

【表紙】

| | |
|--|---------------------|
| 【提出書類】 | 訂正有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2021年11月16日提出 |
| 【発行者名】 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | C E O兼代表取締役社長 小池 広靖 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都江東区豊洲二丁目2番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 松井 秀仁 |
| 【電話番号】 | 03-6387-5000 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | 野村D C運用戦略ファンド |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2021年5月13日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

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

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

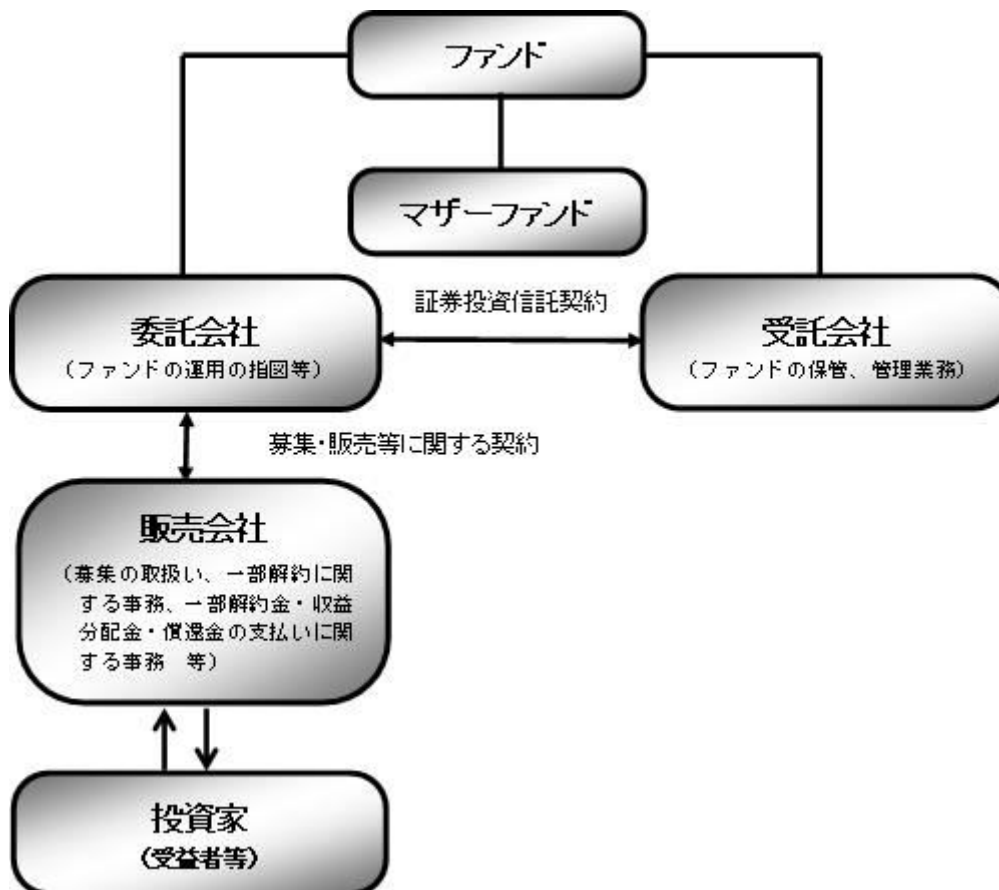
第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

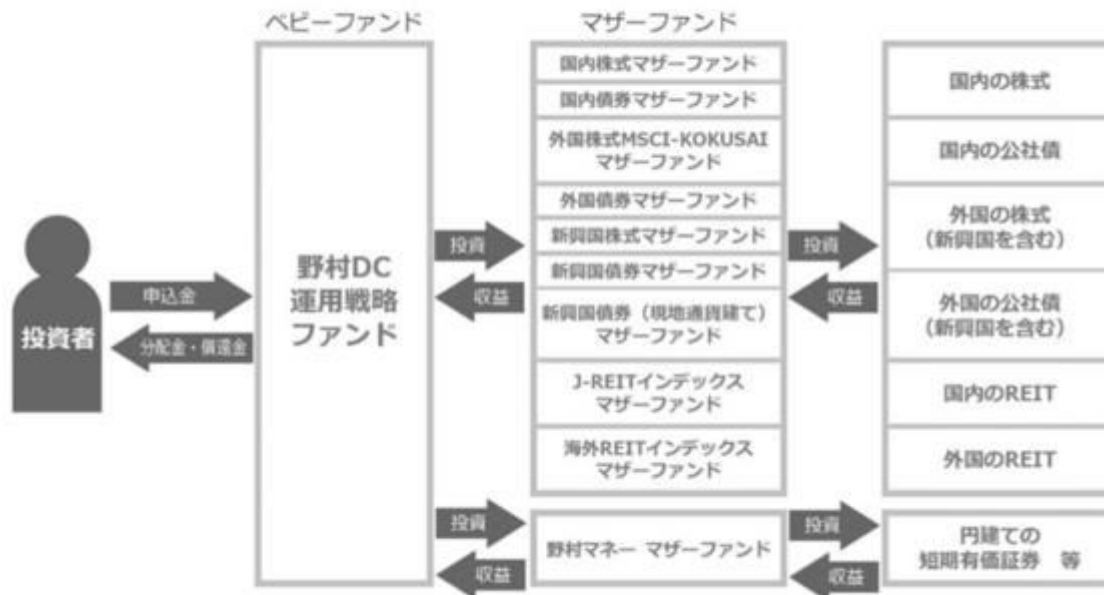
<更新後>



| | |
|--------------------|-------------------------|
| ファンド | 野村DC運用戦略ファンド |
| マザーファンド (親投資信託) | 国内株式マザーファンド |
| | 国内債券マザーファンド |
| | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド |
| | 外国債券マザーファンド |
| | 新興国株式マザーファンド |
| | 新興国債券マザーファンド |
| | 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド |
| | J-REITインデックス マザーファンド |
| | 海外REITインデックス マザーファンド |
| | 野村マネー マザーファンド |

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

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



※ファンドは、各マザーファンドへの投資を行なうと共に、為替予約取引等を活用します。

< 更新後 >

委託会社の概況(2021年9月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2 投資方針

(1) 投資方針

< 更新後 >

[1] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準¹を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション²を決定します。

- 1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの価格の変動の大きさのことです。ファンドでは、推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。リスク水準の調整にあたっては、基準価額の目標変動リスク値を、当年度5%程度以下となることを目指して、リスク水準の異なる資産の配分比率や実質的な外貨のエクスポージャーを変更します。

基準価額の変動の方向は、上昇することも下落することもあり得ます。変動リスクの大きさは、必ずしもファンドの運用成績の良さを意味するものではありません。実際の運用成績は、マイナスとなる可能性があります。

ファンドで組入れる各資産と為替の過去の価格の変動リスク等の統計値から、それらを組み合わせた将来の価格の変動リスク値を推定し、資産配分と通貨配分により目標変動リスク値を調整します。ただし、目標変動リスク値はあくまでも推定に基づく統計的な目安ですので、実際の基準価額の変動リスクは、推定値からはずれることがあります。したがって、基準価額が目標変動リスク値で示される範囲より小さくしか値動きをしない場合もあれば、目標変動リスク値で示される範囲を超えて大きく値下がりする場合もあります。

変動リスク値は、「ボラティリティ」や「標準偏差」と呼ばれることもあります。

- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

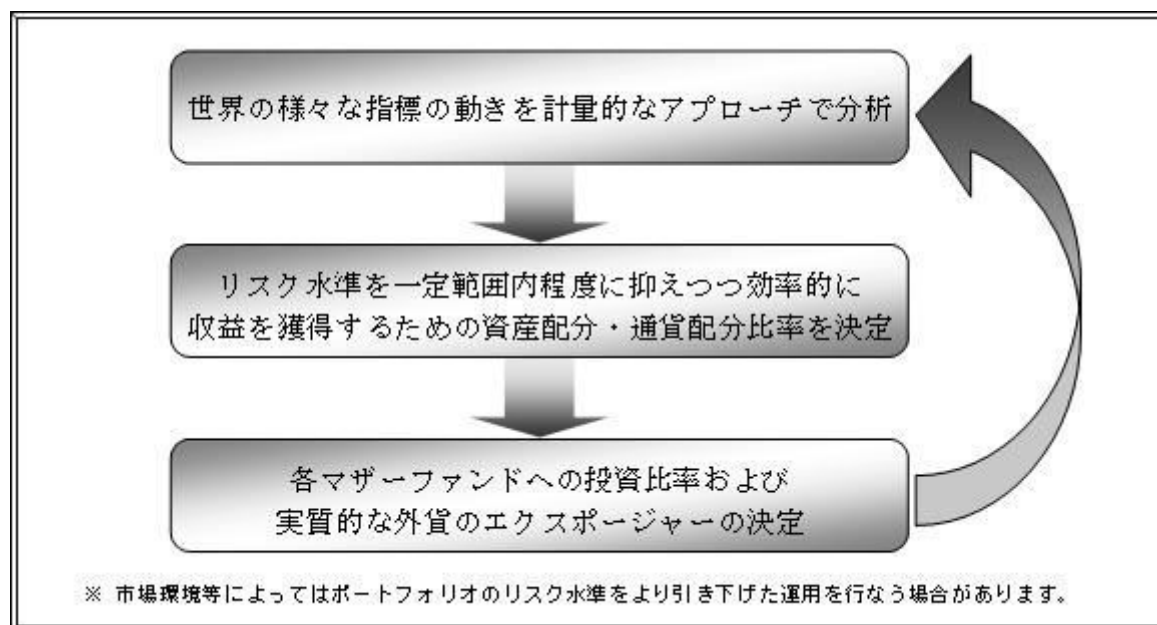
| 実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率 | 実質的な外貨の エクスポージャー |
|----------------------------|---------------------|
| 純資産総額の50%以内 | 純資産総額の50%以内 |

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行いません。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

運用プロセスについて



[2] 為替予約取引等の利用については、外貨建資産の為替変動リスクを回避する目的（ヘッジ目的。代替ヘッジを含みます。）のほか、効率的に収益を獲得する目的（ヘッジ目的外）で活用します。

為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額は信託財産の純資産総額の100%以内とします。

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内となるように調整を行ないます。

各マザーファンドの投資方針等について

[国内株式マザーファンド]

- ・わが国の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・主として東京証券取引所第一部上場株式 に投資することにより、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指します。
2022年4月4日適用で「東京証券取引所第一部上場株式」を「わが国の株式」とする約款変更を予定しております。
- ・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。

「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。

東証株価指数（TOPIX）は、2022年4月4日に予定されている東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、構成銘柄の選定を含む指数算出要領の見直しが行われます。詳しくは、日本取引所グループのホームページ等をご覧ください。

[国内債券 マザーファンド]

- ・わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

「NOMURA-BPI 国債指数」は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

[外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド]

- ・主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

「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。

MSCI-KOKUSAI 指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[外国債券マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

Depository Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[新興国債券マザーファンド]

- ・新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ・投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によって

は、上記のような運用ができない場合があります。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建のプレディ債、ローン、ユーロボンド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。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

- ・現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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 Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

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・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数であり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[J-REITインデックス マザーファンド]

- ・J-REIT を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と配当金の受け取りを合わせた投資成果）を表す指数です。
東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均を、2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

[海外REITインデックス マザーファンド]

- ・日本を除く世界各国のREIT を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

世界の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、当ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

S&P先進国REIT指数は、S&Pの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数から、REIT及びREITと同様の制度に基づく銘柄を抽出して算出するインデックスで、先進国に上場する不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて毎日算出されます。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[野村マネー マザーファンド]

- ・本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
- ・残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

