか否かを問いません。）。当該指数のいかなる部分も、金融商品の申込み、あるいはブルームバーグもしくはその関係会社による投資助言もしくは投資の推奨（すなわち、「買い」、「売り」、「保有」または特定の権利に関係するその他の取引を実行するか否かの推奨）またはブルームバーグもしくはその関係会社による投資もしくはその他の戦略に関する推奨を構成するものではなく、またそのように解釈されてはなりません。当該指数から得ることができるデータおよびその他の情報は、投資判断の基礎とするために十分な情報とみなされるべきではありません。当該指数が提供する全ての情報は、個人的なものではなく、いかなる者、法人または集団のニーズに対応したものでもありません。ブルームバーグおよびその関係会社は、証券またはその他の権利の将来のまたは予想される価値についての意見を表明するものではなく、いかなる種類の投資戦略について、明示的にも黙示的にも、いかなる推奨または提案も行うものではありません。
- ブルームバーグまたはその子会社もしくは関係会社の野村アセットマネジメント株式会社との唯一の関係は、一定の商標、商号およびサービスマークならびに当該指数のライセンス付与のみであり、当該指数は、野村アセットマネジメント株式会社またはノムラーAMP豪州債券ファンドFC/FD(適格機関投資家専用)(以下、当該プロダクトといいます。)を考慮することなく、ブルームバーグによって決定され、構成されかつ算出されています。ブルームバーグは、当該指数の決定、構成または算出において、野村アセットマネジメント株式会社または当該プロダクトの保有者のニーズを考慮する義務を負っていません。当該プロダクトは、ブルームバーグまたはその子会社もしくは関係会社がスポンサーとなり、是認し、販売または促進するものではありません。
- ※ICE BofA US High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLCが算出する、米国のハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表す代表的な指数です。「ICE BofA US High Yield Constrained Index SM/(R)」は、ICE Data Indices, LLCまたはその関連会社（「ICEデータ」）の登録商標です。当ファンドは、ICEデータによって支持・推奨・販売・販売促進されるものではなく、また、ICEデータは当ファンドに関して一切の責任を負いません。
- ※ICE BofA European Currency High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLCが算出する、英ポンド、ユーロ建てで発行されたハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表す代表的な指数で、同一発行体の発行するハイ・イールド・ボンドの指数に占める構成比率を3%に制限した指数です。「ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index SM/(R)」は、ICE Data Indices, LLCまたはその関連会社（「ICEデータ」）の登録商標です。当ファンドは、ICEデータによって支持・推奨・販売・販売促進されるものではなく、また、ICEデータは当ファンドに関して一切の責任を負いません。
- ※JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Global）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング・マーケット債を対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。
- ※JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan GBI-EM Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建のエマージング・マーケット債を対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

## ■指定投資信託証券の委託会社等について■

◆指定投資信託証券の委託会社等の沿革は、以下の通りです。

### 野村アセットマネジメント株式会社

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

**アムンディ・ジャパン株式会社**

|             |                                                       |
|-------------|-------------------------------------------------------|
| 1971年11月22日 | 山一投資カウンセリング株式会社設立                                     |
| 1980年1月4日   | 山一投資カウンセリング株式会社から山一投資顧問株式会社へ社名変更                      |
| 1998年4月1日   | 山一投資顧問株式会社からエスジー山一アセットマネジメント株式会社へ社名変更                 |
| 1998年11月30日 | 証券投資信託委託会社の免許取得                                       |
| 2004年8月1日   | りそなアセットマネジメント株式会社と合併し、ソシエテ ジェネラル アセット マネジメント株式会社へ社名変更 |
| 2007年9月30日  | 金融商品取引法の施行に伴い同法の規定に基づく金融商品取引業者の登録を行う                  |
| 2010年7月1日   | クレディ・アグリコル アセットマネジメント株式会社と合併し、アムンディ・ジャパン株式会社へ社名変更     |

**シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社**

|             |                                                                 |
|-------------|-----------------------------------------------------------------|
| 1985年12月10日 | 株式会社シュローダー・インベストメント・マネージメント設立                                   |
| 1991年12月20日 | シュローダー投信株式会社設立                                                  |
| 1997年4月1日   | シュローダー投信株式会社と株式会社シュローダー・インベストメント・マネージメントが合併し、シュローダー投信投資顧問株式会社設立 |
| 2007年4月3日   | シュローダー証券投信投資顧問株式会社に商号を変更                                        |
| 2012年6月29日  | シュローダー・インベストメント・マネージメント株式会社に商号を変更                               |

**ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社**

|           |                                                                                                     |
|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1996年2月6日 | 会社設立                                                                                                |
| 2002年4月1日 | ゴールドマン・サックス・アセット・マネージメント・ジャパン・リミテッドの営業の全部を譲受け、商号をゴールドマン・サックス投信株式会社からゴールドマン・サックス・アセット・マネージメント株式会社に變更 |

**MFSインベストメント・マネジメント株式会社**

|            |                                           |
|------------|-------------------------------------------|
| 1998年5月12日 | マサチューセッツ・インベストメント・マネージメント株式会社設立           |
| 1998年6月30日 | 投資顧問業の登録                                  |
| 1999年2月18日 | 投資一任契約に係る業務の認可                            |
| 1999年12月9日 | 証券投資信託委託業の認可                              |
| 2000年8月1日  | エムエフエス・インベストメント・マネージメント株式会社に商号変更          |
| 2007年9月30日 | 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業（投資助言・代理業、投資運用業）のみなし登録 |
| 2011年6月22日 | MFSインベストメント・マネージメント株式会社に商号変更              |

**フランクリン・テンブルトン・ジャパン株式会社**

|             |                                                             |
|-------------|-------------------------------------------------------------|
| 1998年4月28日  | 会社設立                                                        |
| 1998年6月16日  | 証券投資信託委託会社免許取得                                              |
| 1998年11月30日 | 投資顧問業登録                                                     |
| 1999年6月24日  | 投資一任契約に係る業務の認可取得                                            |
| 1999年10月1日  | スミス バーニー投資顧問株式会社と合併、「エスエスビーシティ・アセット・マネージメント株式会社」に社名変更       |
| 2001年4月1日   | 「シティグループ・アセット・マネージメント株式会社」に社名変更                             |
| 2006年1月1日   | 「レグ・メイソン・アセット・マネージメント株式会社」に社名変更                             |
| 2007年9月30日  | 金融商品取引業登録                                                   |
| 2021年4月1日   | フランクリン・テンブルトン・インベストメンツ株式会社と合併、「フランクリン・テンブルトン・ジャパン株式会社」に社名変更 |

**スパークス・アセット・マネジメント株式会社**

|          |                                                                                                                 |
|----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2006年4月  | 持株会社への移行に伴い、スパークス・アセット・マネジメント投信株式会社の子会社として、スパークス分割準備株式会社を設立                                                     |
| 2006年10月 | 商号をスパークス・アセット・マネジメント株式会社に変更<br>投資顧問業及び投資一任契約に係る業務並びに投資信託委託業をスパークス・アセット・マネジメント投信株式会社（現スパークス・グループ株式会社）より会社分割により承継 |
| 2007年9月  | 金融商品取引業者として登録<br>登録番号：関東財務局長（金商）第346号                                                                           |
| 2010年7月  | スパークス証券株式会社との合併に伴い、第一種金融商品取引業務を開始                                                                               |

**SOMPOアセットマネジメント株式会社**

|            |                                                      |
|------------|------------------------------------------------------|
| 1986年2月25日 | 安田火災投資顧問株式会社設立                                       |
| 1987年2月20日 | 投資顧問業の登録                                             |
| 1987年9月9日  | 投資一任業務の認可取得                                          |
| 1991年6月1日  | ブリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災ブリンソン投資顧問株式会社に商号変更      |
| 1998年1月1日  | 安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更                       |
| 1998年3月3日  | 安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更                             |
| 1998年3月31日 | 証券投資信託委託業の免許取得                                       |
| 2002年7月1日  | 損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更                           |
| 2007年9月30日 | 金融商品取引業者として登録                                        |
| 2010年10月1日 | ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2020年4月1日  | SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更                             |

**ティー・ロウ・プライス・ジャパン株式会社**

|            |                                              |
|------------|----------------------------------------------|
| 1982年8月4日  | ロウ・プライス - フレミング・インターナショナルが駐在員事務所（リサーチ）を東京に開設 |
| 2003年3月20日 | T. ロウ・プライス・グローバル投資顧問 東京支店開設、投資助言登録           |
| 2011年1月1日  | T. ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド 東京支店に社名変更         |
| 2017年3月1日  | ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド 東京支店に商号変更        |
| 2018年4月1日  | ティー・ロウ・プライス・ジャパン株式会社（日本法人）へ事業譲渡、営業開始         |

**アセットマネジメントOne株式会社**

|            |                                                                                               |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1985年7月1日  | 会社設立                                                                                          |
| 1998年3月31日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得                                                                 |
| 1998年12月1日 | 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可                                                                  |
| 1999年10月1日 | 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。 |
| 2008年1月1日  | 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A M アセットマネジメント株式会社」に商号変更                                       |

2016年10月1日

D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会  
社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が  
統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に變更

### コムジェスト・アセットマネジメント株式会社

|          |                             |
|----------|-----------------------------|
| 2007年3月  | 日本コムジェスト株式会社設立              |
| 2007年12月 | 投資運用業および第二種金融商品取引業の登録       |
| 2009年5月  | 投資助言・代理業の登録                 |
| 2012年2月  | 投資一任業を追加登録                  |
| 2016年8月  | 社名をコムジェスト・アセットマネジメント株式会社に變更 |

### 三菱UFJ国際投信株式会社

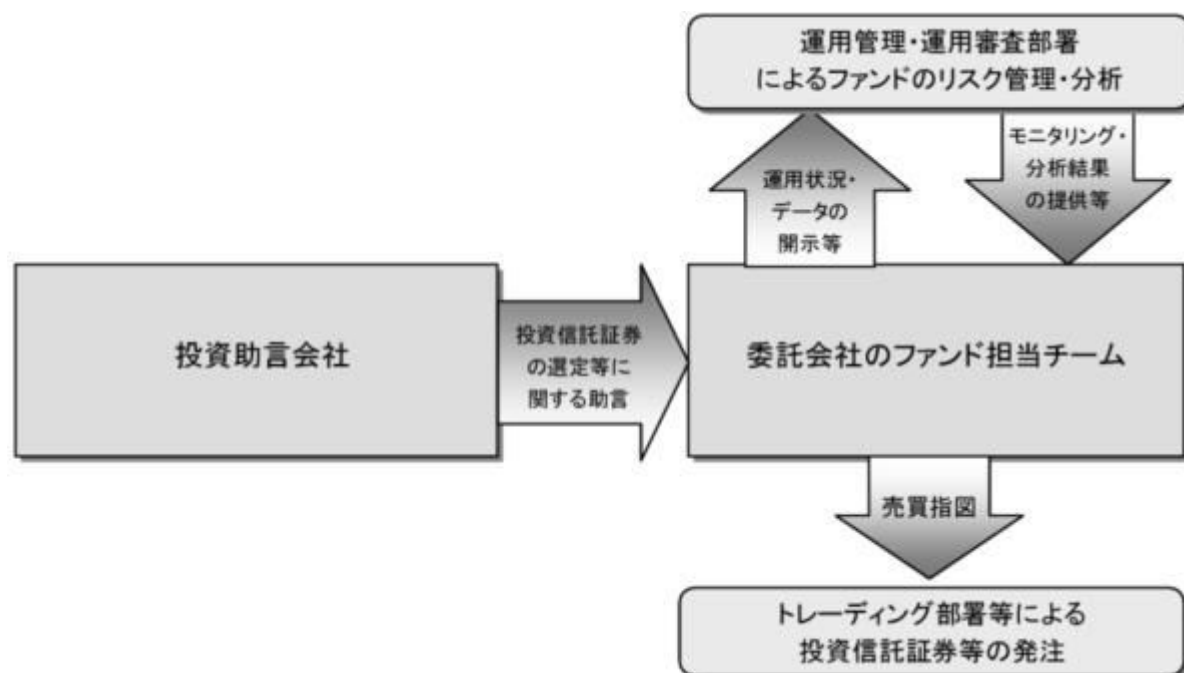
|            |                                                           |
|------------|-----------------------------------------------------------|
| 1997 年5月   | 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始                              |
| 2004 年10 月 | 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が<br>合併、商号を三菱投信株式会社に變更    |
| 2005 年10 月 | 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商<br>号を三菱U F J 投信株式会社に變更  |
| 2015 年7 月  | 三菱U F J 投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱<br>U F J 国際投信株式会社に變更 |

### グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー

|       |      |
|-------|------|
| 1998年 | 会社設立 |
|-------|------|

### （３）【運用体制】

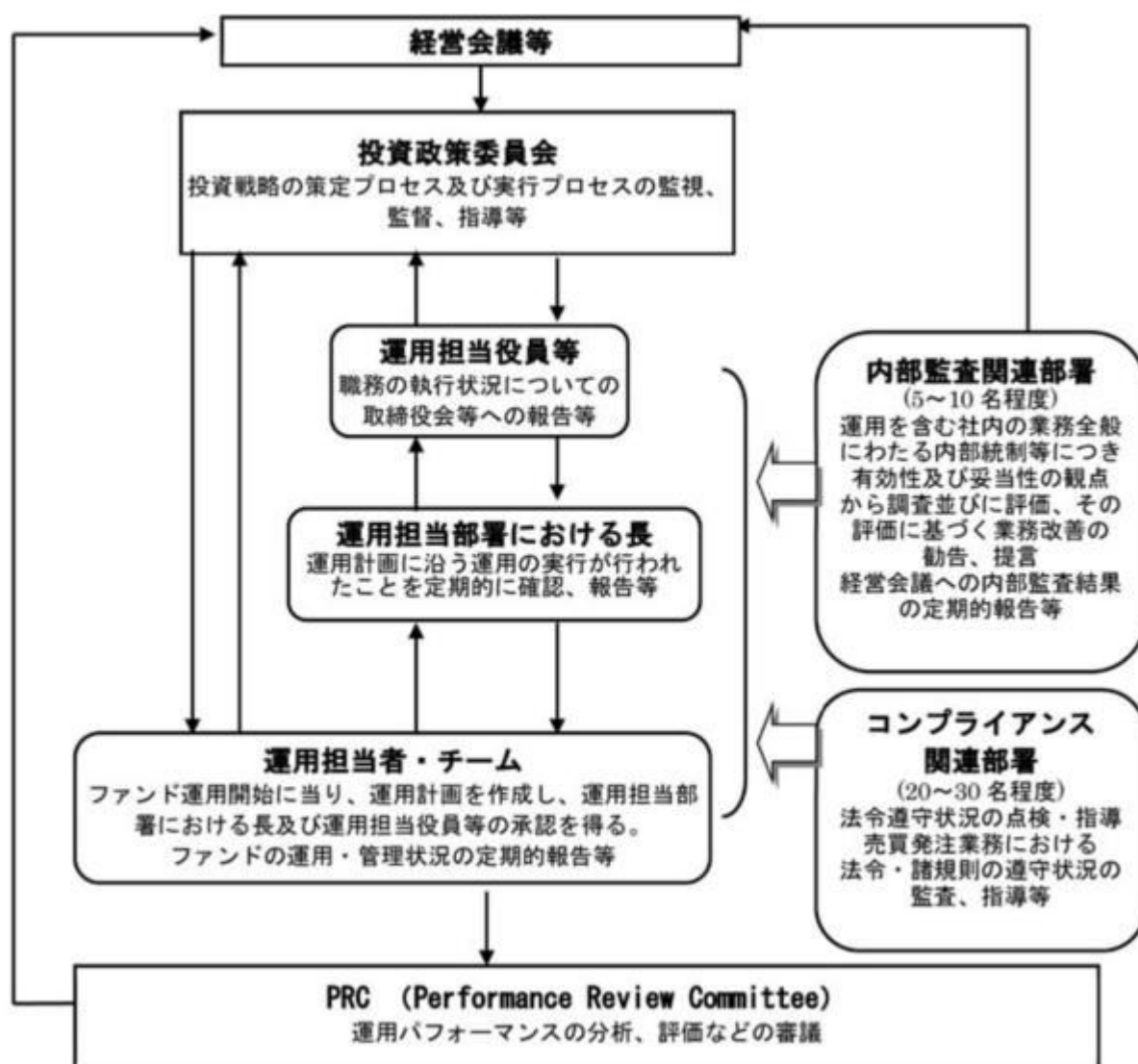
ファンドの運用体制は以下の通りです。



当社では、ファンドの運用に関する社内規程として、運用担当者に関する規程並びにスワップ取引、信用リスク管理、資金の借入、外国為替の予約取引等、信用取引等に関して各々、取扱い基準を設けております。



ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



#### 《委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等》

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

年6回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

- ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ②収益分配金額は、上記①の範囲内で委託者が決定するものとし、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行ないます。ただし、毎年１月および7月の決算時には、基準価額水準等を勘案し、上

記安定分配相当額のほか、上記①の範囲内で委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。

③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

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

※毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

#### ◆ファンドの決算日

原則として毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各20日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

#### ◆分配金のお支払い

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## ◆分配金に関する留意点

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

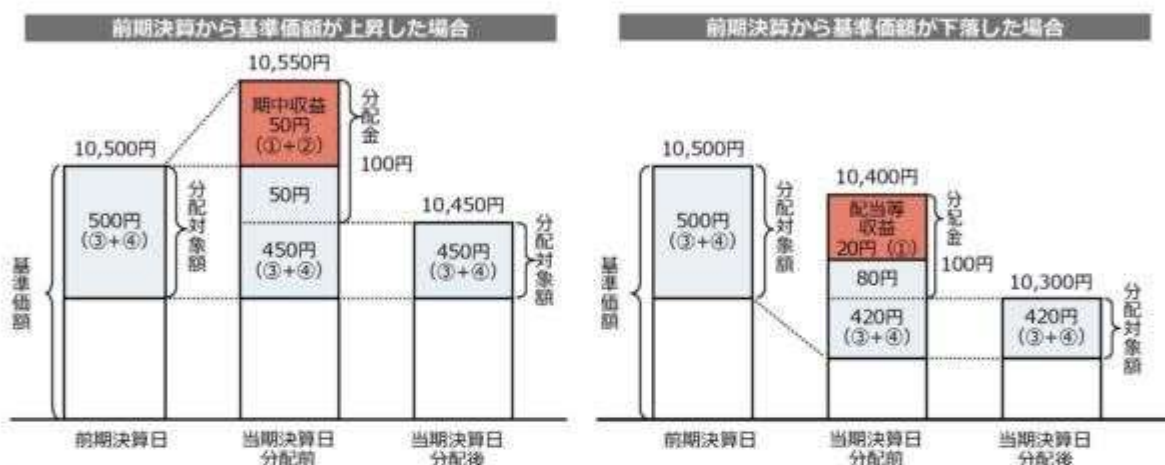


- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

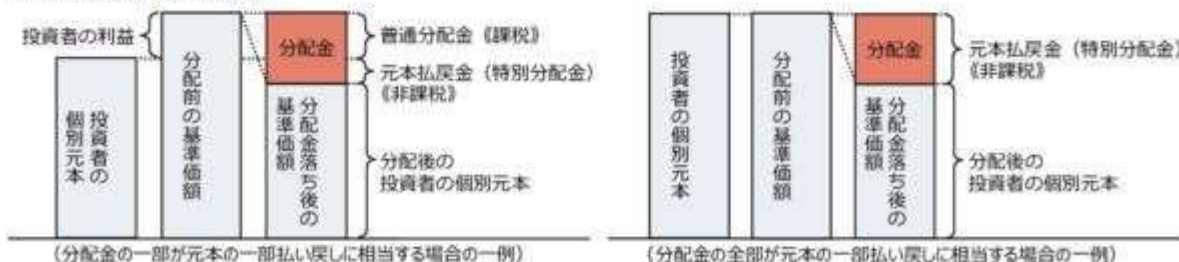
分配対象額とは、①経費控除後の配当等収益②経費控除後の評価益を含む売買益③分配準備積立金④収益調整金です。



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

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

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



分配金に関する留意点に記載の図はイメージ図であり、全ての状況について説明したものではありません。また、実際の分配金額や基準価額について示唆、保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### ◆各ファンドに共通

#### ①外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への直接投資は行ないません。

#### ②株式への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

株式への直接投資は行いません。

#### ③デリバティブの使用(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

デリバティブの直接利用は行いません。

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

#### ④投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

#### ⑤同一銘柄の投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の50%未満とします。

ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

#### ⑥公社債の借入れ(約款第25条)

(i) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。

なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

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

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

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

#### ⑦資金の借入れ(約款第32条)

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

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

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

(iv)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

- ⑧一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。(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

### 3【投資リスク】

#### ＜基準価額の変動要因＞

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

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

#### 【株価変動リスク】

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### 【債券価格変動リスク】

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

ファンドの実質的な投資対象に含まれるハイ・イールド債等の格付けの低い債券については、格付けの高い債券に比べ、価格が大きく変動する可能性や組入債券の元利金の支払遅延および支払不履行などが生じるリスクが高いと想定されます。

ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

#### 【為替変動リスク】

「Bコース」が投資対象とする投資信託証券のうち世界の株式・債券に実質的に投資する投資信託証券は、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

「Aコース」が投資対象とする投資信託証券のうち世界の株式・債券に実質的に投資する投資信託証券は、実質組入外貨建資産について、原則として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するもの、または原則として実質組入外貨建資産の通貨配分の如何に関わらず、当該投資信託証券または当該投資信託証券が組入れるマザーファンドのベンチマークの通貨配分をベースに対円で為替ヘッジを行なうことを基本とするもの等に限りますが、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。なお、現地通貨による直接ヘッジのほか先進国通貨を用いた代替ヘッジを行なう場合がありますが、その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定され、十分な為替ヘッジ効果が得られないことがあります。また、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかるため、基準価額の変動要因となります。

一部の通貨においては為替ヘッジの手段がない等の理由から為替ヘッジを行わない場合や、一部の投資信託証券においては実際のポートフォリオの通貨配分と対円で為替ヘッジの通貨配分が異なる場合があります。それらの場合は為替変動の影響を直接的に受けることになります。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

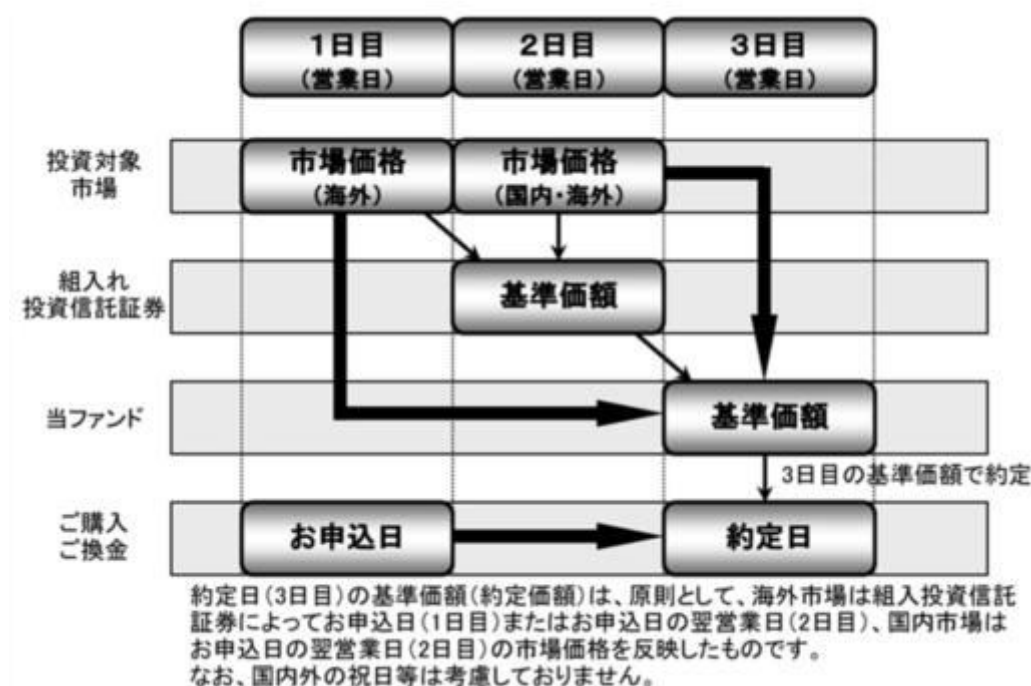
#### 《その他の留意点》

- ◆ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ◆資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ◆ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- ◆有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- ◆ファンドのベンチマークは、市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。また、ベンチマークに対して一定の投資成果をあげることを保証するものではありません。
- ◆ファンドが投資する投資信託証券が投資対象とする各マザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ◆ファンドが実質的に投資する新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。  
上記のような投資環境変化の内容によっては、ファンドでの新規投資の中止や大幅な縮小をする場合があります。
- ◆店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。
- ◆ファンドが投資対象とする投資信託証券の販売会社は、委託会社（運用の権限委託先を含みます。）の利害関係人等（当該委託会社の総株主の議決権の過半数を所有していることその他の当該委託会社と密接な関係を有するものとして政令で定めるものをいいます。）である野村信託銀行株式会社またはノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エーとなっております。したがって、ファンドにおいて、委託会社（運用の権限委託先を含みます。）が当該投資信託証券の買付けまたは売付けを受託会社に指図する場合、当該買付けまたは売付けの発注は当該利害関係人等に対して行なわれます。なお、ファンドが投資対象とする全ての指定投資信託証券の申込手数料は無手数料となっております。
- ◆ファンドの基準価額は、原則として組入投資信託証券の前営業日の基準価額をもって毎営業日計算されます。したがって、ファンドの基準価額において、組入投資信託証券の投資対象資産等の値動きは、下図の通り一般的な投資信託における場合と比較して1営業日遅れて反映される場合がありますので、ご留



意ください。

＜基準価額の算出イメージ図＞



## ＜委託会社におけるリスクマネジメント体制＞

### リスク管理関連の委員会

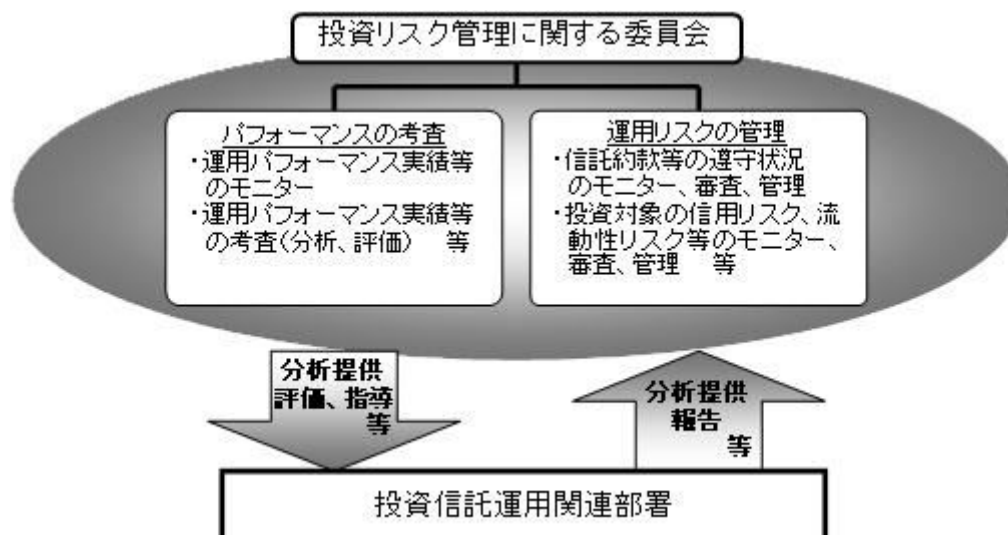
#### ◆パフォーマンスの考査

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

#### ◆運用リスクの管理

投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

### リスク管理体制図



※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## ■ リスクの定量的比較（2016年9月末～2021年8月末：月次）

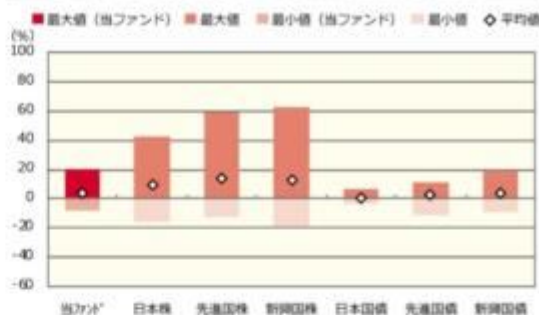
### ■ Aコース

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



2016年9月 2017年8月 2018年8月 2019年8月 2020年8月 2021年8月

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 (%) | 20.1  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 6.2   | 11.4   | 19.3  |
| 最小値 (%) | △ 7.6 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 4.0 | △ 11.4 | △ 9.4 |
| 平均値 (%) | 4.2   | 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。

### ■ Bコース

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



2016年9月 2017年8月 2018年8月 2019年8月 2020年8月 2021年8月

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 (%) | 26.5  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 6.2   | 11.4   | 19.3  |
| 最小値 (%) | △ 9.5 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 4.0 | △ 11.4 | △ 9.4 |
| 平均値 (%) | 4.9   | 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・ディバースファイド（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、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。</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、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</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・ディバースファイド（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・ディバースファイド（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プライアンス、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase &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「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推奨、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。</p> <p>JPMS LLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。</p> |

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

- ①取得申込日の翌々営業日の基準価額に、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内<sup>※</sup>で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

- ②収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

購入時手数料は、商品及び関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務コストの対価として、購入時に頂戴するものです。

### （2）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

### （3）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.836%（税抜年0.76%）の率（以下「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。

また、信託報酬の配分については、ファンドの純資産総額の残高に応じて次の通り（税抜）とします。

| <ファンドの純資産総額* > | <委託会社> | <販売会社> | <受託会社> |
|----------------|--------|--------|--------|
| 500億円以下の部分     | 年0.35% | 年0.38% | 年0.03% |
| 500億円超の部分      | 年0.36% | 年0.38% | 年0.02% |

\*「Aコース」「Bコース」合算の純資産総額とします。

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

この他にファンドが投資対象とする投資信託証券に関しても信託報酬等がかかります。

国内籍投資信託の場合、監査費用等の費用も別途かかります。また、外国籍投資信託の場合、ファンドによっては、受託会社、保管受託銀行、管理事務代行会社の報酬、設立費用、監査費用等の費用も別途かかる場合、報酬額等に年間の最低金額が定められている場合があります。

なお、いずれも申込手数料はかかりません。

ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬等の詳細については「(参考)指定投資信託証券について」をご参照ください。

なお、ファンドの信託報酬にファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬（成功報酬を除く）を加えた、受益者が実質的に負担する信託報酬率（成功報酬を除く）について、試算した概算値は以下の通りです。

ただし、この値はあくまでも実質的な信託報酬率の目安であり、ファンドの実際の投資信託証券の組入れ状況等によっては、実質的な信託報酬率は変動します。

| 実質的な信託報酬率(税込・年率)の概算値 |
|----------------------|
| 1.45%±0.10%程度        |

\*ファンドが投資対象とする投資信託証券には、信託報酬に成功報酬制を採用しているものがあり、これらの投資信託証券については、運用実績により成功報酬額も負担することになります。成功報酬を含む信託報酬等の詳細は「(参考)指定投資信託証券について」をご覧ください。

上記の実質的な信託報酬率の概算値は、2021年10月15日現在のものであり、指定投資信託証券の変更等により今後変更となる場合があります。

#### 《支払先の役務の内容》

| <委託会社>                                     | <販売会社>                                       | <受託会社>                      |
|--------------------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------------|
| ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |

#### (4) 【その他の手数料等】

- ①ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入の指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。
- ②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。
- ③ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額はファンドから支払われます。
- ④監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信

託報酬支払いのときにファンドから支払われます。

- ⑤ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額<sup>※</sup>をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.25%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

※「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資家との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、クローズド期間の有無に関係なく、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

※これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

### ■個人、法人別の課税について■

#### ◆個人の投資家に対する課税

##### <収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除は適用されません。

##### <換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

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

### 《損益通算について》

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

| 《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分配金 | 特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の<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<sup>※</sup>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<sup>※</sup>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。

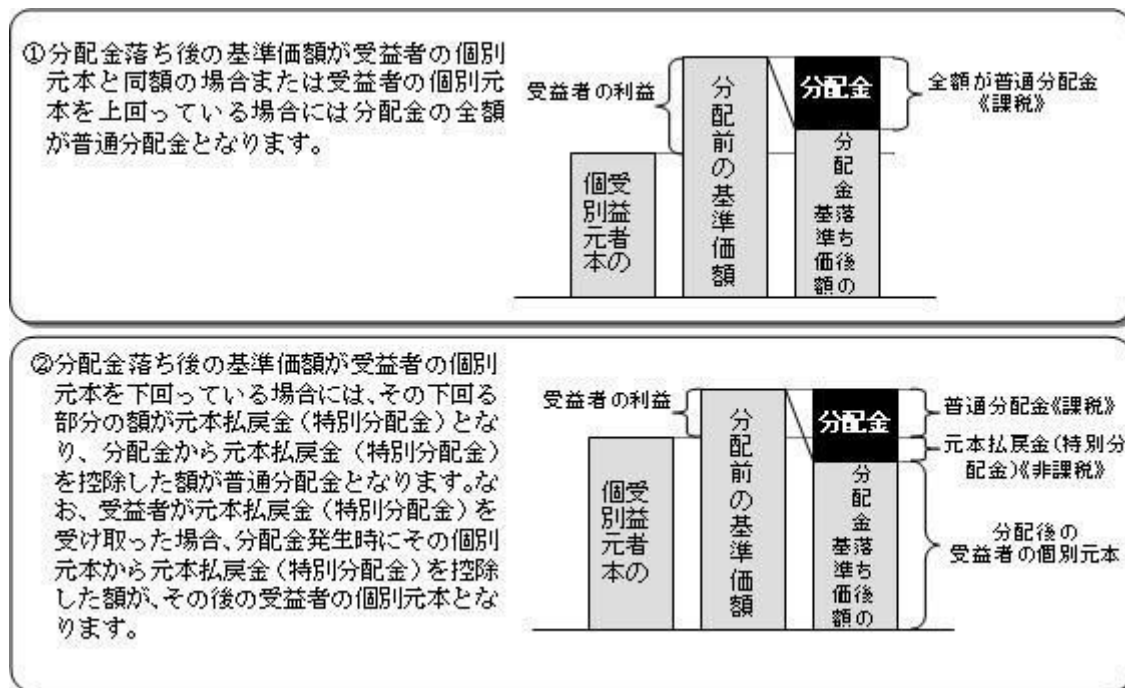
**■個別元本について■**

◆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などには、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】

#### マイストーリー分配型（年6回）Aコース

| 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           | 日本      | 1,025,029,639 | 44.19   |
|                    | ルクセンブルグ | 2,107,485     | 0.09    |
|                    | ケイマン諸島  | 1,266,648,236 | 54.61   |
|                    | 小計      | 2,293,785,360 | 98.90   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —       | 25,359,784    | 1.09    |
| 合計（純資産総額）          |         | 2,319,145,144 | 100.00  |

#### マイストーリー分配型（年6回）Bコース

| 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 | 日本   | 61,253,667,002 | 43.92   |

|                    |         |                 |        |
|--------------------|---------|-----------------|--------|
|                    | ルクセンブルグ | 128,347,212     | 0.09   |
|                    | ケイマン諸島  | 76,999,548,089  | 55.21  |
|                    | 小計      | 138,381,562,303 | 99.23  |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —       | 1,063,180,340   | 0.76   |
| 合計（純資産総額）          |         | 139,444,742,643 | 100.00 |

## （２）【投資資産】

### ①【投資有価証券の主要銘柄】

#### マイストーリー分配型（年６回）Ａコース

| 順位 | 国／<br>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  | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャ<br>ーズ・ファンドⅡ－米国ハイ・イー<br>ルド・ボンドFC | 33,968 | 9,868           | 335,196,224     | 9,897           | 336,181,296     | 14.49           |
| 2  | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャ<br>ーズ・ファンドⅡ－欧州債券FC              | 23,176 | 11,815          | 273,824,440     | 11,804          | 273,569,504     | 11.79           |
| 3  | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャ<br>ーズ・ファンドⅡ－新興国債券FC             | 29,283 | 8,657           | 253,502,931     | 8,645           | 253,151,535     | 10.91           |
| 4  | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ海外債券ファンド（カス<br>タムBM型）FC（適格機関投資家専<br>用）     | 14,165 | 11,982          | 169,725,030     | 12,011          | 170,135,815     | 7.33            |
| 5  | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | ノムラAMP豪州債券ファンドFC<br>（適格機関投資家専用）               | 13,357 | 10,191          | 136,121,187     | 10,223          | 136,548,611     | 5.88            |
| 6  | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | N P E Bバン・ヨーロピアン・ボ<br>ンド・ファンドF C              | 13,060 | 10,402          | 135,850,120     | 10,436          | 136,294,160     | 5.87            |
| 7  | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャ<br>ーズ・ファンドⅣ－欧州ハイ・イー<br>ルド・ボンドFC | 8,657  | 10,398          | 90,021,818      | 10,394          | 89,980,858      | 3.87            |
| 8  | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | 野村エマージング債券ファンドFC<br>（適格機関投資家専用）               | 6,664  | 12,650          | 84,299,600      | 12,703          | 84,652,792      | 3.65            |
| 9  | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャ<br>ーズ・ファンドⅡ－新興国現地通貨<br>建債券FC    | 16,693 | 4,988           | 83,279,408      | 4,958           | 82,763,894      | 3.56            |
| 10 | ケイマン<br>諸島 | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャ<br>ーズ・ファンドⅡ－米国債券FC              | 8,344  | 9,756           | 81,404,064      | 9,730           | 81,187,120      | 3.50            |
| 11 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | ストラテジック・バリュー・オー<br>プンF（適格機関投資家専用）             | 4,176  | 18,146          | 75,778,652      | 18,370          | 76,713,120      | 3.30            |
| 12 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | 野村DEA海外株式バリューファンド<br>F（適格機関投資家専用）             | 5,632  | 12,158          | 68,477,073      | 12,646          | 71,222,272      | 3.07            |
| 13 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | シュローダー日本ファンドF（適<br>格機関投資家専用）                  | 4,600  | 13,939          | 64,122,982      | 14,095          | 64,837,000      | 2.79            |
| 14 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | LM・米国債券コア・プラスFC（適<br>格機関投資家専用）                | 7,047  | 7,624           | 53,726,328      | 7,613           | 53,648,811      | 2.31            |
| 15 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | SJAMバリュー日本株F（適格機関投<br>資家専用）                   | 3,856  | 11,811          | 45,545,235      | 12,044          | 46,441,664      | 2.00            |
| 16 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | One国内株オープンF（F0Fs用）<br>（適格機関投資家専用）             | 3,210  | 13,766          | 44,188,860      | 13,929          | 44,712,090      | 1.92            |
| 17 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | 日本フォーカス・グロースF（適格<br>機関投資家専用）                  | 2,660  | 14,735          | 39,195,100      | 15,473          | 41,158,180      | 1.77            |
| 18 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | ノムラ・ジャパン・オープンF（適<br>格機関投資家専用）                 | 1,671  | 24,522          | 40,977,653      | 24,497          | 40,934,487      | 1.76            |
| 19 | 日本         | 投資信託受<br>益証券 | スパークス・厳選投資・日本株<br>ファンドF（適格機関投資家専用）            | 1,805  | 19,471          | 35,145,155      | 20,311          | 36,661,355      | 1.58            |

|    |         |          |                                                      |       |        |            |        |            |      |
|----|---------|----------|------------------------------------------------------|-------|--------|------------|--------|------------|------|
| 20 | 日本      | 投資信託受益証券 | サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）F（適格機関投資家専用）                    | 3,222 | 10,473 | 33,747,017 | 10,855 | 34,974,810 | 1.50 |
| 21 | 日本      | 投資信託受益証券 | コムジェスト ジャパンエクイティファンドF（適格機関投資家専用）                     | 2,017 | 14,275 | 28,792,675 | 14,366 | 28,976,222 | 1.24 |
| 22 | 日本      | 投資信託受益証券 | グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF（適格機関投資家専用）                   | 621   | 40,403 | 25,090,590 | 42,561 | 26,430,381 | 1.13 |
| 23 | 日本      | 投資信託受益証券 | ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドF（適格機関投資家専用）                     | 1,358 | 17,733 | 24,081,414 | 18,415 | 25,007,570 | 1.07 |
| 24 | ケイマン諸島  | 投資信託受益証券 | ノムラ・ワールド（除く日本）エクイティ・ファンドF                            | 819   | 14,345 | 11,748,555 | 14,851 | 12,162,969 | 0.52 |
| 25 | 日本      | 投資信託受益証券 | アムンディ・ターゲット・ジャパン・ファンドF（適格機関投資家専用）                    | 290   | 36,779 | 10,666,092 | 37,727 | 10,940,830 | 0.47 |
| 26 | 日本      | 投資信託受益証券 | ノムラT&D J Flag日本株 F（適格機関投資家専用）                        | 456   | 19,887 | 9,068,472  | 21,154 | 9,646,224  | 0.41 |
| 27 | 日本      | 投資信託受益証券 | ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）                      | 729   | 10,057 | 7,331,553  | 10,373 | 7,561,917  | 0.32 |
| 28 | 日本      | 投資信託受益証券 | アメリカン・オープンF（適格機関投資家専用）                               | 162   | 38,369 | 6,215,778  | 40,118 | 6,499,116  | 0.28 |
| 29 | 日本      | 投資信託受益証券 | MFS欧州株ファンドF（適格機関投資家専用）                               | 232   | 22,411 | 5,199,352  | 23,406 | 5,430,192  | 0.23 |
| 30 | ルクセンブルグ | 投資信託受益証券 | AB SICAV IーセレクトUSエクイティ・ポートフォリオ クラス S1 シェアーズ（円建て円ヘッジ） | 135   | 14,761 | 1,992,735  | 15,611 | 2,107,485  | 0.09 |