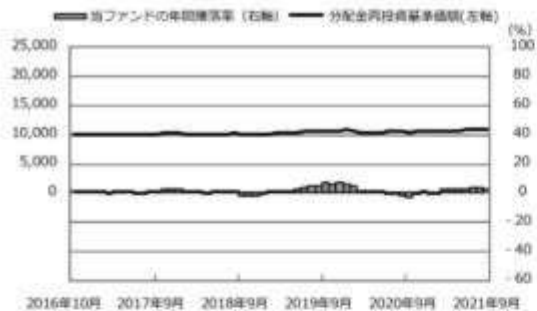
資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

3 投資リスク

< 更新後 >

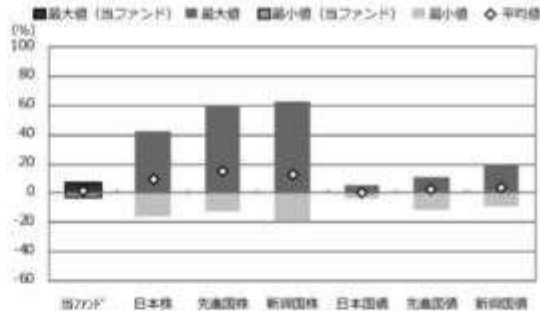
■ リスクの定量的比較 (2016年10月末～2021年9月末：月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2016年10月 2017年9月 2018年9月 2019年9月 2020年9月 2021年9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 (%) | 7.2 | 42.1 | 59.8 | 62.7 | 5.4 | 11.4 | 19.3 |
| 最小値 (%) | △3.0 | △16.0 | △12.4 | △19.4 | △4.0 | △11.4 | △9.4 |
| 平均値 (%) | 1.4 | 9.5 | 14.4 | 13.2 | 0.3 | 2.7 | 3.8 |

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2016年10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10月から2021年9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10月から2021年9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。

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数額の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に所有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資機密や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性及び正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての推奨、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、その完全性及び正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPSI、J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4 手数料等及び税金

（3）信託報酬等

<更新後>

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0.88%（税抜年0.80%）以内（2021年11月16日現在年0.88%（税抜年0.80%））の率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬率の配分は下記の通り（税抜）とします。

| < 委託会社 > | < 販売会社 > | < 受託会社 > |
|----------|----------|----------|
| 年0.40% | 年0.35% | 年0.05% |

上記配分は、2021年11月16日現在の信託報酬率における配分です。

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 | 口座内でのファンドの管理および事務手続き、購入後の情報提供、各種書類の送付等 | 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 |

(5) 課税上の取扱い

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税、復興特別所得税および地方税がかかりません。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは以下の通りです。

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(所得税及び復興特別所得税)15.315%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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。

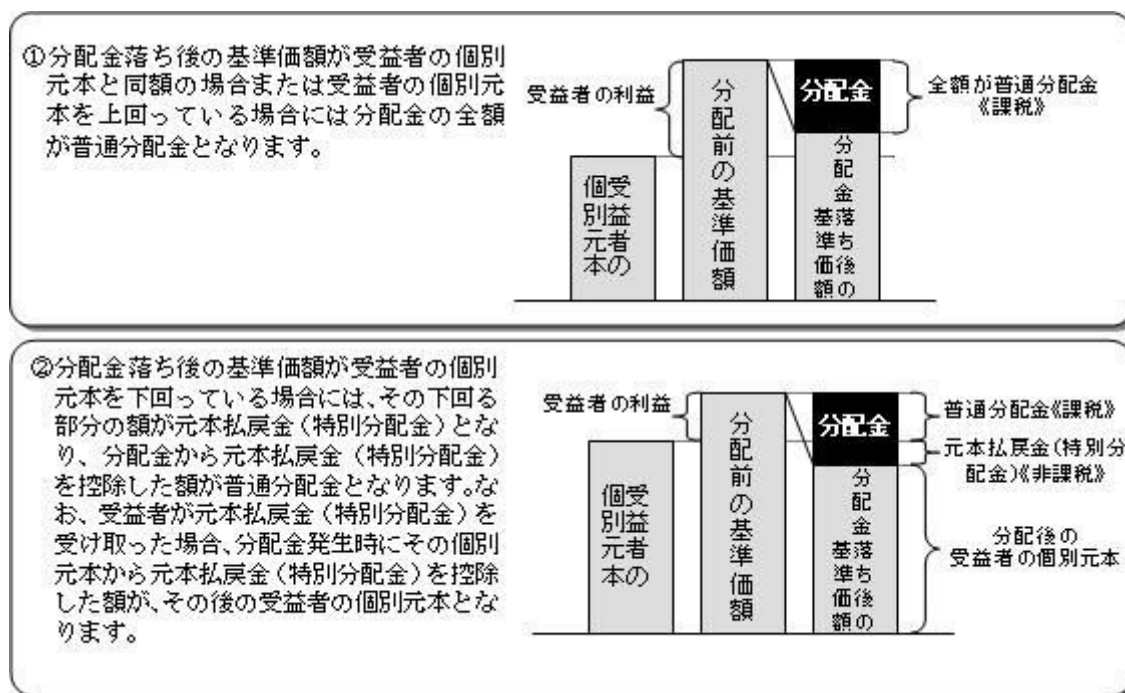
換金（解約）時および償還時の課税について

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

分配金の課税について

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



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

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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2021年9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9月30日現在の運用状況であります。

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

(1) 投資状況

野村DC運用戦略ファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 32,715,261,381 | 95.66 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 1,481,181,693 | 4.33 |
| 合計(純資産総額) | | 34,196,443,074 | 100.00 |

(参考) 国内株式マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 405,693,587,950 | 96.63 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 14,141,635,146 | 3.36 |
| 合計（純資産総額） | | 419,835,223,096 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

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

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|----|------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 10,964,700,000 | 2.61 |

（参考）国内債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 24,490,664,350 | 99.17 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 202,869,679 | 0.82 |
| 合計（純資産総額） | | 24,693,534,029 | 100.00 |

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------|----------------|-----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 760,503,071,759 | 69.88 |
| | カナダ | 36,780,835,503 | 3.38 |
| | ドイツ | 30,215,810,906 | 2.77 |
| | イタリア | 8,018,561,587 | 0.73 |
| | フランス | 36,187,452,342 | 3.32 |
| | オランダ | 16,728,657,661 | 1.53 |
| | スペイン | 7,967,250,201 | 0.73 |
| | ベルギー | 2,695,212,095 | 0.24 |
| | オーストリア | 723,179,302 | 0.06 |
| | ルクセンブルグ | 536,825,397 | 0.04 |
| | フィンランド | 3,389,951,214 | 0.31 |
| | アイルランド | 2,372,146,126 | 0.21 |
| | ポルトガル | 621,880,450 | 0.05 |
| | イギリス | 46,953,862,543 | 4.31 |
| | スイス | 31,525,764,038 | 2.89 |
| | スウェーデン | 12,079,321,538 | 1.11 |
| | ノルウェー | 2,163,561,345 | 0.19 |
| | デンマーク | 8,730,602,080 | 0.80 |
| オーストラリア | 20,887,911,006 | 1.91 | |

| | | | |
|--------------------|----------|-------------------|--------|
| | ニュージーランド | 785,546,383 | 0.07 |
| | 香港 | 8,921,111,723 | 0.81 |
| | シンガポール | 2,946,240,348 | 0.27 |
| | イスラエル | 1,229,657,500 | 0.11 |
| | 小計 | 1,042,964,413,047 | 95.84 |
| 投資証券 | アメリカ | 20,774,609,896 | 1.90 |
| | カナダ | 119,662,550 | 0.01 |
| | フランス | 469,106,069 | 0.04 |
| | イギリス | 640,589,005 | 0.05 |
| | オーストラリア | 1,508,437,528 | 0.13 |
| | 香港 | 398,940,026 | 0.03 |
| | シンガポール | 460,278,163 | 0.04 |
| | 小計 | 24,371,623,237 | 2.23 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 20,849,244,819 | 1.91 |
| 合計（純資産総額） | | 1,088,185,281,103 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

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

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|----|---------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 15,334,956,630 | 1.40 |
| | 買建 | カナダ | 717,783,524 | 0.06 |
| | 買建 | ドイツ | 2,157,970,623 | 0.19 |
| | 買建 | イギリス | 936,577,177 | 0.08 |
| | 買建 | スイス | 613,871,910 | 0.05 |
| | 買建 | オーストラリア | 447,470,244 | 0.04 |

（参考）外国債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|--------|-----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 280,842,470,546 | 45.92 |
| | カナダ | 11,968,747,703 | 1.95 |
| | メキシコ | 4,225,864,706 | 0.69 |
| | ドイツ | 40,646,757,614 | 6.64 |
| | イタリア | 61,566,838,135 | 10.06 |
| | フランス | 57,240,008,502 | 9.36 |
| | オランダ | 10,025,666,777 | 1.63 |
| | スペイン | 39,056,835,021 | 6.38 |
| | ベルギー | 14,195,552,341 | 2.32 |
| | オーストリア | 8,664,815,519 | 1.41 |
| | フィンランド | 2,618,808,676 | 0.42 |
| | アイルランド | 8,182,346,219 | 1.33 |

| | | | |
|--------------------|-----------|-----------------|--------|
| | イギリス | 36,708,699,037 | 6.00 |
| | スウェーデン | 1,741,174,451 | 0.28 |
| | ノルウェー | 1,464,698,741 | 0.23 |
| | デンマーク | 3,066,854,733 | 0.50 |
| | ポーランド | 3,469,271,799 | 0.56 |
| | オーストラリア | 11,049,260,215 | 1.80 |
| | シンガポール | 2,734,198,530 | 0.44 |
| | マレーシア | 2,904,153,419 | 0.47 |
| | イスラエル | 2,753,338,099 | 0.45 |
| | 小計 | 605,126,360,783 | 98.96 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 6,348,403,739 | 1.03 |
| | 合計(純資産総額) | 611,474,764,522 | 100.00 |

(参考)新興国株式マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------|---------------|----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 6,490,386,622 | 9.53 |
| | メキシコ | 1,217,567,285 | 1.78 |
| | ブラジル | 2,932,131,489 | 4.30 |
| | チリ | 110,038,523 | 0.16 |
| | コロンビア | 45,952,076 | 0.06 |
| | ギリシャ | 121,085,775 | 0.17 |
| | イギリス | 51,563,492 | 0.07 |
| | トルコ | 161,813,132 | 0.23 |
| | チェコ | 75,493,195 | 0.11 |
| | ハンガリー | 166,014,938 | 0.24 |
| | ポーランド | 488,558,354 | 0.71 |
| | 香港 | 15,452,107,040 | 22.70 |
| | マレーシア | 870,309,488 | 1.27 |
| | タイ | 1,069,910,898 | 1.57 |
| | フィリピン | 420,783,204 | 0.61 |
| | インドネシア | 867,508,051 | 1.27 |
| | 韓国 | 8,232,593,553 | 12.09 |
| | 台湾 | 9,605,824,533 | 14.11 |
| | インド | 7,897,104,928 | 11.60 |
| | パキスタン | 10,169,013 | 0.01 |
| | カタール | 481,841,524 | 0.70 |
| | エジプト | 44,784,638 | 0.06 |
| | 南アフリカ | 2,019,993,736 | 2.96 |
| | アラブ首長国連邦 | 526,813,852 | 0.77 |
| クウェート | 384,741,447 | 0.56 | |
| サウジアラビア | 2,174,749,263 | 3.19 | |

| | | | |
|--------------------|-------|----------------|--------|
| | 小計 | 61,919,840,049 | 90.98 |
| 新株予約権証券 | タイ | 0 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 3,020,007,729 | 4.43 |
| 投資証券 | メキシコ | 28,862,044 | 0.04 |
| | 南アフリカ | 31,660,200 | 0.04 |
| | 小計 | 60,522,244 | 0.08 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 3,050,954,848 | 4.48 |
| 合計（純資産総額） | | 68,051,324,870 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