## 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 | 98.90   |
| 合 計      | 98.90   |

## マイストーリー分配型（年6回）Bコース

| 順位 | 国／地域   | 種類       | 銘柄名                                    | 数量        | 簿価単価(円) | 簿価金額(円)        | 評価単価(円) | 評価金額(円)        | 投資比率(%) |
|----|--------|----------|----------------------------------------|-----------|---------|----------------|---------|----------------|---------|
| 1  | ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIIー米国ハイ・イールド・ボンドFD | 1,663,525 | 12,409  | 20,642,681,725 | 12,443  | 20,699,241,575 | 14.84   |
| 2  | ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIIー欧州債券FD          | 1,090,265 | 15,187  | 16,557,854,555 | 15,195  | 16,566,576,675 | 11.88   |
| 3  | ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIIー新興国債券FD         | 1,392,125 | 11,086  | 15,433,097,750 | 11,101  | 15,453,979,625 | 11.08   |
| 4  | 日本     | 投資信託受益証券 | ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FD（適格機関投資家専用）      | 785,941   | 12,925  | 10,158,287,425 | 12,923  | 10,156,715,543 | 7.28    |
| 5  | ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | N P E Bパン・ヨーロッパ・ボンド・ファンドF D            | 794,402   | 10,441  | 8,294,351,282  | 10,435  | 8,289,584,870  | 5.94    |
| 6  | 日本     | 投資信託受益証券 | ノムラAMP豪州債券ファンドFD（適格機関投資家専用）            | 807,637   | 10,227  | 8,259,703,599  | 10,169  | 8,212,860,653  | 5.88    |
| 7  | 日本     | 投資信託受益証券 | 野村エマージング債券ファンドFD（適格機関投資家専用）            | 408,989   | 12,814  | 5,240,785,046  | 12,854  | 5,257,144,606  | 3.77    |
| 8  | ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIVー欧州ハイ・イールド・ボンドFD | 392,985   | 13,076  | 5,138,820,321  | 13,080  | 5,140,243,800  | 3.68    |
| 9  | ケイマン諸島 | 投資信託受益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIIー新興国現地通貨建債券FD    | 861,352   | 5,928   | 5,106,094,656  | 5,906   | 5,087,144,912  | 3.64    |

|    |         |          |                                                 |         |        |               |        |               |      |
|----|---------|----------|-------------------------------------------------|---------|--------|---------------|--------|---------------|------|
| 10 | ケイマン諸島  | 投資信託受益証券 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡー米国債券FD                    | 348,993 | 14,301 | 4,990,948,893 | 14,264 | 4,978,036,152 | 3.56 |
| 11 | 日本      | 投資信託受益証券 | ストラテジック・バリュー・オープンF（適格機関投資家専用）                   | 247,331 | 18,148 | 4,488,686,328 | 18,370 | 4,543,470,470 | 3.25 |
| 12 | 日本      | 投資信託受益証券 | 野村DFA海外株式バリューファンドFB（適格機関投資家専用）                  | 324,926 | 12,744 | 4,140,947,923 | 13,251 | 4,305,594,426 | 3.08 |
| 13 | 日本      | 投資信託受益証券 | シュローダー日本ファンドF（適格機関投資家専用）                        | 272,441 | 13,932 | 3,795,869,423 | 14,095 | 3,840,055,895 | 2.75 |
| 14 | 日本      | 投資信託受益証券 | LM・米国債券コア・プラスFD（適格機関投資家専用）                      | 369,652 | 9,106  | 3,366,051,112 | 9,109  | 3,367,160,068 | 2.41 |
| 15 | 日本      | 投資信託受益証券 | SJAMバリュー日本株F（適格機関投資家専用）                         | 226,141 | 11,813 | 2,671,466,400 | 12,044 | 2,723,642,204 | 1.95 |
| 16 | 日本      | 投資信託受益証券 | One国内株オープンF（F0Fs用）（適格機関投資家専用）                   | 186,341 | 13,766 | 2,565,170,206 | 13,929 | 2,595,543,789 | 1.86 |
| 17 | 日本      | 投資信託受益証券 | ノムラ・ジャパン・オープンF（適格機関投資家専用）                       | 98,713  | 24,518 | 2,420,301,114 | 24,497 | 2,418,172,361 | 1.73 |
| 18 | 日本      | 投資信託受益証券 | 日本フォーカス・グロースF（適格機関投資家専用）                        | 152,834 | 14,735 | 2,252,008,990 | 15,473 | 2,364,800,482 | 1.69 |
| 19 | 日本      | 投資信託受益証券 | サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）FB（適格機関投資家専用）              | 196,933 | 10,540 | 2,075,789,515 | 10,918 | 2,150,114,494 | 1.54 |
| 20 | 日本      | 投資信託受益証券 | スパークス・厳選投資・日本株ファンドF（適格機関投資家専用）                  | 103,947 | 19,471 | 2,023,952,037 | 20,311 | 2,111,267,517 | 1.51 |
| 21 | 日本      | 投資信託受益証券 | コムジェスト ジャパンエクイティファンドF（適格機関投資家専用）                | 118,847 | 14,275 | 1,696,540,925 | 14,366 | 1,707,356,002 | 1.22 |
| 22 | 日本      | 投資信託受益証券 | グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドFB（適格機関投資家専用）             | 33,036  | 46,665 | 1,541,641,739 | 49,092 | 1,621,803,312 | 1.16 |
| 23 | 日本      | 投資信託受益証券 | ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドFB（適格機関投資家専用）               | 77,647  | 17,972 | 1,395,471,884 | 18,653 | 1,448,349,491 | 1.03 |
| 24 | ケイマン諸島  | 投資信託受益証券 | ノムラ・ワールド（除く日本）エクイティ・ファンドFB                      | 48,372  | 13,864 | 670,629,408   | 14,340 | 693,654,480   | 0.49 |
| 25 | 日本      | 投資信託受益証券 | アムンディ・ターゲット・ジャパン・ファンドF（適格機関投資家専用）               | 17,129  | 36,779 | 630,000,462   | 37,727 | 646,225,783   | 0.46 |
| 26 | 日本      | 投資信託受益証券 | ノムラT&D J Flag日本株 F（適格機関投資家専用）                   | 25,967  | 19,887 | 516,405,729   | 21,154 | 549,305,918   | 0.39 |
| 27 | 日本      | 投資信託受益証券 | ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドFB（適格機関投資家専用）                | 42,066  | 10,175 | 428,021,550   | 10,481 | 440,893,746   | 0.31 |
| 28 | 日本      | 投資信託受益証券 | アメリカン・オープンFB（適格機関投資家専用）                         | 7,532   | 47,006 | 354,049,192   | 49,103 | 369,843,796   | 0.26 |
| 29 | 日本      | 投資信託受益証券 | MFS欧州株ファンドFB（適格機関投資家専用）                         | 17,754  | 17,926 | 318,258,204   | 18,731 | 332,550,174   | 0.23 |
| 30 | ルクセンブルグ | 投資信託受益証券 | AB SICAV IーセレクトUSエクイティ・ポートフォリオ クラス S1シェアーズ（円建て） | 8,092   | 14,936 | 120,862,112   | 15,861 | 128,347,212   | 0.09 |

## 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 | 99.23   |
| 合 計      | 99.23   |

## ②【投資不動産物件】

### マイストーリー分配型（年6回）Aコース

該当事項はありません。



## マイストーリー分配型（年6回）Bコース

該当事項はありません。

## ③【その他投資資産の主要なもの】

## マイストーリー分配型（年6回）Aコース

該当事項はありません。

## マイストーリー分配型（年6回）Bコース

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

## ①【純資産の推移】

## マイストーリー分配型（年6回）Aコース

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13特定期間 | (2012年 1月20日) | 2,627      | 2,654 | 0.8624       | 0.8712 |
| 第14特定期間 | (2012年 7月20日) | 2,338      | 2,346 | 0.8981       | 0.9011 |
| 第15特定期間 | (2013年 1月21日) | 2,238      | 2,245 | 0.9707       | 0.9737 |
| 第16特定期間 | (2013年 7月22日) | 2,285      | 2,292 | 1.0153       | 1.0183 |
| 第17特定期間 | (2014年 1月20日) | 2,126      | 2,132 | 1.0398       | 1.0428 |
| 第18特定期間 | (2014年 7月22日) | 2,337      | 2,343 | 1.0630       | 1.0660 |
| 第19特定期間 | (2015年 1月20日) | 2,287      | 2,293 | 1.0743       | 1.0773 |
| 第20特定期間 | (2015年 7月21日) | 2,414      | 2,421 | 1.1082       | 1.1112 |
| 第21特定期間 | (2016年 1月20日) | 2,177      | 2,183 | 1.0296       | 1.0326 |
| 第22特定期間 | (2016年 7月20日) | 2,260      | 2,266 | 1.0827       | 1.0857 |
| 第23特定期間 | (2017年 1月20日) | 2,037      | 2,043 | 1.0992       | 1.1022 |
| 第24特定期間 | (2017年 7月20日) | 2,157      | 2,163 | 1.1332       | 1.1362 |
| 第25特定期間 | (2018年 1月22日) | 2,238      | 2,244 | 1.1775       | 1.1805 |
| 第26特定期間 | (2018年 7月20日) | 2,249      | 2,255 | 1.1349       | 1.1379 |
| 第27特定期間 | (2019年 1月21日) | 2,311      | 2,317 | 1.0815       | 1.0845 |
| 第28特定期間 | (2019年 7月22日) | 2,362      | 2,368 | 1.1239       | 1.1269 |
| 第29特定期間 | (2020年 1月20日) | 2,197      | 2,202 | 1.1570       | 1.1600 |
| 第30特定期間 | (2020年 7月20日) | 2,065      | 2,071 | 1.1247       | 1.1277 |
| 第31特定期間 | (2021年 1月20日) | 2,277      | 2,283 | 1.2081       | 1.2111 |

|         |               |       |       |        |        |
|---------|---------------|-------|-------|--------|--------|
| 第32特定期間 | (2021年 7月20日) | 2,291 | 2,297 | 1.2158 | 1.2188 |
|         | 2020年 8月末日    | 2,090 | —     | 1.1484 | —      |
|         | 9月末日          | 2,087 | —     | 1.1463 | —      |
|         | 10月末日         | 2,109 | —     | 1.1447 | —      |
|         | 11月末日         | 2,201 | —     | 1.1934 | —      |
|         | 12月末日         | 2,245 | —     | 1.2081 | —      |
|         | 2021年 1月末日    | 2,260 | —     | 1.2038 | —      |
|         | 2月末日          | 2,342 | —     | 1.2089 | —      |
|         | 3月末日          | 2,281 | —     | 1.2064 | —      |
|         | 4月末日          | 2,298 | —     | 1.2096 | —      |
|         | 5月末日          | 2,300 | —     | 1.2127 | —      |
|         | 6月末日          | 2,297 | —     | 1.2190 | —      |
|         | 7月末日          | 2,308 | —     | 1.2213 | —      |
|         | 8月末日          | 2,319 | —     | 1.2254 | —      |