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

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|----|--------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 2,731,637,033 | 4.01 |
| | 買建 | シンガポール | 234,785,776 | 0.34 |

（参考）新興国債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 26,288,257,929 | 98.19 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 484,245,401 | 1.80 |
| 合計（純資産総額） | | 26,772,503,330 | 100.00 |

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|-------------|-------------|---------|
| 国債証券 | メキシコ | 871,642,674 | 8.81 |
| | ブラジル | 759,556,007 | 7.68 |
| | チリ | 193,829,210 | 1.95 |
| | コロンビア | 435,588,666 | 4.40 |
| | ペルー | 172,955,578 | 1.74 |
| | ウルグアイ | 10,966,855 | 0.11 |
| | ドミニカ共和国 | 19,319,144 | 0.19 |
| | トルコ | 177,051,156 | 1.79 |
| | チェコ | 440,140,783 | 4.45 |
| | ハンガリー | 362,909,345 | 3.66 |
| | ポーランド | 811,456,864 | 8.20 |
| | ロシア | 725,664,716 | 7.33 |
| | ルーマニア | 301,055,535 | 3.04 |
| | マレーシア | 764,579,847 | 7.73 |
| タイ | 827,102,074 | 8.36 | |

| | | | |
|--------------------|--------|---------------|--------|
| | フィリピン | 26,338,048 | 0.26 |
| | インドネシア | 975,600,025 | 9.86 |
| | 南アフリカ | 741,732,351 | 7.50 |
| | 中国 | 898,484,401 | 9.08 |
| | 小計 | 9,515,973,279 | 96.22 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 373,430,055 | 3.77 |
| 合計（純資産総額） | | 9,889,403,334 | 100.00 |

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券 | 日本 | 43,596,794,200 | 97.09 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 1,303,913,915 | 2.90 |
| 合計（純資産総額） | | 44,900,708,115 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|----|------|---------------|---------|
| REIT指数先物取引 | 買建 | 日本 | 1,300,320,000 | 2.89 |

（参考）海外 R E I Tインデックス マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|----------|----------------|---------|
| 投資証券 | アメリカ | 32,976,507,200 | 74.85 |
| | カナダ | 863,061,747 | 1.95 |
| | ドイツ | 115,906,387 | 0.26 |
| | イタリア | 12,691,218 | 0.02 |
| | フランス | 853,299,217 | 1.93 |
| | オランダ | 72,970,222 | 0.16 |
| | スペイン | 186,477,921 | 0.42 |
| | ベルギー | 579,728,674 | 1.31 |
| | アイルランド | 48,874,109 | 0.11 |
| | シンガポール | 24,309,792 | 0.05 |
| | イギリス | 2,481,451,159 | 5.63 |
| | オーストラリア | 2,960,365,262 | 6.72 |
| | ニュージーランド | 177,958,417 | 0.40 |

| | | | |
|--------------------|--------|----------------|--------|
| | 香港 | 627,221,807 | 1.42 |
| | シンガポール | 1,434,451,212 | 3.25 |
| | 韓国 | 72,863,931 | 0.16 |
| | イスラエル | 30,030,566 | 0.06 |
| | 小計 | 43,518,168,841 | 98.78 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 533,185,867 | 1.21 |
| 合計（純資産総額） | | 44,051,354,708 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

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

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|----|------|-------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 433,533,312 | 0.98 |

（参考）野村マネー マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|---------------|---------|
| 地方債証券 | 日本 | 800,988,298 | 9.81 |
| 特殊債券 | 日本 | 1,598,083,427 | 19.58 |
| 社債券 | 日本 | 2,100,624,768 | 25.74 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 3,659,664,827 | 44.85 |
| 合計（純資産総額） | | 8,159,361,320 | 100.00 |

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

野村DC運用戦略ファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価（円） | 簿価金額（円） | 評価単価（円） | 評価金額（円） | 投資比率（％） |
|----|------|-----------|--------------------------|---------------|---------|----------------|---------|----------------|---------|
| 1 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券マザーファンド | 5,338,239,200 | 2.4964 | 13,326,422,148 | 2.5403 | 13,560,729,039 | 39.65 |
| 2 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券マザーファンド | 7,075,489,497 | 1.3593 | 9,617,865,944 | 1.3653 | 9,660,165,810 | 28.24 |
| 3 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド | 500,467,931 | 3.8380 | 1,920,835,096 | 4.1777 | 2,090,804,875 | 6.11 |
| 4 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式マザーファンド | 788,173,313 | 2.0199 | 1,592,031,275 | 2.1426 | 1,688,740,140 | 4.93 |
| 5 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国債券マザーファンド | 764,344,393 | 2.0437 | 1,562,120,710 | 2.0982 | 1,603,747,405 | 4.68 |
| 6 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 955,678,207 | 1.4239 | 1,360,829,017 | 1.4003 | 1,338,236,193 | 3.91 |
| 7 | 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国株式マザーファンド | 572,303,330 | 1.6817 | 962,474,050 | 1.5963 | 913,567,805 | 2.67 |
| 8 | 日本 | 親投資信託受益証券 | J-REITインデックスマザーファンド | 322,533,879 | 2.6425 | 852,295,776 | 2.7505 | 887,129,434 | 2.59 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|---------------|-------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|------|
| 9 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 海外REITインデックス マザーファンド | 302,734,746 | 2.5781 | 780,489,683 | 2.9242 | 885,256,944 | 2.58 |
| 10 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 野村マネー マザーファンド | 85,180,134 | 1.0201 | 86,892,254 | 1.0200 | 86,883,736 | 0.25 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.66 |
| 合計 | 95.66 |

(参考)国内株式マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|----|-------------------|--------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 7,384,700 | 1,712.44 | 12,645,927,780 | 2,000.00 | 14,769,400,000 | 3.51 |
| 2 | 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 913,300 | 10,789.70 | 9,854,233,010 | 12,455.00 | 11,375,151,500 | 2.70 |
| 3 | 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 143,100 | 53,684.02 | 7,682,183,262 | 67,000.00 | 9,587,700,000 | 2.28 |
| 4 | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 1,135,200 | 10,020.45 | 11,375,214,840 | 6,480.00 | 7,356,096,000 | 1.75 |
| 5 | 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 997,900 | 5,280.19 | 5,269,101,601 | 6,832.00 | 6,817,652,800 | 1.62 |
| 6 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 9,836,300 | 608.08 | 5,981,263,636 | 657.90 | 6,471,301,770 | 1.54 |
| 7 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 1,673,300 | 2,856.61 | 4,779,965,513 | 3,085.00 | 5,162,130,500 | 1.22 |
| 8 | 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 264,000 | 18,564.06 | 4,900,911,840 | 18,900.00 | 4,989,600,000 | 1.18 |
| 9 | 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 284,500 | 13,261.08 | 3,772,777,260 | 17,475.00 | 4,971,637,500 | 1.18 |
| 10 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 700,900 | 5,422.88 | 3,800,896,592 | 6,640.00 | 4,653,976,000 | 1.10 |
| 11 | 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 185,700 | 23,063.62 | 4,282,914,234 | 24,460.00 | 4,542,222,000 | 1.08 |
| 12 | 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 83,400 | 62,231.71 | 5,190,124,614 | 54,310.00 | 4,529,454,000 | 1.07 |
| 13 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1,212,900 | 3,729.21 | 4,523,158,809 | 3,699.00 | 4,486,517,100 | 1.06 |
| 14 | 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 350,900 | 12,490.95 | 4,383,074,355 | 12,420.00 | 4,358,178,000 | 1.03 |
| 15 | 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 428,300 | 8,692.42 | 3,722,963,486 | 9,960.00 | 4,265,868,000 | 1.01 |
| 16 | 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 85,400 | 49,845.63 | 4,256,816,802 | 49,670.00 | 4,241,818,000 | 1.01 |
| 17 | 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,147,200 | 3,446.95 | 3,954,341,040 | 3,691.00 | 4,234,315,200 | 1.00 |
| 18 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1,147,900 | 3,431.73 | 3,939,282,867 | 3,455.00 | 3,965,994,500 | 0.94 |
| 19 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 995,100 | 3,965.32 | 3,945,889,932 | 3,944.00 | 3,924,674,400 | 0.93 |
| 20 | 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 1,145,700 | 2,897.19 | 3,319,310,583 | 2,979.50 | 3,413,613,150 | 0.81 |
| 21 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 1,004,300 | 3,547.47 | 3,562,724,121 | 3,277.00 | 3,291,091,100 | 0.78 |
| 22 | 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 127,900 | 26,512.26 | 3,390,918,054 | 24,565.00 | 3,141,863,500 | 0.74 |
| 23 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,953,900 | 1,622.75 | 3,170,691,225 | 1,584.50 | 3,095,954,550 | 0.73 |
| 24 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 874,200 | 3,014.45 | 2,635,232,190 | 3,536.00 | 3,091,171,200 | 0.73 |
| 25 | 日本 | 株式 | SMC | 機械 | 42,700 | 65,275.79 | 2,787,276,233 | 70,080.00 | 2,992,416,000 | 0.71 |
| 26 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 561,700 | 4,719.39 | 2,650,881,363 | 5,085.00 | 2,856,244,500 | 0.68 |
| 27 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 473,600 | 5,463.06 | 2,587,305,216 | 6,021.00 | 2,851,545,600 | 0.67 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|-----------|-------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 28 | 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,114,900 | 2,535.65 | 2,826,996,185 | 2,464.00 | 2,747,113,600 | 0.65 |
| 29 | 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 148,200 | 15,308.55 | 2,268,727,110 | 18,130.00 | 2,686,866,000 | 0.63 |
| 30 | 日本 | 株式 | 富士通 | 電気機器 | 131,200 | 16,905.89 | 2,218,052,768 | 20,310.00 | 2,664,672,000 | 0.63 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内 / 国外 | 業種 | 投資比率(%) |
|------------|---------|----------|---------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.08 |
| | | 鉱業 | 0.19 |
| | | 建設業 | 2.23 |
| | | 食料品 | 3.31 |
| | | 繊維製品 | 0.45 |
| | | パルプ・紙 | 0.21 |
| | | 化学 | 6.81 |
| | | 医薬品 | 4.98 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.39 |
| | | ゴム製品 | 0.69 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.74 |
| | | 鉄鋼 | 0.78 |
| | | 非鉄金属 | 0.64 |
| | | 金属製品 | 0.58 |
| | | 機械 | 5.18 |
| | | 電気機器 | 17.96 |
| | | 輸送用機器 | 7.43 |
| | | 精密機器 | 2.87 |
| | | その他製品 | 2.12 |
| | | 電気・ガス業 | 1.10 |
| | | 陸運業 | 3.18 |
| | | 海運業 | 0.46 |
| | | 空運業 | 0.47 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.17 |
| | | 情報・通信業 | 8.15 |
| | | 卸売業 | 4.60 |
| 小売業 | 4.34 | | |
| 銀行業 | 4.84 | | |
| 証券、商品先物取引業 | 0.71 | | |
| 保険業 | 1.95 | | |
| その他金融業 | 1.10 | | |
| 不動産業 | 1.93 | | |
| サービス業 | 5.82 | | |
| 合計 | | | 96.63 |

(参考) 国内債券マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|---------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第13 9回 | 420,000,000 | 100.70 | 422,940,000 | 100.54 | 422,284,800 | 0.1 | 2024/3/20 | 1.71 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第13 4回 | 370,000,000 | 100.37 | 371,369,000 | 100.26 | 370,969,400 | 0.1 | 2022/12/20 | 1.50 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 45回 | 360,000,000 | 101.01 | 363,636,000 | 100.94 | 363,394,800 | 0.1 | 2026/12/20 | 1.47 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 32回 | 350,000,000 | 101.93 | 356,786,500 | 101.59 | 355,565,000 | 0.6 | 2023/12/20 | 1.43 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第14 0回 | 340,000,000 | 100.64 | 342,204,800 | 100.59 | 342,036,600 | 0.1 | 2024/6/20 | 1.38 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 52回 | 300,000,000 | 113.17 | 339,534,000 | 113.11 | 339,336,000 | 1.2 | 2035/3/20 | 1.37 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 40回 | 330,000,000 | 102.30 | 337,596,600 | 102.03 | 336,708,900 | 0.4 | 2025/9/20 | 1.36 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 52回 | 310,000,000 | 100.95 | 312,945,000 | 101.01 | 313,140,300 | 0.1 | 2028/9/20 | 1.26 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 41回 | 300,000,000 | 101.92 | 305,769,000 | 101.71 | 305,148,000 | 0.3 | 2025/12/20 | 1.23 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 50回 | 300,000,000 | 101.06 | 303,180,000 | 101.03 | 303,114,000 | 0.1 | 2028/3/20 | 1.22 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 44回 | 300,000,000 | 100.99 | 302,988,000 | 100.92 | 302,769,000 | 0.1 | 2026/9/20 | 1.22 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 38回 | 280,000,000 | 102.05 | 285,740,000 | 101.77 | 284,967,200 | 0.4 | 2025/3/20 | 1.15 |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 46回 | 270,000,000 | 101.03 | 272,790,300 | 100.98 | 272,667,600 | 0.1 | 2027/3/20 | 1.10 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第14 5回 | 270,000,000 | 100.98 | 272,646,000 | 100.81 | 272,205,900 | 0.1 | 2025/9/20 | 1.10 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 33回 | 250,000,000 | 102.13 | 255,342,500 | 101.76 | 254,420,000 | 0.6 | 2024/3/20 | 1.03 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 49回 | 250,000,000 | 101.08 | 252,719,300 | 101.06 | 252,652,500 | 0.1 | 2027/12/20 | 1.02 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 53回 | 250,000,000 | 100.95 | 252,387,000 | 101.01 | 252,532,500 | 0.1 | 2028/12/20 | 1.02 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第14 6回 | 250,000,000 | 100.97 | 252,432,500 | 100.84 | 252,117,500 | 0.1 | 2025/12/20 | 1.02 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 26回 | 240,000,000 | 101.33 | 243,194,400 | 100.98 | 242,371,200 | 0.7 | 2022/12/20 | 0.98 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 27回 | 230,000,000 | 101.49 | 233,433,900 | 101.11 | 232,553,000 | 0.8 | 2022/12/20 | 0.94 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 28回 | 230,000,000 | 101.35 | 233,125,700 | 101.04 | 232,412,700 | 0.6 | 2023/3/20 | 0.94 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 42回 | 230,000,000 | 100.97 | 232,231,000 | 100.87 | 232,010,200 | 0.1 | 2026/3/20 | 0.93 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------|---------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-------|-----------|------|
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第13 7回 | 230,000,000 | 100.54 | 231,260,800 | 100.43 | 230,998,200 | 0.1 | 2023/9/20 | 0.93 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 34回 | 220,000,000 | 102.31 | 225,082,000 | 101.96 | 224,318,600 | 0.6 | 2024/6/20 | 0.90 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 45回 | 190,000,000 | 118.36 | 224,891,600 | 118.05 | 224,298,800 | 1.7 | 2033/6/20 | 0.90 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 30回 | 220,000,000 | 102.22 | 224,899,400 | 101.80 | 223,973,200 | 0.8 | 2023/9/20 | 0.90 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第14 8回 | 220,000,000 | 100.50 | 221,114,200 | 100.42 | 220,937,200 | 0.005 | 2026/6/20 | 0.89 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 51回 | 210,000,000 | 101.12 | 212,363,000 | 101.01 | 212,123,100 | 0.1 | 2028/6/20 | 0.85 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 35回 | 200,000,000 | 102.14 | 204,288,000 | 101.83 | 203,664,000 | 0.5 | 2024/9/20 | 0.82 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 47回 | 200,000,000 | 101.08 | 202,166,100 | 101.03 | 202,066,000 | 0.1 | 2027/6/20 | 0.81 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.17 |
| 合計 | 99.17 |

(参考)外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|----|-------------------|--|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | APPLE INC | コン ピュー タ・周辺 機器 | 2,932,600 | 13,530.22 | 39,678,751,117 | 15,985.53 | 46,879,175,835 | 4.30 |
| 2 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフト ウェア | 1,257,400 | 26,216.29 | 32,964,369,164 | 31,785.28 | 39,966,811,072 | 3.67 |
| 3 | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | インター ネット販 売・通信 販売 | 79,770 | 346,318.14 | 27,625,798,698 | 369,461.35 | 29,471,931,921 | 2.70 |
| 4 | アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス | 421,100 | 32,582.15 | 13,720,343,575 | 38,009.15 | 16,005,653,570 | 1.47 |
| 5 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス | 52,850 | 232,139.70 | 12,268,583,222 | 300,736.87 | 15,893,943,812 | 1.46 |
| 6 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス | 51,180 | 233,504.88 | 11,950,780,268 | 301,111.80 | 15,410,902,252 | 1.41 |
| 7 | アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車 | 143,900 | 71,912.65 | 10,348,230,520 | 87,444.21 | 12,583,222,567 | 1.15 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----|------------------------------|-------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|----------------|------|
| 8 | アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 437,940 | 14,766.04 | 6,466,643,504 | 22,962.62 | 10,056,252,606 | 0.92 |
| 9 | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 532,000 | 17,308.22 | 9,207,976,183 | 18,573.12 | 9,880,901,968 | 0.90 |
| 10 | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品 | 462,800 | 18,499.66 | 8,561,642,945 | 18,357.11 | 8,495,674,396 | 0.78 |
| 11 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 情報技術サービス | 297,300 | 23,851.26 | 7,090,980,683 | 25,370.02 | 7,542,508,611 | 0.69 |
| 12 | アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 165,800 | 42,094.00 | 6,979,186,100 | 44,813.88 | 7,430,142,498 | 0.68 |
| 13 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 各種金融サービス | 233,100 | 29,075.31 | 6,777,454,931 | 31,034.29 | 7,234,094,584 | 0.66 |
| 14 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 専門小売り | 186,900 | 34,287.07 | 6,408,253,731 | 37,709.20 | 7,047,850,527 | 0.64 |
| 15 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品 | 430,200 | 15,185.43 | 6,532,776,070 | 15,894.87 | 6,837,976,688 | 0.62 |
| 16 | スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品 | 506,300 | 12,747.83 | 6,454,231,387 | 13,481.70 | 6,825,787,140 | 0.62 |
| 17 | アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 1,355,000 | 4,374.47 | 5,927,409,740 | 4,820.39 | 6,531,634,412 | 0.60 |
| 18 | オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・半導体製造装置 | 73,720 | 67,702.71 | 4,991,044,084 | 84,110.32 | 6,200,612,938 | 0.56 |
| 19 | アメリカ | 株式 | DISNEY (WALT) CO | 娯楽 | 319,300 | 20,722.87 | 6,616,814,989 | 19,326.34 | 6,170,902,150 | 0.56 |
| 20 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC | 情報技術サービス | 155,500 | 40,143.65 | 6,242,338,848 | 39,529.02 | 6,146,763,356 | 0.56 |
| 21 | アメリカ | 株式 | PAYPAL HOLDINGS INC | 情報技術サービス | 196,100 | 26,680.28 | 5,232,004,735 | 28,987.28 | 5,684,405,608 | 0.52 |
| 22 | アメリカ | 株式 | ADOBE INC | ソフトウェア | 84,000 | 52,725.06 | 4,428,905,058 | 64,656.18 | 5,431,119,456 | 0.49 |
| 23 | アメリカ | 株式 | NETFLIX INC | 娯楽 | 77,920 | 57,501.14 | 4,480,488,947 | 67,046.79 | 5,224,286,282 | 0.48 |
| 24 | アメリカ | 株式 | SALESFORCE.COM INC | ソフトウェア | 170,740 | 23,774.97 | 4,059,339,311 | 30,274.35 | 5,169,044,226 | 0.47 |
| 25 | アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア | 805,700 | 6,172.37 | 4,973,086,493 | 6,259.68 | 5,043,428,688 | 0.46 |
| 26 | スイス | 株式 | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 医薬品 | 123,500 | 36,633.02 | 4,524,178,247 | 40,525.43 | 5,004,891,099 | 0.45 |
| 27 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | 石油・ガス・消耗燃料 | 744,000 | 6,364.56 | 4,735,238,278 | 6,701.76 | 4,986,116,582 | 0.45 |
| 28 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品 | 984,100 | 4,080.87 | 4,015,985,768 | 4,871.87 | 4,794,414,746 | 0.44 |
| 29 | アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS | 通信機器 | 740,600 | 5,814.16 | 4,305,967,671 | 6,209.32 | 4,598,623,577 | 0.42 |
| 30 | アメリカ | 株式 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | ライフサイエンス・ツール/サービス | 69,070 | 50,859.77 | 3,512,884,334 | 64,868.83 | 4,480,490,226 | 0.41 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内 / 国外 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|---------|----------------------|----------|
| 株式 | 国外 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 4.78 |
| | | メディア | 1.07 |
| | | 娯楽 | 1.51 |
| | | 不動産管理・開発 | 0.39 |
| | | エネルギー設備・サービス | 0.15 |
| | | 石油・ガス・消耗燃料 | 3.16 |
| | | 化学 | 2.03 |
| | | 建設資材 | 0.24 |

| | |
|-------------------------|------|
| 容器・包装 | 0.27 |
| 金属・鉱業 | 1.29 |
| 紙製品・林産品 | 0.10 |
| 航空宇宙・防衛 | 1.45 |
| 建設関連製品 | 0.60 |
| 建設・土木 | 0.21 |
| 電気設備 | 0.87 |
| コングロマリット | 1.10 |
| 機械 | 1.64 |
| 商社・流通業 | 0.31 |
| 商業サービス・用品 | 0.43 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.60 |
| 旅客航空輸送業 | 0.05 |
| 海運業 | 0.08 |
| 陸運・鉄道 | 1.00 |
| 運送インフラ | 0.13 |
| 自動車部品 | 0.25 |
| 自動車 | 1.84 |
| 家庭用耐久財 | 0.35 |
| レジャー用品 | 0.06 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.43 |
| ホテル・レストラン・レジャー | 1.86 |
| 販売 | 0.09 |
| インターネット販売・通信販売 | 3.33 |
| 複合小売り | 0.49 |
| 専門小売り | 1.72 |
| 食品・生活必需品小売り | 1.37 |
| 飲料 | 1.54 |
| 食品 | 1.50 |
| タバコ | 0.65 |
| 家庭用品 | 1.07 |
| パーソナル用品 | 0.59 |
| ヘルスケア機器・用品 | 3.06 |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 1.90 |
| バイオテクノロジー | 1.74 |
| 医薬品 | 4.51 |
| 銀行 | 6.10 |
| 各種金融サービス | 0.88 |
| 保険 | 2.97 |
| 情報技術サービス | 4.48 |
| ソフトウェア | 7.72 |
| 通信機器 | 0.68 |
| コンピュータ・周辺機器 | 4.58 |

| | | |
|------|--------------------|-------|
| | 電子装置・機器・部品 | 0.55 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.57 |
| | 各種電気通信サービス | 1.33 |
| | 無線通信サービス | 0.26 |
| | 電力 | 1.65 |
| | ガス | 0.13 |
| | 総合公益事業 | 0.77 |
| | 水道 | 0.10 |
| | 消費者金融 | 0.50 |
| | 資本市場 | 3.25 |
| | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.09 |
| | ヘルスケア・テクノロジー | 0.14 |
| | ライフサイエンス・ツール/サービス | 1.18 |
| | 専門サービス | 0.80 |
| 投資証券 | | 2.23 |
| 合 計 | | 98.08 |