## マイストーリー分配型（年6回）Bコース

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13特定期間 | (2012年 1月20日) | 312,155    | 318,214 | 0.5564       | 0.5672 |
| 第14特定期間 | (2012年 7月20日) | 291,155    | 293,678 | 0.5770       | 0.5820 |
| 第15特定期間 | (2013年 1月21日) | 310,259    | 311,588 | 0.7006       | 0.7036 |
| 第16特定期間 | (2013年 7月22日) | 303,299    | 304,459 | 0.7842       | 0.7872 |
| 第17特定期間 | (2014年 1月20日) | 281,674    | 282,689 | 0.8329       | 0.8359 |
| 第18特定期間 | (2014年 7月22日) | 256,192    | 257,110 | 0.8367       | 0.8397 |
| 第19特定期間 | (2015年 1月20日) | 246,637    | 247,457 | 0.9029       | 0.9059 |
| 第20特定期間 | (2015年 7月21日) | 239,000    | 239,750 | 0.9560       | 0.9590 |
| 第21特定期間 | (2016年 1月20日) | 198,312    | 199,018 | 0.8429       | 0.8459 |
| 第22特定期間 | (2016年 7月20日) | 185,840    | 186,518 | 0.8220       | 0.8250 |
| 第23特定期間 | (2017年 1月20日) | 185,468    | 186,100 | 0.8799       | 0.8829 |
| 第24特定期間 | (2017年 7月20日) | 181,191    | 181,786 | 0.9146       | 0.9176 |
| 第25特定期間 | (2018年 1月22日) | 178,725    | 179,283 | 0.9608       | 0.9638 |
| 第26特定期間 | (2018年 7月20日) | 166,939    | 167,481 | 0.9249       | 0.9279 |
| 第27特定期間 | (2019年 1月21日) | 150,154    | 150,678 | 0.8595       | 0.8625 |
| 第28特定期間 | (2019年 7月22日) | 148,711    | 149,217 | 0.8821       | 0.8851 |
| 第29特定期間 | (2020年 1月20日) | 149,271    | 149,754 | 0.9272       | 0.9302 |
| 第30特定期間 | (2020年 7月20日) | 137,190    | 137,656 | 0.8838       | 0.8868 |
| 第31特定期間 | (2021年 1月20日) | 140,016    | 140,459 | 0.9474       | 0.9504 |
| 第32特定期間 | (2021年 7月20日) | 139,224    | 139,647 | 0.9876       | 0.9906 |
|         | 2020年 8月末日    | 140,133    | —       | 0.9100       | —      |

|            |         |   |        |   |
|------------|---------|---|--------|---|
| 9月末日       | 137,315 | — | 0.8958 | — |
| 10月末日      | 135,306 | — | 0.8881 | — |
| 11月末日      | 140,066 | — | 0.9304 | — |
| 12月末日      | 140,891 | — | 0.9477 | — |
| 2021年 1月末日 | 139,209 | — | 0.9463 | — |
| 2月末日       | 141,051 | — | 0.9698 | — |
| 3月末日       | 141,798 | — | 0.9832 | — |
| 4月末日       | 140,864 | — | 0.9860 | — |
| 5月末日       | 142,136 | — | 0.9982 | — |
| 6月末日       | 141,637 | — | 1.0008 | — |
| 7月末日       | 139,964 | — | 0.9938 | — |
| 8月末日       | 139,444 | — | 0.9950 | — |

## ②【分配の推移】

### マイストーリー分配型（年6回）Aコース

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第13特定期間 | 2011年 7月21日～2012年 1月20日 | 0.0164円   |
| 第14特定期間 | 2012年 1月21日～2012年 7月20日 | 0.0106円   |
| 第15特定期間 | 2012年 7月21日～2013年 1月21日 | 0.0090円   |
| 第16特定期間 | 2013年 1月22日～2013年 7月22日 | 0.0090円   |
| 第17特定期間 | 2013年 7月23日～2014年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第18特定期間 | 2014年 1月21日～2014年 7月22日 | 0.0090円   |
| 第19特定期間 | 2014年 7月23日～2015年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第20特定期間 | 2015年 1月21日～2015年 7月21日 | 0.0090円   |
| 第21特定期間 | 2015年 7月22日～2016年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第22特定期間 | 2016年 1月21日～2016年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第23特定期間 | 2016年 7月21日～2017年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第24特定期間 | 2017年 1月21日～2017年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第25特定期間 | 2017年 7月21日～2018年 1月22日 | 0.0090円   |
| 第26特定期間 | 2018年 1月23日～2018年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第27特定期間 | 2018年 7月21日～2019年 1月21日 | 0.0090円   |
| 第28特定期間 | 2019年 1月22日～2019年 7月22日 | 0.0090円   |
| 第29特定期間 | 2019年 7月23日～2020年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第30特定期間 | 2020年 1月21日～2020年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第31特定期間 | 2020年 7月21日～2021年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第32特定期間 | 2021年 1月21日～2021年 7月20日 | 0.0090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。

### マイストーリー分配型（年6回）Bコース

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第13特定期間 | 2011年 7月21日～2012年 1月20日 | 0.0224円   |
| 第14特定期間 | 2012年 1月21日～2012年 7月20日 | 0.0166円   |
| 第15特定期間 | 2012年 7月21日～2013年 1月21日 | 0.0130円   |
| 第16特定期間 | 2013年 1月22日～2013年 7月22日 | 0.0090円   |
| 第17特定期間 | 2013年 7月23日～2014年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第18特定期間 | 2014年 1月21日～2014年 7月22日 | 0.0090円   |
| 第19特定期間 | 2014年 7月23日～2015年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第20特定期間 | 2015年 1月21日～2015年 7月21日 | 0.0090円   |
| 第21特定期間 | 2015年 7月22日～2016年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第22特定期間 | 2016年 1月21日～2016年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第23特定期間 | 2016年 7月21日～2017年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第24特定期間 | 2017年 1月21日～2017年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第25特定期間 | 2017年 7月21日～2018年 1月22日 | 0.0090円   |
| 第26特定期間 | 2018年 1月23日～2018年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第27特定期間 | 2018年 7月21日～2019年 1月21日 | 0.0090円   |
| 第28特定期間 | 2019年 1月22日～2019年 7月22日 | 0.0090円   |
| 第29特定期間 | 2019年 7月23日～2020年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第30特定期間 | 2020年 1月21日～2020年 7月20日 | 0.0090円   |
| 第31特定期間 | 2020年 7月21日～2021年 1月20日 | 0.0090円   |
| 第32特定期間 | 2021年 1月21日～2021年 7月20日 | 0.0090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。

### ③【収益率の推移】

#### マイストーリー分配型（年6回）Aコース

|         | 計算期間                    | 収益率   |
|---------|-------------------------|-------|
| 第13特定期間 | 2011年 7月21日～2012年 1月20日 | △2.1% |
| 第14特定期間 | 2012年 1月21日～2012年 7月20日 | 5.4%  |
| 第15特定期間 | 2012年 7月21日～2013年 1月21日 | 9.1%  |
| 第16特定期間 | 2013年 1月22日～2013年 7月22日 | 5.5%  |
| 第17特定期間 | 2013年 7月23日～2014年 1月20日 | 3.3%  |
| 第18特定期間 | 2014年 1月21日～2014年 7月22日 | 3.1%  |
| 第19特定期間 | 2014年 7月23日～2015年 1月20日 | 1.9%  |
| 第20特定期間 | 2015年 1月21日～2015年 7月21日 | 4.0%  |
| 第21特定期間 | 2015年 7月22日～2016年 1月20日 | △6.3% |
| 第22特定期間 | 2016年 1月21日～2016年 7月20日 | 6.0%  |
| 第23特定期間 | 2016年 7月21日～2017年 1月20日 | 2.4%  |
| 第24特定期間 | 2017年 1月21日～2017年 7月20日 | 3.9%  |

|         |                         |       |
|---------|-------------------------|-------|
| 第25特定期間 | 2017年 7月21日～2018年 1月22日 | 4.7%  |
| 第26特定期間 | 2018年 1月23日～2018年 7月20日 | △2.9% |
| 第27特定期間 | 2018年 7月21日～2019年 1月21日 | △3.9% |
| 第28特定期間 | 2019年 1月22日～2019年 7月22日 | 4.8%  |
| 第29特定期間 | 2019年 7月23日～2020年 1月20日 | 3.7%  |
| 第30特定期間 | 2020年 1月21日～2020年 7月20日 | △2.0% |
| 第31特定期間 | 2020年 7月21日～2021年 1月20日 | 8.2%  |
| 第32特定期間 | 2021年 1月21日～2021年 7月20日 | 1.4%  |

※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。

#### マイストーリー分配型（年6回）Bコース

|         | 計算期間                    | 収益率    |
|---------|-------------------------|--------|
| 第13特定期間 | 2011年 7月21日～2012年 1月20日 | △6.3%  |
| 第14特定期間 | 2012年 1月21日～2012年 7月20日 | 6.7%   |
| 第15特定期間 | 2012年 7月21日～2013年 1月21日 | 23.7%  |
| 第16特定期間 | 2013年 1月22日～2013年 7月22日 | 13.2%  |
| 第17特定期間 | 2013年 7月23日～2014年 1月20日 | 7.4%   |
| 第18特定期間 | 2014年 1月21日～2014年 7月22日 | 1.5%   |
| 第19特定期間 | 2014年 7月23日～2015年 1月20日 | 9.0%   |
| 第20特定期間 | 2015年 1月21日～2015年 7月21日 | 6.9%   |
| 第21特定期間 | 2015年 7月22日～2016年 1月20日 | △10.9% |
| 第22特定期間 | 2016年 1月21日～2016年 7月20日 | △1.4%  |
| 第23特定期間 | 2016年 7月21日～2017年 1月20日 | 8.1%   |
| 第24特定期間 | 2017年 1月21日～2017年 7月20日 | 5.0%   |
| 第25特定期間 | 2017年 7月21日～2018年 1月22日 | 6.0%   |
| 第26特定期間 | 2018年 1月23日～2018年 7月20日 | △2.8%  |
| 第27特定期間 | 2018年 7月21日～2019年 1月21日 | △6.1%  |
| 第28特定期間 | 2019年 1月22日～2019年 7月22日 | 3.7%   |
| 第29特定期間 | 2019年 7月23日～2020年 1月20日 | 6.1%   |
| 第30特定期間 | 2020年 1月21日～2020年 7月20日 | △3.7%  |
| 第31特定期間 | 2020年 7月21日～2021年 1月20日 | 8.2%   |
| 第32特定期間 | 2021年 1月21日～2021年 7月20日 | 5.2%   |

※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】

## マイストーリー分配型（年6回）Aコース

|         | 計算期間                    | 設定口数        | 解約口数        | 発行済み口数        |
|---------|-------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第13特定期間 | 2011年 7月21日～2012年 1月20日 | 87,618,576  | 363,745,787 | 3,047,404,148 |
| 第14特定期間 | 2012年 1月21日～2012年 7月20日 | 59,289,087  | 502,746,337 | 2,603,946,898 |
| 第15特定期間 | 2012年 7月21日～2013年 1月21日 | 39,999,372  | 338,139,424 | 2,305,806,846 |
| 第16特定期間 | 2013年 1月22日～2013年 7月22日 | 194,010,769 | 248,879,986 | 2,250,937,629 |
| 第17特定期間 | 2013年 7月23日～2014年 1月20日 | 30,426,345  | 236,111,279 | 2,045,252,695 |
| 第18特定期間 | 2014年 1月21日～2014年 7月22日 | 286,048,057 | 132,719,422 | 2,198,581,330 |
| 第19特定期間 | 2014年 7月23日～2015年 1月20日 | 49,664,152  | 119,275,862 | 2,128,969,620 |
| 第20特定期間 | 2015年 1月21日～2015年 7月21日 | 160,209,545 | 110,121,806 | 2,179,057,359 |
| 第21特定期間 | 2015年 7月22日～2016年 1月20日 | 44,642,612  | 109,000,096 | 2,114,699,875 |
| 第22特定期間 | 2016年 1月21日～2016年 7月20日 | 63,004,219  | 89,678,170  | 2,088,025,924 |
| 第23特定期間 | 2016年 7月21日～2017年 1月20日 | 43,982,591  | 278,131,178 | 1,853,877,337 |
| 第24特定期間 | 2017年 1月21日～2017年 7月20日 | 88,060,268  | 38,050,725  | 1,903,886,880 |
| 第25特定期間 | 2017年 7月21日～2018年 1月22日 | 69,186,387  | 71,793,364  | 1,901,279,903 |
| 第26特定期間 | 2018年 1月23日～2018年 7月20日 | 127,933,974 | 47,035,970  | 1,982,177,907 |
| 第27特定期間 | 2018年 7月21日～2019年 1月21日 | 188,880,201 | 33,738,358  | 2,137,319,750 |
| 第28特定期間 | 2019年 1月22日～2019年 7月22日 | 98,074,806  | 133,464,193 | 2,101,930,363 |
| 第29特定期間 | 2019年 7月23日～2020年 1月20日 | 20,407,102  | 223,377,116 | 1,898,960,349 |
| 第30特定期間 | 2020年 1月21日～2020年 7月20日 | 42,094,400  | 104,366,697 | 1,836,688,052 |
| 第31特定期間 | 2020年 7月21日～2021年 1月20日 | 116,440,931 | 67,573,408  | 1,885,555,575 |
| 第32特定期間 | 2021年 1月21日～2021年 7月20日 | 155,969,724 | 156,444,878 | 1,885,080,421 |