(参考) 外国債券マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|--------------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 116,100,000 | 15,192.43 | 17,638,419,613 | 15,040.12 | 17,461,584,074 | 5.375 | 2031/2/15 | 2.85 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 65,000,000 | 13,971.55 | 9,081,513,194 | 13,656.86 | 8,876,960,486 | 6 | 2026/2/15 | 1.45 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 60,700,000 | 14,522.73 | 8,815,299,936 | 14,291.65 | 8,675,037,071 | 5.5 | 2028/8/15 | 1.41 |
| 4 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 66,000,000 | 11,471.13 | 7,570,952,290 | 11,401.41 | 7,524,932,179 | 1.5 | 2023/2/28 | 1.23 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 57,600,000 | 12,440.06 | 7,165,477,542 | 12,329.56 | 7,101,827,479 | 2.875 | 2028/5/15 | 1.16 |
| 6 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 48,400,000 | 14,384.07 | 6,961,892,396 | 14,202.47 | 6,873,996,586 | 5.25 | 2028/11/15 | 1.12 |
| 7 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 55,050,000 | 11,503.63 | 6,332,750,638 | 11,429.83 | 6,292,121,415 | 1.75 | 2023/1/31 | 1.02 |
| 8 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 52,700,000 | 11,984.08 | 6,315,614,855 | 11,828.10 | 6,233,412,596 | 2.25 | 2025/11/15 | 1.01 |
| 9 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 51,500,000 | 11,717.06 | 6,034,286,667 | 12,086.48 | 6,224,539,665 | 2.5 | 2046/2/15 | 1.01 |
| 10 | スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT | 28,200,000 | 20,331.27 | 5,733,418,732 | 20,310.10 | 5,727,449,328 | 5.75 | 2032/7/30 | 0.93 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 48,500,000 | 11,922.68 | 5,782,503,598 | 11,795.31 | 5,720,729,323 | 2.5 | 2024/5/15 | 0.93 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 45,100,000 | 11,926.91 | 5,379,037,081 | 11,791.82 | 5,318,111,131 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.86 |
| 13 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 29,300,000 | 17,815.49 | 5,219,939,566 | 17,828.47 | 5,223,744,464 | 5.25 | 2029/11/1 | 0.85 |
| 14 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 29,200,000 | 18,015.31 | 5,260,470,769 | 17,831.07 | 5,206,674,367 | 6.5 | 2027/11/1 | 0.85 |
| 15 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 28,000,000 | 18,854.69 | 5,279,315,584 | 18,595.05 | 5,206,615,671 | 5.5 | 2029/4/25 | 0.85 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|-------------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| 16 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 25,550,000 | 20,080.29 | 5,130,514,953 | 20,283.53 | 5,182,443,102 | 3.25 | 2045/5/25 | 0.84 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 44,000,000 | 11,782.65 | 5,184,370,060 | 11,667.66 | 5,133,770,400 | 2.25 | 2023/12/31 | 0.83 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 43,600,000 | 11,848.87 | 5,166,111,573 | 11,721.43 | 5,110,544,825 | 2.125 | 2024/9/30 | 0.83 |
| 19 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 24,600,000 | 20,865.37 | 5,132,882,409 | 20,713.62 | 5,095,551,939 | 4.75 | 2035/4/25 | 0.83 |
| 20 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 33,100,000 | 15,554.63 | 5,148,582,795 | 15,359.19 | 5,083,892,387 | 3.5 | 2026/4/25 | 0.83 |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 42,300,000 | 12,043.66 | 5,094,470,345 | 11,917.73 | 5,041,200,081 | 2.375 | 2026/4/30 | 0.82 |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 42,600,000 | 11,902.86 | 5,070,621,169 | 11,770.39 | 5,014,189,583 | 2.75 | 2023/11/15 | 0.82 |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 43,300,000 | 11,438.22 | 4,952,750,992 | 11,375.39 | 4,925,548,177 | 1.875 | 2022/8/31 | 0.80 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 38,800,000 | 12,731.33 | 4,939,758,557 | 12,446.29 | 4,829,160,829 | 6.25 | 2023/8/15 | 0.78 |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 39,900,000 | 11,731.05 | 4,680,689,544 | 12,067.68 | 4,815,006,548 | 2.5 | 2045/2/15 | 0.78 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 35,700,000 | 12,799.61 | 4,569,463,831 | 13,123.49 | 4,685,087,392 | 3 | 2044/11/15 | 0.76 |
| 27 | イギリス | 国債証券 | UK TSY 3 1/4% 2044 | 22,200,000 | 20,892.11 | 4,638,049,035 | 20,592.06 | 4,571,437,728 | 3.25 | 2044/1/22 | 0.74 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 38,000,000 | 12,079.48 | 4,590,206,118 | 11,964.50 | 4,546,513,759 | 2.375 | 2027/5/15 | 0.74 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 37,700,000 | 11,898.28 | 4,485,651,590 | 11,780.89 | 4,441,395,749 | 2.25 | 2024/11/15 | 0.72 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 37,100,000 | 11,829.41 | 4,388,714,484 | 11,696.95 | 4,339,568,666 | 2.75 | 2023/7/31 | 0.70 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 98.96 |
| 合計 | 98.96 |

(参考) 新興国株式マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|--------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 半導体・半 導体製造装 置 | 1,826,000 | 2,410.87 | 4,402,259,850 | 2,335.31 | 4,264,279,712 | 6.26 |
| 2 | アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | | 4,365,400 | 696.75 | 3,041,623,493 | 691.80 | 3,020,007,729 | 4.43 |
| 3 | 香港 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス | 426,700 | 8,611.40 | 3,674,486,026 | 6,686.70 | 2,853,214,890 | 4.19 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----|-------------------------------|-------------------|-----------|----------|---------------|----------|---------------|------|
| 4 | 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS | コンピュータ・周辺機器 | 354,000 | 7,747.00 | 2,742,440,393 | 7,017.27 | 2,484,113,580 | 3.65 |
| 5 | 香港 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED | インターネット販売・通信販売 | 1,123,080 | 3,133.43 | 3,519,095,944 | 2,132.55 | 2,395,028,746 | 3.51 |
| 6 | 香港 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | インターネット販売・通信販売 | 298,500 | 4,022.09 | 1,200,594,853 | 3,595.00 | 1,073,107,500 | 1.57 |
| 7 | インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 石油・ガス・消耗燃料 | 211,500 | 2,939.18 | 621,637,623 | 3,817.05 | 807,306,815 | 1.18 |
| 8 | インド | 株式 | INFOSYS LTD | 情報技術サービス | 252,600 | 2,050.83 | 518,040,984 | 2,555.29 | 645,468,149 | 0.94 |
| 9 | 香港 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 7,128,000 | 89.62 | 638,826,669 | 80.09 | 570,928,565 | 0.83 |
| 10 | インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 貯蓄・抵当・不動産金融 | 127,000 | 3,776.24 | 479,583,103 | 4,147.13 | 526,686,717 | 0.77 |
| 11 | アメリカ | 株式 | JD.COM INC-ADR | インターネット販売・通信販売 | 64,060 | 8,445.11 | 540,994,229 | 8,015.71 | 513,486,408 | 0.75 |
| 12 | 香港 | 株式 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | ライフサイエンス・ツール/サービス | 266,500 | 1,505.69 | 401,268,892 | 1,809.00 | 482,099,566 | 0.70 |
| 13 | アメリカ | 株式 | PJSC GAZPROM-ADR | 石油・ガス・消耗燃料 | 434,000 | 732.45 | 317,884,211 | 1,106.44 | 480,195,446 | 0.70 |
| 14 | ブラジル | 株式 | VALE SA | 金属・鉱業 | 293,821 | 2,384.43 | 700,597,481 | 1,566.64 | 460,314,540 | 0.67 |
| 15 | 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 111,538 | 4,184.86 | 466,771,388 | 3,676.10 | 410,025,199 | 0.60 |
| 16 | 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS PFD | コンピュータ・周辺機器 | 60,990 | 7,070.87 | 431,252,519 | 6,676.34 | 407,190,586 | 0.59 |
| 17 | インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 374,200 | 920.27 | 344,368,216 | 1,071.34 | 400,897,299 | 0.58 |
| 18 | アメリカ | 株式 | NIO INC ADR | 自動車 | 100,800 | 4,186.14 | 421,963,247 | 3,931.74 | 396,320,360 | 0.58 |
| 19 | アメリカ | 株式 | PJSC SBERBANK OF RUSSIA | 銀行 | 777,000 | 482.28 | 374,736,469 | 504.27 | 391,818,745 | 0.57 |
| 20 | 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 電子装置・機器・部品 | 924,649 | 472.41 | 436,815,763 | 422.77 | 390,915,707 | 0.57 |

| | | | | | | | | | | |
|----|---------|----|------------------------------|----------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 21 | インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVS LTD | 情報技術サービス | 67,800 | 4,732.77 | 320,882,153 | 5,725.76 | 388,207,138 | 0.57 |
| 22 | 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 40,470 | 12,245.40 | 495,571,450 | 9,470.00 | 383,250,900 | 0.56 |
| 23 | 香港 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 469,000 | 1,169.83 | 548,653,116 | 784.42 | 367,897,201 | 0.54 |
| 24 | アメリカ | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 19,980 | 21,426.45 | 428,100,525 | 17,002.88 | 339,717,670 | 0.49 |
| 25 | アメリカ | 株式 | LUKOIL PJSC-SPON ADR | 石油・ガス・消耗燃料 | 31,430 | 9,267.95 | 291,291,831 | 10,791.32 | 339,171,389 | 0.49 |
| 26 | 香港 | 株式 | XIAOMI CORPORATION | コンピュータ・周辺機器 | 1,064,000 | 365.13 | 388,506,706 | 316.36 | 336,607,040 | 0.49 |
| 27 | サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK | 銀行 | 92,700 | 2,979.21 | 276,173,029 | 3,616.69 | 335,267,163 | 0.49 |
| 28 | 韓国 | 株式 | NAVER CORP | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 9,130 | 34,424.23 | 314,293,250 | 36,648.90 | 334,604,457 | 0.49 |
| 29 | アメリカ | 株式 | PINDUODUO INC ADR | インターネット販売・通信販売 | 32,510 | 14,864.01 | 483,229,193 | 9,967.59 | 324,046,520 | 0.47 |
| 30 | 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | インターネット販売・通信販売 | 16,130 | 24,475.54 | 394,790,599 | 18,929.70 | 305,336,061 | 0.44 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内/国外 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|-------|----------------------|---------|
| 株式 | 国外 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 6.10 |
| | | メディア | 0.19 |
| | | 娯楽 | 0.87 |
| | | 不動産管理・開発 | 1.58 |
| | | エネルギー設備・サービス | 0.05 |
| | | 石油・ガス・消耗燃料 | 5.46 |
| | | 化学 | 2.87 |
| | | 建設資材 | 1.03 |

| | |
|-------------------------|-------|
| 容器・包装 | 0.07 |
| 金属・鉱業 | 3.70 |
| 紙製品・林産品 | 0.16 |
| 航空宇宙・防衛 | 0.09 |
| 建設関連製品 | 0.02 |
| 建設・土木 | 0.49 |
| 電気設備 | 0.35 |
| コングロマリット | 0.92 |
| 機械 | 0.34 |
| 商社・流通業 | 0.08 |
| 商業サービス・用品 | 0.25 |
| 航空貨物・物流サービス | 0.22 |
| 旅客航空輸送業 | 0.10 |
| 海運業 | 0.49 |
| 陸運・鉄道 | 0.20 |
| 運送インフラ | 0.51 |
| 自動車部品 | 0.47 |
| 自動車 | 2.91 |
| 家庭用耐久財 | 0.29 |
| レジャー用品 | 0.09 |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.17 |
| ホテル・レストラン・レジャー | 0.95 |
| インターネット販売・通信販売 | 7.06 |
| 複合小売り | 0.31 |
| 専門小売り | 0.48 |
| 食品・生活必需品小売り | 1.17 |
| 飲料 | 0.77 |
| 食品 | 1.57 |
| タバコ | 0.38 |
| 家庭用品 | 0.42 |
| パーソナル用品 | 0.55 |
| ヘルスケア機器・用品 | 0.20 |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 0.66 |
| バイオテクノロジー | 0.90 |
| 医薬品 | 1.15 |
| 銀行 | 12.44 |

| | | |
|----------|--------------------|-------|
| | 各種金融サービス | 0.78 |
| | 保険 | 2.41 |
| | 情報技術サービス | 2.45 |
| | ソフトウェア | 0.28 |
| | 通信機器 | 0.11 |
| | コンピュータ・周辺機器 | 5.46 |
| | 電子装置・機器・部品 | 2.29 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 8.80 |
| | 各種電気通信サービス | 1.06 |
| | 無線通信サービス | 1.57 |
| | 電力 | 0.73 |
| | ガス | 0.56 |
| | 総合公益事業 | 0.02 |
| | 水道 | 0.10 |
| | 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.77 |
| | 消費者金融 | 0.56 |
| | 資本市場 | 0.77 |
| | 各種消費者サービス | 0.09 |
| | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.55 |
| | ヘルスケア・テクノロジー | 0.06 |
| | ライフサイエンス・ツール/サービス | 1.16 |
| | 専門サービス | 0.02 |
| | その他の業種 | 0.00 |
| 新株予約権証券 | | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | | 4.43 |
| 投資証券 | | 0.08 |
| 合 計 | | 95.51 |

(参考) 新興国債券マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|--------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION | 4,400,000 | 13,969.51 | 614,658,820 | 14,262.80 | 627,563,420 | 5.25 | 2047/6/23 | 2.34 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF ARGENTINA | 14,537,686 | 3,527.32 | 512,791,683 | 3,721.45 | 541,012,995 | 1.125 | 2035/7/9 | 2.02 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION | 3,600,000 | 12,529.19 | 451,051,030 | 12,494.35 | 449,796,854 | 4.25 | 2027/6/23 | 1.68 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|------------------------|------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| 4 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF ARGENTINA | 10,365,309 | 4,020.41 | 416,727,988 | 4,161.29 | 431,331,345 | 0.5 | 2030/7/9 | 1.61 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | TURKEY GLOBAL | 3,200,000 | 12,048.34 | 385,547,030 | 11,894.18 | 380,613,955 | 7.375 | 2025/2/5 | 1.42 |
| 6 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION | 2,800,000 | 13,264.72 | 371,412,339 | 13,479.64 | 377,430,054 | 5.1 | 2035/3/28 | 1.40 |
| 7 | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 3,100,000 | 12,164.58 | 377,102,129 | 11,316.79 | 350,820,515 | 5.625 | 2047/2/21 | 1.31 |
| 8 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF TURKEY | 2,900,000 | 11,760.86 | 341,065,009 | 11,498.56 | 333,458,242 | 6.375 | 2025/10/14 | 1.24 |
| 9 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF TURKEY | 2,700,000 | 12,132.57 | 327,579,544 | 11,935.02 | 322,245,694 | 7.625 | 2029/4/26 | 1.20 |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 2,600,000 | 12,522.08 | 325,574,161 | 12,391.44 | 322,177,612 | 5 | 2051/4/27 | 1.20 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 2,700,000 | 11,551.46 | 311,889,479 | 11,469.33 | 309,672,120 | 2.875 | 2025/6/6 | 1.15 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 1,900,000 | 16,308.16 | 309,855,164 | 16,280.31 | 309,326,053 | 6.75 | 2044/1/15 | 1.15 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF PERU | 2,000,000 | 15,079.09 | 301,581,815 | 15,367.62 | 307,352,466 | 5.625 | 2050/11/18 | 1.14 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | PHILIPPINES GLOBAL | 1,750,000 | 17,662.37 | 309,091,563 | 17,404.33 | 304,575,854 | 9.5 | 2030/2/2 | 1.13 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 2,400,000 | 12,628.71 | 303,089,209 | 12,651.49 | 303,635,826 | 4.15 | 2027/3/28 | 1.13 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF ARGENTINA | 6,886,159 | 4,290.33 | 295,439,593 | 4,373.72 | 301,181,428 | 2 | 2038/1/9 | 1.12 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 1,750,000 | 16,813.60 | 294,238,172 | 16,688.59 | 292,050,371 | 7.75 | 2038/1/17 | 1.09 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION | 2,000,000 | 14,226.20 | 284,524,143 | 14,577.06 | 291,541,303 | 5.625 | 2042/4/4 | 1.08 |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF PERU | 2,600,000 | 11,344.38 | 294,953,968 | 11,117.34 | 289,051,083 | 2.783 | 2031/1/23 | 1.07 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 1,900,000 | 15,098.86 | 286,878,493 | 15,186.48 | 288,543,156 | 5.95 | 2046/1/8 | 1.07 |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 2,400,000 | 12,192.62 | 292,622,955 | 11,833.13 | 283,995,210 | 4.625 | 2028/1/13 | 1.06 |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 2,200,000 | 12,617.46 | 277,584,320 | 12,620.37 | 277,648,338 | 4.5 | 2029/4/22 | 1.03 |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 2,010,000 | 13,898.51 | 279,360,059 | 13,765.71 | 276,690,818 | 6.05 | 2040/1/11 | 1.03 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 1,900,000 | 14,344.72 | 272,549,823 | 14,445.24 | 274,459,649 | 5.35 | 2049/2/11 | 1.02 |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 2,500,000 | 11,937.96 | 298,449,230 | 10,968.38 | 274,209,596 | 5 | 2045/6/15 | 1.02 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF PANAMA | 2,200,000 | 12,574.36 | 276,636,021 | 12,224.35 | 268,935,701 | 4.5 | 2056/4/1 | 1.00 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF TURKEY | 2,600,000 | 10,571.50 | 274,859,202 | 10,309.29 | 268,041,752 | 6.625 | 2045/2/17 | 1.00 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | UKRAINE GOVERNMENT | 2,000,000 | 13,107.26 | 262,145,292 | 13,163.35 | 263,267,178 | 9.75 | 2028/11/1 | 0.98 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF TURKEY | 2,300,000 | 11,340.29 | 260,826,762 | 11,176.04 | 257,048,925 | 6 | 2027/3/25 | 0.96 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION | 2,000,000 | 12,612.69 | 252,253,802 | 12,708.00 | 254,160,023 | 4.375 | 2029/3/21 | 0.94 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 98.19 |
| 合計 | 98.19 |

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|--------|------|-----------------------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 9,500,000 | 3,036.75 | 288,491,283 | 2,983.38 | 283,421,244 | 2.75 | 2028/4/25 | 2.86 |
| 2 | 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 14,000,000 | 1,846.92 | 258,569,101 | 1,858.18 | 260,145,813 | 3.6 | 2030/5/21 | 2.63 |
| 3 | ブラジル | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL | 13,100,000 | 1,726.44 | 226,164,758 | 1,608.53 | 210,718,445 | | 2024/1/1 | 2.13 |
| 4 | 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 11,500,000 | 1,807.82 | 207,899,641 | 1,810.23 | 208,176,750 | 3.48 | 2027/6/29 | 2.10 |
| 5 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 6,500,000 | 2,936.05 | 190,843,327 | 2,884.52 | 187,493,800 | 2.5 | 2023/1/25 | 1.89 |
| 6 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 6,100,000 | 2,790.05 | 170,193,083 | 2,779.53 | 169,551,684 | 0.75 | 2025/4/25 | 1.71 |
| 7 | 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 8,000,000 | 1,885.43 | 150,834,674 | 1,881.76 | 150,541,013 | 4.15 | 2027/12/4 | 1.52 |
| 8 | 南アフリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 21,100,000 | 703.53 | 148,444,833 | 684.81 | 144,496,198 | 8 | 2030/1/31 | 1.46 |
| 9 | ブラジル | 国債証券 | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 610,000 | 2,265.02 | 138,177,099 | 2,132.04 | 130,054,803 | 10 | 2023/1/1 | 1.31 |
| 10 | メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 23,900,000 | 548.62 | 131,121,841 | 520.41 | 124,378,287 | 5.75 | 2026/3/5 | 1.25 |
| 11 | 南アフリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 14,900,000 | 859.18 | 128,019,002 | 828.31 | 123,419,369 | 10.5 | 2026/12/21 | 1.24 |
| 12 | メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 19,350,000 | 608.06 | 117,659,822 | 554.53 | 107,301,866 | 7.5 | 2027/6/3 | 1.08 |
| 13 | メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 18,700,000 | 603.75 | 112,902,836 | 566.12 | 105,866,263 | 8 | 2024/9/5 | 1.07 |
| 14 | ブラジル | 国債証券 | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 481,000 | 2,335.50 | 112,346,954 | 2,103.68 | 101,187,201 | 10 | 2025/1/1 | 1.02 |
| 15 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3,600,000 | 2,834.15 | 102,029,474 | 2,771.30 | 99,766,876 | 3.885 | 2029/8/15 | 1.00 |
| 16 | チェコ | 国債証券 | CZECH REPUBLIC | 20,500,000 | 475.68 | 97,514,526 | 465.15 | 95,356,645 | 0.25 | 2027/2/10 | 0.96 |
| 17 | インドネシア | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 11,100,000,000 | 0.82 | 92,070,992 | 0.82 | 92,118,345 | 7 | 2030/9/15 | 0.93 |
| 18 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 3,000,000 | 2,969.53 | 89,085,903 | 2,951.75 | 88,552,663 | 2.5 | 2027/7/25 | 0.89 |
| 19 | メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 14,100,000 | 651.14 | 91,811,245 | 598.30 | 84,361,444 | 10 | 2024/12/5 | 0.85 |
| 20 | 南アフリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 13,900,000 | 614.58 | 85,426,655 | 606.82 | 84,348,050 | 8.75 | 2048/2/28 | 0.85 |
| 21 | チェコ | 国債証券 | CZECH REPUBLIC | 17,800,000 | 488.25 | 86,909,186 | 473.65 | 84,309,778 | 1.2 | 2031/3/13 | 0.85 |
| 22 | チェコ | 国債証券 | CZECH REPUBLIC | 16,600,000 | 502.88 | 83,478,927 | 487.38 | 80,905,162 | 1 | 2026/6/26 | 0.81 |
| 23 | タイ | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 23,900,000 | 338.95 | 81,009,357 | 337.82 | 80,739,014 | 1.45 | 2024/12/17 | 0.81 |
| 24 | ロシア | 国債証券 | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 51,000,000 | 162.71 | 82,983,436 | 158.14 | 80,654,149 | 7.7 | 2039/3/16 | 0.81 |
| 25 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,900,000 | 2,854.74 | 82,787,503 | 2,732.65 | 79,246,996 | 3.733 | 2028/6/15 | 0.80 |
| 26 | 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 4,500,000 | 1,696.41 | 76,338,787 | 1,713.71 | 77,117,040 | 2.2 | 2025/7/27 | 0.77 |
| 27 | インドネシア | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 8,800,000,000 | 0.86 | 75,897,070 | 0.86 | 75,915,840 | 8.125 | 2024/5/15 | 0.76 |
| 28 | ロシア | 国債証券 | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 47,700,000 | 166.76 | 79,547,502 | 158.49 | 75,603,718 | 7.95 | 2026/10/7 | 0.76 |
| 29 | コロンビア | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 2,210,000,000 | 3.78 | 83,722,254 | 3.40 | 75,174,748 | 9.85 | 2027/6/28 | 0.76 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------|-----------------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-----|------------|------|
| 30 | タイ | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 22,300,000 | 335.95 | 74,917,320 | 329.29 | 73,433,437 | 1.6 | 2029/12/17 | 0.74 |
|----|----|------|-----------------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-----|------------|------|