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## マイストーリー分配型（年6回）Bコース

|         | 計算期間                    | 設定口数          | 解約口数           | 発行済み口数          |
|---------|-------------------------|---------------|----------------|-----------------|
| 第13特定期間 | 2011年 7月21日～2012年 1月20日 | 6,015,863,774 | 93,854,014,321 | 561,000,739,720 |
| 第14特定期間 | 2012年 1月21日～2012年 7月20日 | 5,776,159,549 | 62,203,085,136 | 504,573,814,133 |
| 第15特定期間 | 2012年 7月21日～2013年 1月21日 | 3,461,952,038 | 65,187,623,632 | 442,848,142,539 |
| 第16特定期間 | 2013年 1月22日～2013年 7月22日 | 1,809,552,377 | 57,881,702,884 | 386,775,992,032 |
| 第17特定期間 | 2013年 7月23日～2014年 1月20日 | 1,404,580,126 | 49,995,072,001 | 338,185,500,157 |
| 第18特定期間 | 2014年 1月21日～2014年 7月22日 | 1,060,801,175 | 33,041,395,858 | 306,204,905,474 |
| 第19特定期間 | 2014年 7月23日～2015年 1月20日 | 868,792,827   | 33,897,301,320 | 273,176,396,981 |
| 第20特定期間 | 2015年 1月21日～2015年 7月21日 | 878,259,475   | 24,047,305,321 | 250,007,351,135 |
| 第21特定期間 | 2015年 7月22日～2016年 1月20日 | 828,101,216   | 15,549,852,121 | 235,285,600,230 |
| 第22特定期間 | 2016年 1月21日～2016年 7月20日 | 762,742,021   | 9,971,496,254  | 226,076,845,997 |
| 第23特定期間 | 2016年 7月21日～2017年 1月20日 | 695,592,520   | 15,979,261,396 | 210,793,177,121 |
| 第24特定期間 | 2017年 1月21日～2017年 7月20日 | 624,482,088   | 13,312,002,495 | 198,105,656,714 |

|         |                         |             |                |                 |
|---------|-------------------------|-------------|----------------|-----------------|
| 第25特定期間 | 2017年 7月21日～2018年 1月22日 | 805,878,170 | 12,899,807,398 | 186,011,727,486 |
| 第26特定期間 | 2018年 1月23日～2018年 7月20日 | 887,163,551 | 6,411,249,580  | 180,487,641,457 |
| 第27特定期間 | 2018年 7月21日～2019年 1月21日 | 565,100,376 | 6,351,755,727  | 174,700,986,106 |
| 第28特定期間 | 2019年 1月22日～2019年 7月22日 | 644,932,244 | 6,766,988,369  | 168,578,929,981 |
| 第29特定期間 | 2019年 7月23日～2020年 1月20日 | 654,554,861 | 8,239,064,173  | 160,994,420,669 |
| 第30特定期間 | 2020年 1月21日～2020年 7月20日 | 623,900,505 | 6,397,932,170  | 155,220,389,004 |
| 第31特定期間 | 2020年 7月21日～2021年 1月20日 | 539,847,313 | 7,976,702,279  | 147,783,534,038 |
| 第32特定期間 | 2021年 1月21日～2021年 7月20日 | 482,736,433 | 7,299,191,704  | 140,967,078,767 |

※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》



## 運用実績（2021年8月31日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

| IAコース    |         |
|----------|---------|
| 2021年7月  | 30 円    |
| 2021年5月  | 30 円    |
| 2021年3月  | 30 円    |
| 2021年1月  | 30 円    |
| 2020年11月 | 30 円    |
| 直近1年間累計  | 180 円   |
| 設定来累計    | 3,702 円 |

| IBコース    |         |
|----------|---------|
| 2021年7月  | 30 円    |
| 2021年5月  | 30 円    |
| 2021年3月  | 30 円    |
| 2021年1月  | 30 円    |
| 2020年11月 | 30 円    |
| 直近1年間累計  | 180 円   |
| 設定来累計    | 6,334 円 |

### ■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率（上位）

#### IAコース

| 順位 | 銘柄                                    | 投資比率（％） |
|----|---------------------------------------|---------|
| 1  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国ハイ・イールド・ボンドFC | 14.5    |
| 2  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－欧州債券FC          | 11.8    |
| 3  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国債券FC         | 10.9    |
| 4  | ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FC（適格機関投資家専用）     | 7.3     |
| 5  | ノムラ－AMP豪州債券ファンドFC（適格機関投資家専用）          | 5.9     |
| 6  | N P E Bバン・ヨーロッパ・ボンド・ファンドFC            | 5.9     |
| 7  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・ボンドFC | 3.9     |
| 8  | 野村エマージング債券ファンドFC（適格機関投資家専用）           | 3.7     |
| 9  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国現地通貨建債券FC    | 3.6     |
| 10 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国債券FC          | 3.5     |

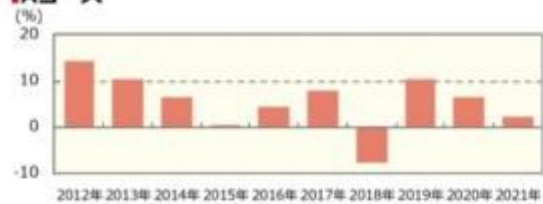
#### IBコース

| 順位 | 銘柄                                    | 投資比率（％） |
|----|---------------------------------------|---------|
| 1  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国ハイ・イールド・ボンドFD | 14.8    |
| 2  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－欧州債券FD          | 11.9    |
| 3  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国債券FD         | 11.1    |
| 4  | ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FD（適格機関投資家専用）     | 7.3     |
| 5  | N P E Bバン・ヨーロッパ・ボンド・ファンドFD            | 5.9     |
| 6  | ノムラ－AMP豪州債券ファンドFD（適格機関投資家専用）          | 5.9     |
| 7  | 野村エマージング債券ファンドFD（適格機関投資家専用）           | 3.8     |
| 8  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・ボンドFD | 3.7     |
| 9  | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国現地通貨建債券FD    | 3.6     |
| 10 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国債券FD          | 3.6     |



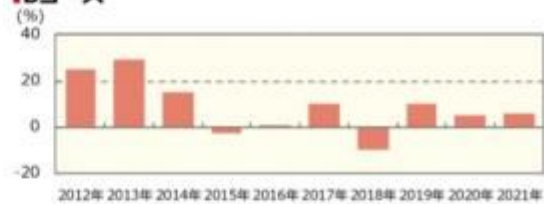
## ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

### ■ Aコース



- ・ ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ 2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

### ■ Bコース



●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2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれません。

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

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

販売の単位は、「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

なお、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合や、取得申込単位が前記と異なる場合等があります。原則として、お買付け後のコース変更はできません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## ■積立方式■

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約<sup>※</sup>を締結した場合、当該契約で規定する取得申込みの単位でお申込みいただけます。

※当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

スイッチングによる申込みは、「一般コース」を選択した投資者は1万口以上1万口単位または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者は1万円以上1円単位からできます。なお、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者がスイッチングに際し、当該投資者が保有する「マイストーリー分配型(年6回)Aコース」または「マイストーリー分配型(年6回)Bコース」の受益権の全てをご換金した場合の手取金の全額をもって取得申込みする場合は1口単位とします。(販売会社によっては、スイッチングのお取扱いを行わない場合があります。)

受益権の販売価額は、取得申込日の翌々営業日の基準価額とします。

金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込(スイッチングの申込みを含みます)の受付けを中止すること、およびすでに受付けた取得申込(スイッチングの申込みを含みます)の受付けを取り消す場合があります。<sup>※</sup>

※上記の買付のお申込みの受付けの中止等を行なう事情等によっては、スイッチングのお申込みについては可能な場合もあります。

また、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として取得およびスイッチングの申込ができません。(申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。)

※取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申

込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、受益権を、「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

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

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、解約申込み受付日の翌々営業日の基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

信託財産留保額は、基準価額に0.25%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超える一部解約は行なえません。この他に、別途、大口解約には制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。

なお、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付を行いません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

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

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

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

録が行なわれます。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### （１）【資産の評価】

##### ＜基準価額の計算方法＞

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

※一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象     | 評価方法                           |
|--------|--------------------------------|
| 投資信託証券 | 原則として、基準価額計算日の前営業日の基準価額で評価します。 |

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

#### （２）【保管】

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

#### （３）【信託期間】

無期限とします(2005年5月30日設定)。

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から3月20日まで、3月21日から5月20日まで、5月21日から7月20日まで、7月21日から9月20日まで、9月21日から11月20日までおよび11月21日から翌年1月20日までとします。

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

#### （５）【その他】

#### (a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託契約の一部解約により各ファンドにつき受益権の口数が50億口を下回った場合またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはその他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、信託終了日前にこの信託契約を解約し、信託を終了させる場合があります。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

#### (b) 信託期間の終了

- (i) 委託者は、上記「(a) ファンドの繰上償還条項」にしたがい信託を終了させる場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ii) 上記(i)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (iii) 上記(ii)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。
- (iv) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (v) 上記(ii)から(iv)までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ii)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (vi) 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- (vii) 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(e) 信託約款の変更(iv)」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- (viii) 受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### (c) 運用報告書

委託者は、毎年1月、7月に終了する計算期間の末日および償還時に、各々交付運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

#### (d) 有価証券報告書

委託者は、有価証券報告書を原則毎年1月、7月の決算日を基準に作成し3ヵ月以内に関東財務局長に提出します。

#### (e) 信託約款の変更

- (i) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- (ii) 委託者は、上記(i)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しよう

とする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

(vi) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記(i)から(v)までの規定にしたがいます。

#### (f) 公告

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

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

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

#### (g) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、前述の「(b)信託期間の終了」(i)または「(e)信託約款の変更」(ii)に規定する公告または書面に付記します。

#### (h) 関係法人との契約の更新に関する手続

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則1年毎に自動的に更新されるものとします。

## 4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### ① 収益分配金に対する請求権

#### ■ 収益分配金の支払い開始日 ■

##### < 自動けいぞく投資契約を結んでいない場合 >

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

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

##### < 自動けいぞく投資契約を結んでいる場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算

期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

②償還金に対する請求権

■償還金の支払い開始日■

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

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③換金(解約)請求権

■換金(解約)の単位■

受益者は、受益権を「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

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

■換金(解約)代金の支払い開始日■

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、7営業日目から受益者にお支払いします。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

### 第3【ファンドの経理状況】

マイストーリー分配型（年6回）Aコース

マイストーリー分配型（年6回）Bコース

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

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2021年1月21日から2021年7月20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】



## 【マイストーリー分配型（年6回）Aコース】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 前期<br>(2021年 1月20日現在) | 当期<br>(2021年 7月20日現在) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部            |                       |                       |
| 流動資産            |                       |                       |
| コール・ローン         | 49,885,027            | 29,328,415            |
| 投資信託受益証券        | 2,243,932,484         | 2,268,741,903         |
| 未収入金            | 11,190,868            | -                     |
| 未収配当金           | 2,316,720             | 2,783,505             |
| 流動資産合計          | 2,307,325,099         | 2,300,853,823         |
| 資産合計            | 2,307,325,099         | 2,300,853,823         |
| 負債の部            |                       |                       |
| 流動負債            |                       |                       |
| 未払金             | 20,405,342            | -                     |
| 未払収益分配金         | 5,656,666             | 5,655,241             |
| 未払解約金           | 233,366               | 4,000                 |
| 未払受託者報酬         | 96,637                | 98,392                |
| 未払委託者報酬         | 3,012,763             | 3,118,494             |
| 未払利息            | 30                    | 27                    |
| その他未払費用         | 8,164                 | 8,444                 |
| 流動負債合計          | 29,412,968            | 8,884,598             |
| 負債合計            | 29,412,968            | 8,884,598             |
| 純資産の部           |                       |                       |
| 元本等             |                       |                       |
| 元本              | 1,885,555,575         | 1,885,080,421         |
| 剰余金             |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 392,356,556           | 406,888,804           |
| （分配準備積立金）       | 313,097,866           | 302,665,635           |
| 元本等合計           | 2,277,912,131         | 2,291,969,225         |
| 純資産合計           | 2,277,912,131         | 2,291,969,225         |
| 負債純資産合計         | 2,307,325,099         | 2,300,853,823         |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日 | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日 |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                      |                                      |
| 受取配当金                                     | 23,051,398                           | 22,421,178                           |
| 有価証券売買等損益                                 | 155,352,327                          | 18,505,028                           |
| その他収益                                     | 606,680                              | -                                    |
| 営業収益合計                                    | 179,010,405                          | 40,926,206                           |
| 営業費用                                      |                                      |                                      |
| 支払利息                                      | 4,224                                | 3,773                                |
| 受託者報酬                                     | 283,271                              | 293,280                              |
| 委託者報酬                                     | 8,752,213                            | 9,267,588                            |
| その他費用                                     | 23,717                               | 25,104                               |
| 営業費用合計                                    | 9,063,425                            | 9,589,745                            |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 169,946,980                          | 31,336,461                           |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 169,946,980                          | 31,336,461                           |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 169,946,980                          | 31,336,461                           |
| 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（△） | 1,249,185                            | 569,883                              |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 229,007,073                          | 392,356,556                          |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 21,014,164                           | 32,810,675                           |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 21,014,164                           | 32,810,675                           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 9,721,586                            | 31,859,839                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 9,721,586                            | 31,859,839                           |
| 分配金                                       | 16,640,890                           | 17,185,166                           |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 392,356,556                          | 406,888,804                          |

## (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。             |
| 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。                                                |
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4.その他                 | 当該財務諸表の特定期間は、2021年 1月21日から2021年 7月20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 1月20日現在                                                           | 当期<br>2021年 7月20日現在                                                           |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>1,885,555,575口                                        | 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>1,885,080,421口                                        |
| 2. 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 1.2081円<br>(10,000口当たり純資産額) (12,081円) | 2. 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 1.2158円<br>(10,000口当たり純資産額) (12,158円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日                                                                                                                                             | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日     |            |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|------------|--|--------------|---|------------|---------------------------|---|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|------------|---------------------------|---|----------|
| 1.分配金の計算過程<br>2020年 7月21日から2020年 9月23日まで                                                                                                                                         | 1.分配金の計算過程<br>2021年 1月21日から2021年 3月22日まで |            |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |
| <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>8,029,383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></table> | 項目                                       |            |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 8,029,383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 | <table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>4,285,342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>432,314円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 4,285,342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 | 432,314円 |
| 項目                                                                                                                                                                               |                                          |            |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                     | A                                        | 8,029,383円 |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                        | B                                        | 0円         |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |
| 項目                                                                                                                                                                               |                                          |            |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                     | A                                        | 4,285,342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                                        | 432,314円   |  |              |   |            |                           |   |    |                                                                                                                                                                                        |    |  |  |              |   |            |                           |   |          |

|                   |              |                |
|-------------------|--------------|----------------|
| 収益調整金額            | C            | 163,215,110円   |
| 分配準備積立金額          | D            | 223,063,186円   |
| 当ファンドの分配対象収益額     | E=A+B+C+D    | 394,307,679円   |
| 当ファンドの期末残存口数      | F            | 1,813,432,807口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 2,174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 | 5,440,298円     |