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.22 |
| 合 計 | 96.22 |

(参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|------------------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 4,350 | 728,729 | 3,169,973,977 | 725,000 | 3,153,750,000 | 7.02 |
| 2 | 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 3,838 | 686,885 | 2,636,267,239 | 668,000 | 2,563,784,000 | 5.70 |
| 3 | 日本 | 投資証券 | G L P 投資法人 投資証券 | 12,431 | 188,268 | 2,340,364,977 | 183,200 | 2,277,359,200 | 5.07 |
| 4 | 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 6,081 | 356,191 | 2,165,998,261 | 372,500 | 2,265,172,500 | 5.04 |
| 5 | 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 投資証券 | 19,365 | 115,295 | 2,232,692,709 | 107,300 | 2,077,864,500 | 4.62 |
| 6 | 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 12,412 | 182,425 | 2,264,266,547 | 160,600 | 1,993,367,200 | 4.43 |
| 7 | 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 5,763 | 326,862 | 1,883,711,296 | 326,500 | 1,881,619,500 | 4.19 |
| 8 | 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 投資証券 | 7,647 | 213,524 | 1,632,818,257 | 194,000 | 1,483,518,000 | 3.30 |
| 9 | 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 3,838 | 367,654 | 1,411,058,700 | 362,000 | 1,389,356,000 | 3.09 |
| 10 | 日本 | 投資証券 | ユニテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 8,640 | 160,961 | 1,390,704,163 | 150,800 | 1,302,912,000 | 2.90 |
| 11 | 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 5,449 | 206,122 | 1,123,161,284 | 202,700 | 1,104,512,300 | 2.45 |
| 12 | 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 11,289 | 92,778 | 1,047,378,744 | 92,400 | 1,043,103,600 | 2.32 |
| 13 | 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 2,522 | 448,762 | 1,131,778,293 | 405,000 | 1,021,410,000 | 2.27 |
| 14 | 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 2,045 | 504,501 | 1,031,706,283 | 457,000 | 934,565,000 | 2.08 |
| 15 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 1,187 | 807,380 | 958,360,285 | 767,000 | 910,429,000 | 2.02 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|------|------------------------------|--------|---------|-------------|---------|-------------|------|
| 16 | 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 4,699 | 181,203 | 851,476,327 | 187,500 | 881,062,500 | 1.96 |
| 17 | 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 1,427 | 590,117 | 842,098,186 | 590,000 | 841,930,000 | 1.87 |
| 18 | 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 2,508 | 323,376 | 811,028,362 | 331,000 | 830,148,000 | 1.84 |
| 19 | 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 1,325 | 651,385 | 863,085,959 | 625,000 | 828,125,000 | 1.84 |
| 20 | 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 11,758 | 70,236 | 825,846,175 | 67,100 | 788,961,800 | 1.75 |
| 21 | 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 16,893 | 46,390 | 783,676,405 | 43,900 | 741,602,700 | 1.65 |
| 22 | 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 4,513 | 164,239 | 741,212,547 | 151,000 | 681,463,000 | 1.51 |
| 23 | 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 投資証券 | 4,514 | 158,339 | 714,746,534 | 149,800 | 676,197,200 | 1.50 |
| 24 | 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 1,346 | 520,174 | 700,154,890 | 489,000 | 658,194,000 | 1.46 |
| 25 | 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 811 | 794,533 | 644,366,725 | 752,000 | 609,872,000 | 1.35 |
| 26 | 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 1,728 | 356,827 | 616,597,747 | 343,500 | 593,568,000 | 1.32 |
| 27 | 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 3,374 | 185,024 | 624,271,549 | 175,500 | 592,137,000 | 1.31 |
| 28 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 2,621 | 233,304 | 611,491,671 | 217,200 | 569,281,200 | 1.26 |
| 29 | 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 投資証券 | 5,078 | 119,521 | 606,931,455 | 111,800 | 567,720,400 | 1.26 |
| 30 | 日本 | 投資証券 | N T T都市開発リート投資法人 | 3,467 | 165,998 | 575,516,903 | 153,400 | 531,837,800 | 1.18 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.09 |
| 合計 | 97.09 |

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|----|------|------|--------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------|
| 1 | アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 190,360 | 13,865.74 | 2,639,483,686 | 14,151.16 | 2,693,815,731 | 6.11 |

| | | | | | | | | | |
|----|---------|------|------------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 2 | アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 23,080 | 90,763.29 | 2,094,816,747 | 89,712.83 | 2,070,572,200 | 4.70 |
| 3 | アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 39,280 | 33,010.64 | 1,296,658,304 | 33,835.65 | 1,329,064,505 | 3.01 |
| 4 | アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 84,440 | 15,130.23 | 1,277,596,984 | 14,980.49 | 1,264,952,744 | 2.87 |
| 5 | アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 72,700 | 17,975.04 | 1,306,785,990 | 16,425.37 | 1,194,125,068 | 2.71 |
| 6 | アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 108,700 | 8,872.47 | 964,437,814 | 9,377.77 | 1,019,364,338 | 2.31 |
| 7 | アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 35,990 | 23,666.62 | 851,761,956 | 25,182.00 | 906,300,180 | 2.05 |
| 8 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 87,700 | 8,895.34 | 780,122,131 | 9,127.07 | 800,444,565 | 1.81 |
| 9 | アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 35,690 | 21,313.25 | 760,669,909 | 21,582.65 | 770,284,878 | 1.74 |
| 10 | オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 433,400 | 1,638.59 | 710,168,942 | 1,710.57 | 741,365,199 | 1.68 |
| 11 | アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 100,200 | 7,918.86 | 793,469,934 | 7,392.31 | 740,710,063 | 1.68 |
| 12 | アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 34,340 | 17,849.28 | 612,944,508 | 19,251.35 | 661,091,675 | 1.50 |
| 13 | アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 148,400 | 4,210.64 | 624,859,455 | 4,359.28 | 646,917,746 | 1.46 |
| 14 | アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 101,300 | 6,422.81 | 650,631,467 | 6,313.40 | 639,548,149 | 1.45 |
| 15 | アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 29,880 | 19,023.97 | 568,436,463 | 21,259.20 | 635,225,016 | 1.44 |
| 16 | アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 29,850 | 19,801.37 | 591,071,087 | 21,145.04 | 631,179,611 | 1.43 |
| 17 | アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 16,700 | 34,751.28 | 580,346,387 | 36,254.24 | 605,445,902 | 1.37 |
| 18 | イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC | 308,000 | 1,634.89 | 503,546,916 | 1,814.18 | 558,769,226 | 1.26 |
| 19 | アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 97,500 | 5,471.40 | 533,462,203 | 5,441.55 | 530,551,164 | 1.20 |
| 20 | アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 138,500 | 3,875.93 | 536,817,229 | 3,806.39 | 527,186,289 | 1.19 |
| 21 | アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 158,400 | 3,595.15 | 569,472,902 | 3,231.13 | 511,811,055 | 1.16 |
| 22 | 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 539,000 | 1,087.02 | 585,905,351 | 938.29 | 505,741,005 | 1.14 |
| 23 | アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES | 36,600 | 13,639.11 | 499,191,516 | 12,447.74 | 455,587,372 | 1.03 |
| 24 | アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 25,920 | 14,987.76 | 388,482,985 | 16,798.07 | 435,406,047 | 0.98 |
| 25 | アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 71,800 | 5,578.09 | 400,507,063 | 5,991.07 | 430,159,372 | 0.97 |
| 26 | アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 47,600 | 8,620.04 | 410,314,373 | 8,276.48 | 393,960,638 | 0.89 |
| 27 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 43,800 | 8,548.44 | 374,421,868 | 8,888.68 | 389,324,464 | 0.88 |
| 28 | アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 158,500 | 2,477.54 | 392,691,599 | 2,400.68 | 380,508,414 | 0.86 |
| 29 | アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 74,600 | 5,241.58 | 391,022,515 | 4,959.17 | 369,954,470 | 0.83 |
| 30 | アメリカ | 投資証券 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 153,700 | 2,407.19 | 369,986,479 | 2,314.50 | 355,739,511 | 0.80 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 98.78 |
| 合計 | 98.78 |

(参考)野村マネー マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資比率 (%) |
|----|------|------|--------------------------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|--------|------------|----------|
| 1 | 日本 | 社債券 | クレディセゾン 第53回社債間限定同順位特約付 | 600,000,000 | 100.03 | 600,199,516 | 100.03 | 600,199,516 | 0.435 | 2021/10/22 | 7.35 |
| 2 | 日本 | 特殊債券 | 首都高速道路 第19回 | 500,000,000 | 100.01 | 500,086,686 | 100.01 | 500,086,686 | 0.07 | 2021/12/20 | 6.12 |
| 3 | 日本 | 社債券 | NTTファイナンス 第1回社債間限定同順位特約付 | 500,000,000 | 100.01 | 500,076,550 | 100.01 | 500,076,550 | 0.05 | 2021/12/20 | 6.12 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|-------|------------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-------|------------|------|
| 4 | 日本 | 社債券 | 三菱UFJリース 第43回社債間限定同順位特約付 | 500,000,000 | 100.01 | 500,054,043 | 100.01 | 500,054,043 | 0.06 | 2021/10/25 | 6.12 |
| 5 | 日本 | 特殊債券 | 阪神高速道路 第19回 | 460,000,000 | 100.01 | 460,061,046 | 100.01 | 460,061,046 | 0.02 | 2021/12/20 | 5.63 |
| 6 | 日本 | 地方債証券 | 熊本県 公募平成23年度第2回 | 340,000,000 | 100.08 | 340,274,424 | 100.08 | 340,274,424 | 1 | 2021/10/28 | 4.17 |
| 7 | 日本 | 社債券 | 中部電力 第522回 | 300,000,000 | 100.07 | 300,236,950 | 100.07 | 300,236,950 | 0.13 | 2022/4/25 | 3.67 |
| 8 | 日本 | 地方債証券 | 広島市 公募平成23年度第2回 | 200,000,000 | 100.07 | 200,147,208 | 100.07 | 200,147,208 | 1 | 2021/10/25 | 2.45 |
| 9 | 日本 | 特殊債券 | 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第94回 | 200,000,000 | 100.00 | 200,008,000 | 100.00 | 200,008,000 | 0.001 | 2021/12/20 | 2.45 |
| 10 | 日本 | 特殊債券 | 成田国際空港 第11回 | 100,000,000 | 100.41 | 100,411,800 | 100.41 | 100,411,800 | 1.067 | 2022/2/18 | 1.23 |
| 11 | 日本 | 地方債証券 | 東京都 公募第702回 | 100,000,000 | 100.23 | 100,235,310 | 100.23 | 100,235,310 | 1.04 | 2021/12/20 | 1.22 |
| 12 | 日本 | 地方債証券 | 大阪府 公募第354回 | 100,000,000 | 100.08 | 100,081,444 | 100.08 | 100,081,444 | 1.03 | 2021/10/28 | 1.22 |
| 13 | 日本 | 社債券 | 関西電力 第525回 | 100,000,000 | 100.03 | 100,034,594 | 100.03 | 100,034,594 | 0.14 | 2021/12/20 | 1.22 |
| 14 | 日本 | 特殊債券 | しんきん中金債券 利付第328回 | 100,000,000 | 100.03 | 100,033,946 | 100.03 | 100,033,946 | 0.06 | 2022/3/25 | 1.22 |
| 15 | 日本 | 社債券 | 北陸電力 第325回 | 100,000,000 | 100.02 | 100,023,115 | 100.02 | 100,023,115 | 0.14 | 2021/11/26 | 1.22 |
| 16 | 日本 | 特殊債券 | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第152回 | 77,000,000 | 100.28 | 77,219,254 | 100.28 | 77,219,254 | 1.1 | 2021/12/28 | 0.94 |
| 17 | 日本 | 地方債証券 | 広島市 公募平成23年度第5回 | 60,000,000 | 100.41 | 60,249,912 | 100.41 | 60,249,912 | 1.01 | 2022/2/25 | 0.73 |
| 18 | 日本 | 特殊債券 | 中日本高速道路社債 第42回 | 50,000,000 | 100.43 | 50,218,180 | 100.43 | 50,218,180 | 0.942 | 2022/3/18 | 0.61 |
| 19 | 日本 | 特殊債券 | 福祉医療機構債券 第55回財投機関債 | 50,000,000 | 100.00 | 50,002,500 | 100.00 | 50,002,500 | 0.001 | 2021/12/20 | 0.61 |
| 20 | 日本 | 特殊債券 | 政保 地方公共団体金融機構債券(8年) 第2回 | 30,000,000 | 100.13 | 30,039,630 | 100.13 | 30,039,630 | 0.502 | 2021/12/24 | 0.36 |
| 21 | 日本 | 特殊債券 | 商工債券 利付第802回い号 | 30,000,000 | 100.00 | 30,002,385 | 100.00 | 30,002,385 | 0.06 | 2022/3/25 | 0.36 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 地方債証券 | 9.81 |
| 特殊債券 | 19.58 |
| 社債券 | 25.74 |
| 合計 | 55.14 |