2020年 9月24日から2020年11月20日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 7,580,400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            | 36,006,524円    |
| 収益調整金額                    | C            | 172,321,106円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 224,059,052円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 439,967,082円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 1,847,975,387口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,380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 | 5,543,926円     |

2020年11月21日から2021年 1月20日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 6,788,280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            | 52,695,712円    |
| 収益調整金額                    | C            | 184,116,735円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 259,270,540円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 502,871,267円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 1,885,555,575口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,666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 | 5,656,666円     |

|                   |              |                |
|-------------------|--------------|----------------|
| 収益調整金額            | C            | 208,857,843円   |
| 分配準備積立金額          | D            | 304,438,188円   |
| 当ファンドの分配対象収益額     | E=A+B+C+D    | 518,013,687円   |
| 当ファンドの期末残存口数      | F            | 1,945,850,058口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 2,662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 | 5,837,550円     |

2021年 3月23日から2021年 5月20日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 4,405,817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            | 207,339,663円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 292,331,518円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 504,076,998円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 1,897,458,512口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,656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 | 5,692,375円     |

2021年 5月21日から2021年 7月20日まで

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 6,940,583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            | 14,888,800円    |
| 収益調整金額                    | C            | 208,728,893円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 286,491,493円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 517,049,769円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 1,885,080,421口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 2,742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 | 5,655,241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 7月21日<br>至 2021年 1月20日                                                                                         | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|
| <b>1.金融商品に対する取組方針</b><br>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。 | <b>1.金融商品に対する取組方針</b><br>同左          |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                            |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| <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、株価変動リスク、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>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 1月20日現在                                                                                                                                                                                                                                 | 当期<br>2021年 7月20日現在                                             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| <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<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。</p> <p>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。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日                                  | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20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 7月21日<br>至 2021年 1月20日 |                | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日 |                |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------------------|----------------|
| 期首元本額                                | 1,836,688,052円 | 期首元本額                                | 1,885,555,575円 |
| 期中追加設定元本額                            | 116,440,931円   | 期中追加設定元本額                            | 155,969,724円   |
| 期中一部解約元本額                            | 67,573,408円    | 期中一部解約元本額                            | 156,444,878円   |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類       | 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日 | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20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 | 52,352,844                           | 28,743,747                           |
| 合計       | 52,352,844                           | 28,743,747                           |

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式(2021年7月20日現在)

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券(2021年7月20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 | ノムラ・ジャパン・オープンF（適格機関投資家専用）         | 1,609 | 39,441,417 |    |
|          |     | アメリカン・オープンF（適格機関投資家専用）            | 162   | 6,215,778  |    |
|          |     | アムンディ・ターゲット・ジャパン・ファンドF（適格機関投資家専用） | 286   | 10,513,932 |    |

|                                       |        |             |  |
|---------------------------------------|--------|-------------|--|
| LM・米国債券コア・プラスFC（適格機関投資家専用）            | 7,047  | 53,726,328  |  |
| ノムラーAMP豪州債券ファンドFC（適格機関投資家専用）          | 13,357 | 136,121,187 |  |
| MFS欧州株ファンドF（適格機関投資家専用）                | 232    | 5,199,352   |  |
| 野村エマージング債券ファンドFC（適格機関投資家専用）           | 6,664  | 84,299,600  |  |
| ストラテジック・バリュー・オープンF（適格機関投資家専用）         | 4,150  | 75,297,600  |  |
| シュローダー・アジア・パシフィック株式ファンドF（適格機関投資家専用）   | 65     | 1,861,080   |  |
| ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FC（適格機関投資家専用）     | 14,165 | 169,725,030 |  |
| グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドF（適格機関投資家専用）    | 600    | 24,222,600  |  |
| シュローダー日本ファンドF（適格機関投資家専用）              | 4,478  | 62,383,018  |  |
| スパークス・厳選投資・日本株ファンドF（適格機関投資家専用）        | 1,805  | 35,145,155  |  |
| ノムラT&D J Flag日本株 F（適格機関投資家専用）         | 456    | 9,068,472   |  |
| SJAMバリュー日本株F（適格機関投資家専用）               | 3,831  | 45,244,110  |  |
| ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドF（適格機関投資家専用）      | 1,619  | 28,709,727  |  |
| One国内株オープンF（FOFs用）（適格機関投資家専用）         | 3,425  | 47,148,550  |  |
| 日本フォーカス・グロースF（適格機関投資家専用）              | 2,660  | 39,195,100  |  |
| コムジェスト ジャパンエクイティファンドF（適格機関投資家専用）      | 2,017  | 28,792,675  |  |
| 野村DFA海外株式バリューファンドF（適格機関投資家専用）         | 5,370  | 65,234,760  |  |
| サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）F（適格機関投資家専用）     | 3,027  | 31,656,366  |  |
| ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）       | 729    | 7,331,553   |  |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国ハイ・イールド・ボンドFC | 33,968 | 335,196,224 |  |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国債券FC         | 29,283 | 253,502,931 |  |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国現地通貨建債券FC    | 16,520 | 82,418,280  |  |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国債券FC          | 8,344  | 81,404,064  |  |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－欧州債券FC          | 23,176 | 273,824,440 |  |
|                                       | 8,048  | 83,683,104  |  |

|  |    |                                                             |         |               |  |
|--|----|-------------------------------------------------------------|---------|---------------|--|
|  |    | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・<br>ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・<br>ボンドFC               |         |               |  |
|  |    | ノムラ・ワールド（除く日本）エク<br>イティ・ファンドF                               | 907     | 13,010,915    |  |
|  |    | A Bグローバル・コア・エクイ<br>ティ・ファンドF                                 | 75      | 1,325,700     |  |
|  |    | N P E Bバン・ヨーロピアン・ボン<br>ド・ファンドF C                            | 13,060  | 135,850,120   |  |
|  |    | AB SICAV IーセレクトUSエクイ<br>ティ・ポートフォリオ クラス S1<br>シェアーズ（円建て円ヘッジ） | 135     | 1,992,735     |  |
|  | 小計 | 銘柄数：32                                                      | 211,270 | 2,268,741,903 |  |
|  |    | 組入時価比率：99.0%                                                |         | 100.0%        |  |
|  | 合計 |                                                             |         | 2,268,741,903 |  |

(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。



## 【マイストーリー分配型（年6回）Bコース】

## （１）【貸借対照表】

| (単位：円)          |                       |                       |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 前期<br>(2021年 1月20日現在) | 当期<br>(2021年 7月20日現在) |
| <b>資産の部</b>     |                       |                       |
| 流動資産            |                       |                       |
| コール・ローン         | 1,849,122,468         | 1,921,797,191         |
| 投資信託受益証券        | 138,316,261,041       | 137,909,938,669       |
| 未収入金            | 645,539,993           | -                     |
| 未収配当金           | 158,073,845           | 185,171,185           |
| 流動資産合計          | 140,968,997,347       | 140,016,907,045       |
| 資産合計            | 140,968,997,347       | 140,016,907,045       |
| <b>負債の部</b>     |                       |                       |
| 流動負債            |                       |                       |
| 未払収益分配金         | 443,350,602           | 422,901,236           |
| 未払解約金           | 312,533,059           | 171,281,747           |
| 未払受託者報酬         | 6,092,391             | 6,042,940             |
| 未払委託者報酬         | 189,927,437           | 191,541,669           |
| 未払利息            | 1,132                 | 1,798                 |
| その他未払費用         | 515,825               | 519,938               |
| 流動負債合計          | 952,420,446           | 792,289,328           |
| 負債合計            | 952,420,446           | 792,289,328           |
| <b>純資産の部</b>    |                       |                       |
| 元本等             |                       |                       |
| 元本              | 147,783,534,038       | 140,967,078,767       |
| 剰余金             |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | △7,766,957,137        | △1,742,461,050        |
| （分配準備積立金）       | 5,448,350,258         | 5,138,049,985         |
| 元本等合計           | 140,016,576,901       | 139,224,617,717       |
| 純資産合計           | 140,016,576,901       | 139,224,617,717       |
| 負債純資産合計         | 140,968,997,347       | 140,016,907,045       |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日 | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日 |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                      |                                      |
| 受取配当金                                     | 1,572,653,078                        | 1,412,134,538                        |
| 有価証券売買等損益                                 | 10,026,077,213                       | 6,314,031,936                        |
| 営業収益合計                                    | 11,598,730,291                       | 7,726,166,474                        |
| 営業費用                                      |                                      |                                      |
| 支払利息                                      | 240,782                              | 182,559                              |
| 受託者報酬                                     | 18,384,221                           | 17,942,307                           |
| 委託者報酬                                     | 567,953,255                          | 566,985,666                          |
| その他費用                                     | 1,542,932                            | 1,539,222                            |
| 営業費用合計                                    | 588,121,190                          | 586,649,754                          |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 11,010,609,101                       | 7,139,516,720                        |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 11,010,609,101                       | 7,139,516,720                        |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 11,010,609,101                       | 7,139,516,720                        |
| 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（△） | 133,306,212                          | 87,660,785                           |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | △18,029,716,224                      | △7,766,957,137                       |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 792,021,799                          | 268,171,433                          |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 792,021,799                          | 268,171,433                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 50,385,100                           | 12,058,771                           |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 50,385,100                           | 12,058,771                           |
| 分配金                                       | 1,356,180,501                        | 1,283,472,510                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | △7,766,957,137                       | △1,742,461,050                       |

## (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。             |
| 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。                                                |
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4.その他                 | 当該財務諸表の特定期間は、2021年 1月21日から2021年 7月20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 1月20日現在                                                          | 当期<br>2021年 7月20日現在                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>147,783,534,038口                                     | 1. 特定期間の末日における受益権の総数<br>140,967,078,767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>元本の欠損 7,766,957,137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>元本の欠損 1,742,461,050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 0.9474円<br>(10,000口当たり純資産額) (9,474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 0.9876円<br>(10,000口当たり純資産額) (9,876円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日     | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日     |
|------------------------------------------|------------------------------------------|
| 1.分配金の計算過程<br>2020年 7月21日から2020年 9月23日まで | 1.分配金の計算過程<br>2021年 1月21日から2021年 3月22日まで |

| 項目                        |              |                |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 507,108,838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            | 2,163,062,192円 |
| 分配準備積立金額                  | D            | 5,534,682,816円 |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 8,204,853,846円 |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 153,376,936口   |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 534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 | 460,130,808円   |

2020年 9月24日から2020年11月20日まで

| 項目                        |              |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 505,841,337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            | 2,133,997,447円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 5,490,289,714円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 8,130,128,498円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 150,899,697,173口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 538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 | 452,699,091円     |

2020年11月21日から2021年 1月20日まで

| 項目                        |              |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 465,772,894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            | 2,097,728,420円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 5,425,927,966円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 7,989,429,280円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 147,783,534,038口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 540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 | 443,350,602円     |

| 項目                        |              |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 450,843,914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            | 2,055,165,703円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 5,323,716,180円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 7,829,725,797円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 144,391,282,336口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 542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 | 433,173,847円     |

2021年 3月23日から2021年 5月20日まで

| 項目                        |              |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 383,164,028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            | 2,034,154,629円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 5,268,269,809円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 7,685,588,466円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 142,465,809,157口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 539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 | 427,397,427円     |

2021年 5月21日から2021年 7月20日まで

| 項目                        |              |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A            | 394,638,300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            | 2,018,449,047円   |
| 分配準備積立金額                  | D            | 5,166,312,921円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D    | 7,579,400,268円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F            | 140,967,078,767口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F×10,000 | 537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 | 422,901,236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 7月21日<br>至 2021年 1月20日 | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20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、株価変動リスク、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 1月20日現在                                                                                                                                                                                                                                 | 当期<br>2021年 7月20日現在                                             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| <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<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。</p> <p>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。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日                                  | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20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 7月21日<br>至 2021年 1月20日 | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20日 |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 期首元本額 155,220,389,004円               | 期首元本額 147,783,534,038円               |
| 期中追加設定元本額 539,847,313円               | 期中追加設定元本額 482,736,433円               |
| 期中一部解約元本額 7,976,702,279円             | 期中一部解約元本額 7,299,191,704円             |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類       | 前期<br>自 2020年 7月21日<br>至 2021年 1月20日 | 当期<br>自 2021年 1月21日<br>至 2021年 7月20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 | 4,721,752,080                        | 687,735,021                          |
| 合計       | 4,721,752,080                        | 687,735,021                          |

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式(2021年7月20日現在)

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券(2021年7月20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 | ノムラ・ジャパン・オープンF（適格機関投資家専用）             | 96,640    | 2,368,936,320  |  |
|          |     | アムンディ・ターゲット・ジャパン・ファンドF（適格機関投資家専用）     | 16,891    | 620,946,942    |  |
|          |     | アメリカン・オープンFB（適格機関投資家専用）               | 7,532     | 354,049,192    |  |
|          |     | LM・米国債券コア・プラスFD（適格機関投資家専用）            | 369,652   | 3,366,051,112  |  |
|          |     | ノムラーAMP豪州債券ファンドFD（適格機関投資家専用）          | 807,637   | 8,259,703,599  |  |
|          |     | MFS欧州株ファンドFB（適格機関投資家専用）               | 17,754    | 318,258,204    |  |
|          |     | 野村エマージング債券ファンドFD（適格機関投資家専用）           | 408,989   | 5,240,785,046  |  |
|          |     | ストラテジック・バリュー・オープンF（適格機関投資家専用）         | 244,223   | 4,431,182,112  |  |
|          |     | シュローダー・アジア・パシフィック株式ファンドFB（適格機関投資家専用）  | 2,274     | 89,704,752     |  |
|          |     | ノムラ海外債券ファンド（カスタムBM型）FD（適格機関投資家専用）     | 785,941   | 10,158,287,425 |  |
|          |     | グローバル・エクイティ（除く日本）・ファンドFB（適格機関投資家専用）   | 32,321    | 1,507,645,366  |  |
|          |     | シュローダー日本ファンドF（適格機関投資家専用）              | 270,949   | 3,774,590,519  |  |
|          |     | スパークス・厳選投資・日本株ファンドF（適格機関投資家専用）        | 106,174   | 2,067,313,954  |  |
|          |     | ノムラーT&D J Flag日本株 F（適格機関投資家専用）        | 26,735    | 531,678,945    |  |
|          |     | SJAMバリュー日本株F（適格機関投資家専用）               | 222,987   | 2,633,476,470  |  |
|          |     | ティー・ロウ・プライス 海外株式ファンドFB（適格機関投資家専用）     | 99,138    | 1,781,708,136  |  |
|          |     | One国内株オープンF（FOFs用）（適格機関投資家専用）         | 202,854   | 2,792,488,164  |  |
|          |     | 日本フォーカス・グロースF（適格機関投資家専用）              | 155,817   | 2,295,963,495  |  |
|          |     | コムジェスト ジャパンエクイティファンドF（適格機関投資家専用）      | 120,821   | 1,724,719,775  |  |
|          |     | 野村DFA海外株式バリューファンドFB（適格機関投資家専用）        | 318,276   | 4,053,881,412  |  |
|          |     | サンズ・グローバル・エクイティ（除く日本）FB（適格機関投資家専用）    | 187,015   | 1,969,080,935  |  |
|          |     | ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドFB（適格機関投資家専用）      | 44,150    | 449,226,250    |  |
|          |     | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国ハイ・イールド・ボンドFD | 1,684,488 | 20,902,811,592 |  |
|          |     | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－新興国債券FD         | 1,392,125 | 15,433,097,750 |  |
|          |     |                                       | 861,352   | 5,106,094,656  |  |

|  |    |                                                         |            |                 |  |
|--|----|---------------------------------------------------------|------------|-----------------|--|
|  |    | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・<br>ファンドⅡ－新興国現地通貨建債券<br>FD              |            |                 |  |
|  |    | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・<br>ファンドⅡ－米国債券FD                        | 348,993    | 4,990,948,893   |  |
|  |    | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・<br>ファンドⅡ－欧州債券FD                        | 1,090,265  | 16,557,854,555  |  |
|  |    | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・<br>ファンドⅣ－欧州ハイ・イールド・<br>ボンドFD           | 372,608    | 4,869,986,560   |  |
|  |    | ノムラ・ワールド（除く日本）エク<br>イティ・ファンドFB                          | 54,473     | 755,213,672     |  |
|  |    | A Bグローバル・コア・エクイ<br>ティ・ファンドF B                           | 5,168      | 89,039,472      |  |
|  |    | N P E Bパン・ヨーロッパ・ボン<br>ド・ファンドF D                         | 794,402    | 8,294,351,282   |  |
|  |    | AB SICAV I－セレクトUSエクイ<br>ティ・ポートフォリオ クラス S1<br>シェアーズ（円建て） | 8,092      | 120,862,112     |  |
|  | 小計 | 銘柄数：32                                                  | 11,156,736 | 137,909,938,669 |  |
|  |    | 組入時価比率：99.1%                                            |            | 100.0%          |  |
|  | 合計 |                                                         |            | 137,909,938,669 |  |

(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。



## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

#### マイストーリー分配型（年6回）Aコース

2021年8月31日現在

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| I 資産総額              | 2,321,369,589円 |
| II 負債総額             | 2,224,445円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 2,319,145,144円 |
| IV 発行済口数            | 1,892,545,409口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.2254円        |

#### マイストーリー分配型（年6回）Bコース

2021年8月31日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 139,694,899,426円 |
| II 負債総額             | 250,156,783円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 139,444,742,643円 |
| IV 発行済口数            | 140,146,049,773口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.9950円          |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

### (2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3)受益権の譲渡

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先

口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

- ③上記①の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4)受益権の譲渡の対抗要件

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

(5)受益権の再分割

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額

2021年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間に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。

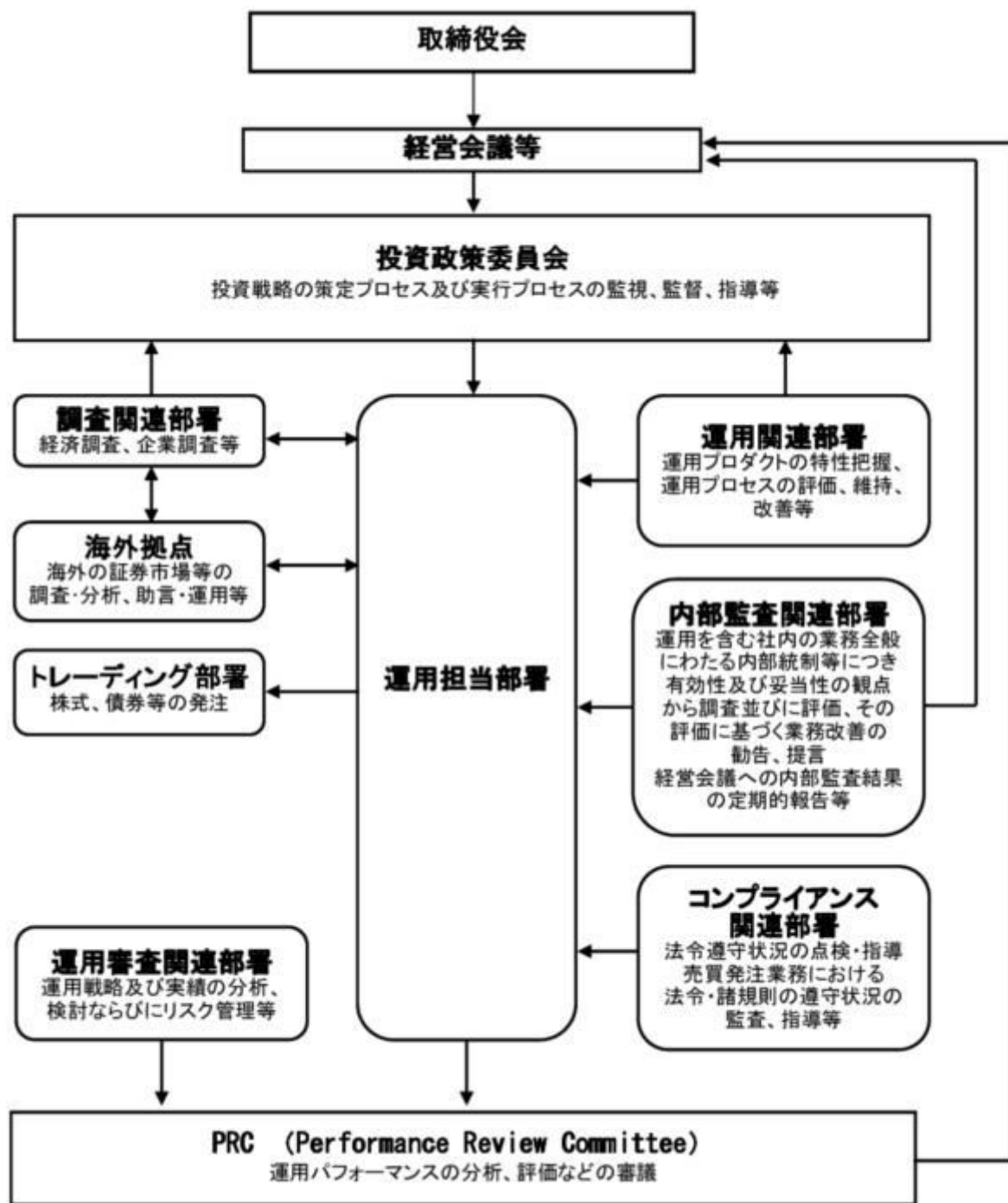
###### 代表取締役・業務執行取締役

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】

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

委託者の運用する証券投資信託は2021年7月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。 )。

| 種類 | 本数 | 純資産総額(百万円) |
|----|----|------------|
|----|----|------------|

|            |       |            |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託  | 994   | 37,262,236 |
| 単位型株式投資信託  | 195   | 817,802    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 6,310,987  |
| 単位型公社債投資信託 | 503   | 1,626,966  |
| 合計         | 1,706 | 46,017,992 |

### 3【委託会社等の経理状況】

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   |        |          |         |       |          |         |         | 株主資本合計  |
|--------|--------|--------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|---------|
|        | 資本金    | 資本剰余金  |          |         | 利益剰余金 |          |         |         |         |
|        |        | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |         | 利益剰余金合計 |         |
|        |        |        |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |         |
| 当期首残高  | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 30,723  | 56,014  | 86,924  |
| 当期変動額  |        |        |          |         |       |          |         |         |         |
| 剰余金の配当 |        |        |          |         |       |          | △25,650 | △25,650 | △25,650 |
| 当期純利益  |        |        |          |         |       |          | 23,996  | 23,996  | 23,996  |



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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

|                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法  | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<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、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<br/>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>① 退職給付見込額の期間帰属方法<br/>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>② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/>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<br/>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 ェ 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 ェ 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、過年度に計上しておりました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

#### 注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

|              | 1年以内   | 1年超<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

## ①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

|        |      |
|--------|------|
| 債券     | 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% |

## ②長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

|                 |      |
|-----------------|------|
| 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

## ①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

|        |      |
|--------|------|
| 債券     | 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% |

## ②長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## ① 売上高

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

## ② 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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



当事業年度(自 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

#### ① 売上高

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

#### ② 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ◇ 関連当事者情報

前事業年度(自 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(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、  
ニューヨーク証券取引所に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

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(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、  
ニューヨーク証券取引所に上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

### ◇ 1株当たり情報

| 前事業年度<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 |

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子

法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

④委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤上記③④に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

## 5【その他】

### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 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】

#### (1)受託者

| (a)名称      | (b)資本金の額 <sup>*</sup> | (c)事業の内容                                                   |
|------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|
| 野村信託銀行株式会社 | 35,000百万円             | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |

\*2021年7月末現在

#### (2)販売会社

| (a)名称                                                                                  | (b)資本金の額 <sup>*</sup>                                                 | (c)事業の内容                        |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|---------------------------------|
| 野村證券株式会社<br>池田泉州T T証券株式会社<br>四国アライアンス証券株式会社<br>静銀ティーエム証券株式会社<br>七十七証券株式会社<br>八十二証券株式会社 | 10,000百万円<br>1,250百万円<br>3,000百万円<br>3,000百万円<br>3,000百万円<br>3,000百万円 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社池田泉州銀行<br>株式会社伊予銀行<br>株式会社関西みらい銀行<br>株式会社北日本銀行<br>株式会社熊本銀行                         | 61,385百万円<br>20,948百万円<br>38,971百万円<br>7,761百万円<br>33,847百万円          |                                 |

|            |           |                    |
|------------|-----------|--------------------|
| 株式会社四国銀行   | 25,000百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社七十七銀行  | 24,658百万円 |                    |
| 株式会社十六銀行   | 36,839百万円 |                    |
| 株式会社十八親和銀行 | 36,878百万円 |                    |
| スルガ銀行株式会社  | 30,043百万円 |                    |
| 株式会社第四北越銀行 | 32,776百万円 |                    |
| 株式会社大東銀行   | 14,743百万円 |                    |
| 株式会社東和銀行   | 38,653百万円 |                    |
| 株式会社徳島大正銀行 | 11,036百万円 |                    |
| 株式会社名古屋銀行  | 25,090百万円 |                    |
| 株式会社八十二銀行  | 52,243百万円 |                    |
| 株式会社福井銀行   | 17,965百万円 |                    |
| 株式会社福岡銀行   | 82,329百万円 |                    |
| 株式会社北海道銀行  | 93,524百万円 |                    |
| 株式会社北國銀行   | 26,673百万円 |                    |
| 株式会社みなと銀行  | 39,984百万円 |                    |
| 株式会社武蔵野銀行  | 45,743百万円 |                    |
| 株式会社山形銀行   | 12,008百万円 |                    |
| 株式会社山梨中央銀行 | 15,400百万円 |                    |
| 株式会社琉球銀行   | 56,967百万円 |                    |

＊2021年7月末現在

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託者

ファンドの受託会社(受託者)として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。

### (2)販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

### (1)受託者

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日       | 提出書類          |
|-------------|---------------|
| 2021年 1月29日 | 臨時報告書         |
| 2021年 3月31日 | 臨時報告書         |
| 2021年 4月 9日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2021年 4月 9日 | 有価証券報告書       |
| 2021年 5月31日 | 臨時報告書         |

## 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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年9月3日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
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」に掲げられているマイストーリー分配型（年6回）Aコースの2021年1月21日から2021年7月20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、マイストーリー分配型（年6回）Aコースの2021年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

2021年9月3日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
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」に掲げられているマイストーリー分配型（年6回）Bコースの2021年1月21日から2021年7月20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、マイストーリー分配型（年6回）Bコースの2021年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

### 利害関係

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

以 上

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