投資不動産物件

野村DC運用戦略ファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

野村DC運用戦略ファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|-------|--------------------|-----------|-----|-----|----------------|----------------|-----------------|
| 株価指数先物 取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物(2021年12月限) | 買建 | 540 | 日本円 | 11,161,040,100 | 10,964,700,000 | 2.61 |

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 国/地域 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 | 帳簿価額 (円) | 評価額 | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|-----------------|--------------------------------|--|-----------|-----|------------|---------------|----------------|-------------|----------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリカ | シカゴ マーカン タイル取 引所 | E-mini S&P500株 指指数先物(2021 年12月限) | 買建 | 630 | 米ドル | 139,663,112.5 | 15,631,095,551 | 137,017,125 | 15,334,956,630 | 1.40 |
| | カナダ | モントリ オール取 引所 | S&P TSX60株価指 数先物(2021年12 月限) | 買建 | 34 | カナダド ル | 8,305,076 | 729,268,723 | 8,174,280 | 717,783,524 | 0.06 |
| | ドイツ | ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所 | ユーロ50株価指 数先物(2021年12月 限) | 買建 | 409 | ユーロ | 16,908,937.5 | 2,195,794,623 | 16,617,670 | 2,157,970,623 | 0.19 |
| | オース トラリ ア | シドニー先 物取引所 | SPI200株価指 数先物(2021年12月 限) | 買建 | 31 | 豪ドル | 5,698,175 | 458,475,161 | 5,561,400 | 447,470,244 | 0.04 |
| | イギリ ス | ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所 | FT100株価指 数先物(2021年12月 限) | 買建 | 88 | 英ポンド | 6,175,335 | 928,955,645 | 6,226,000 | 936,577,177 | 0.08 |
| | スイス | ユーレック ス・チュー リッヒ取 引所 | SMI株価指 数先物(2021年12月 限) | 買建 | 44 | スイスフ ラン | 5,252,250 | 629,639,730 | 5,120,720 | 613,871,910 | 0.05 |

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 国/地域 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 | 帳簿価額 (円) | 評価額 | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|------------|----------------------------|---|-----------|-----|-----|------------|---------------|------------|---------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリカ | インターコ ンチネン タル取 引所 | E-mini MSCIエ マーキングマ ーケット株価指 数先物(2021年12月 限) | 買建 | 395 | 米ドル | 25,543,750 | 2,858,856,500 | 24,407,050 | 2,731,637,033 | 4.01 |
| | シンガ ポール | シンガポ ール取 引所 | SGX FTSE China A50 指数先物 (2021年10月 限) | 買建 | 136 | 米ドル | 2,057,109 | 230,231,641 | 2,097,800 | 234,785,776 | 0.34 |

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 取引所 | 名称 | 買建 / 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------------|-------|---------------------|---------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| REIT指数先物 取引 | 大阪取引所 | REIT指数先物(2021年12月限) | 買建 | 630 | 日本円 | 1,349,084,340 | 1,300,320,000 | 2.89 |

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 国 / 地域 | 取引所 | 名称 | 買建 / 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 | 帳簿価額 (円) | 評価額 | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|--------|----------------------------|--------------------------------------|---------|----|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリカ | シカゴ ボード オ ブ トレー ド | ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2021年12月限) | 買建 | 96 | 米ドル | 3,994,980 | 447,118,165 | 3,873,600 | 433,533,312 | 0.98 |

（参考）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

（3）運用実績

純資産の推移

野村DC運用戦略ファンド

2021年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額（百万円） | | 1口当たり純資産額(円) | |
|--|------------|-------|--------------|-------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| | | | | |

| | | | | | |
|--------|---------------|--------|--------|--------|--------|
| 第1計算期間 | (2013年 2月18日) | 49 | 49 | 1.0455 | 1.0460 |
| 第2計算期間 | (2014年 2月17日) | 1,930 | 1,931 | 1.0180 | 1.0185 |
| 第3計算期間 | (2015年 2月17日) | 2,707 | 2,708 | 1.0970 | 1.0975 |
| 第4計算期間 | (2016年 2月17日) | 3,631 | 3,633 | 1.0481 | 1.0486 |
| 第5計算期間 | (2017年 2月17日) | 6,788 | 6,791 | 1.0678 | 1.0683 |
| 第6計算期間 | (2018年 2月19日) | 19,147 | 19,156 | 1.0770 | 1.0775 |
| 第7計算期間 | (2019年 2月18日) | 21,964 | 21,974 | 1.0850 | 1.0855 |
| 第8計算期間 | (2020年 2月17日) | 27,659 | 27,671 | 1.1568 | 1.1573 |
| 第9計算期間 | (2021年 2月17日) | 30,540 | 30,553 | 1.1487 | 1.1492 |
| | 2020年 9月末日 | 28,681 | | 1.1205 | |
| | 10月末日 | 28,815 | | 1.1113 | |
| | 11月末日 | 29,682 | | 1.1369 | |
| | 12月末日 | 30,220 | | 1.1445 | |
| | 2021年 1月末日 | 30,416 | | 1.1439 | |
| | 2月末日 | 29,990 | | 1.1315 | |
| | 3月末日 | 30,484 | | 1.1362 | |
| | 4月末日 | 30,778 | | 1.1391 | |
| | 5月末日 | 30,951 | | 1.1416 | |
| | 6月末日 | 31,302 | | 1.1491 | |
| | 7月末日 | 31,675 | | 1.1563 | |
| | 8月末日 | 34,424 | | 1.1605 | |
| | 9月末日 | 34,196 | | 1.1473 | |

分配の推移

野村DC運用戦略ファンド

| | 計算期間 | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第1計算期間 | 2012年 2月28日～2013年 2月18日 | 0.0005円 |
| 第2計算期間 | 2013年 2月19日～2014年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第3計算期間 | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第4計算期間 | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第5計算期間 | 2016年 2月18日～2017年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第6計算期間 | 2017年 2月18日～2018年 2月19日 | 0.0005円 |
| 第7計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0005円 |
| 第8計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第9計算期間 | 2020年 2月18日～2021年 2月17日 | 0.0005円 |

収益率の推移

野村DC運用戦略ファンド

| | 計算期間 | 収益率 |
|-----------|-------------------------|------|
| 第1計算期間 | 2012年 2月28日～2013年 2月18日 | 4.6% |
| 第2計算期間 | 2013年 2月19日～2014年 2月17日 | 2.6% |
| 第3計算期間 | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 7.8% |
| 第4計算期間 | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 4.4% |
| 第5計算期間 | 2016年 2月18日～2017年 2月17日 | 1.9% |
| 第6計算期間 | 2017年 2月18日～2018年 2月19日 | 0.9% |
| 第7計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.8% |
| 第8計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月17日 | 6.7% |
| 第9計算期間 | 2020年 2月18日～2021年 2月17日 | 0.7% |
| 第10期（中間期） | 2021年 2月18日～2021年 8月17日 | 0.7% |

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

（４）設定及び解約の実績

野村DC運用戦略ファンド

| | 計算期間 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|-----------|-------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 第1計算期間 | 2012年 2月28日～2013年 2月18日 | 47,323,294 | | 47,323,294 |
| 第2計算期間 | 2013年 2月19日～2014年 2月17日 | 2,003,508,647 | 154,192,604 | 1,896,639,337 |
| 第3計算期間 | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 999,136,243 | 427,656,828 | 2,468,118,752 |
| 第4計算期間 | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 1,637,926,200 | 641,423,568 | 3,464,621,384 |
| 第5計算期間 | 2016年 2月18日～2017年 2月17日 | 3,774,359,201 | 881,664,759 | 6,357,315,826 |
| 第6計算期間 | 2017年 2月18日～2018年 2月19日 | 14,660,535,474 | 3,240,163,547 | 17,777,687,753 |
| 第7計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 4,903,455,488 | 2,438,304,551 | 20,242,838,690 |
| 第8計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月17日 | 6,651,955,100 | 2,985,065,217 | 23,909,728,573 |
| 第9計算期間 | 2020年 2月18日～2021年 2月17日 | 6,769,091,284 | 4,092,215,533 | 26,586,604,324 |
| 第10期（中間期） | 2021年 2月18日～2021年 8月17日 | 5,371,741,833 | 2,470,791,621 | 29,487,554,536 |

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

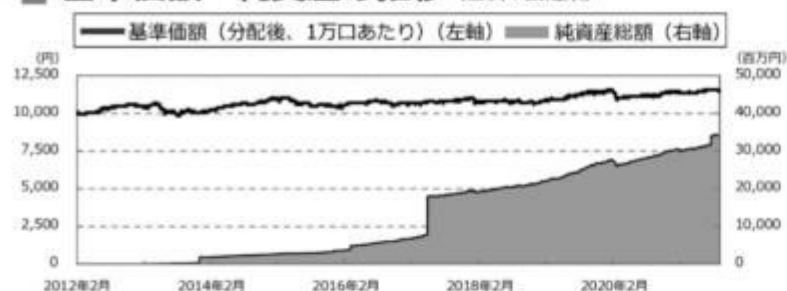
参考情報

< 更新後 >



運用実績（2021年9月30日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次；設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

| | |
|---------|------|
| 2021年2月 | 5 円 |
| 2020年2月 | 5 円 |
| 2019年2月 | 5 円 |
| 2018年2月 | 5 円 |
| 2017年2月 | 5 円 |
| 設定来累計 | 45 円 |

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

| 銘柄 | 投資比率（%） |
|-------------------------|---------|
| 国内株式マザーファンド | 4.9 |
| 国内債券マザーファンド | 28.2 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 6.1 |
| 外国債券マザーファンド | 39.7 |
| 新興国株式マザーファンド | 2.7 |
| 新興国債券マザーファンド | 4.7 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 3.9 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 2.6 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 2.6 |
| 野村マネー マザーファンド | 0.3 |

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率（%） |
|----|---------------|--------|---------|
| 1 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 0.2 |
| 2 | ソニーグループ | 電気機器 | 0.1 |
| 3 | キーエンス | 電気機器 | 0.1 |
| 4 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 0.1 |
| 5 | リクルートホールディングス | サービス業 | 0.1 |

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率（%） |
|----|-------------------|------|---------|
| 1 | 国庫債券 利付（5年）第139回 | 国債証券 | 0.5 |
| 2 | 国庫債券 利付（5年）第134回 | 国債証券 | 0.4 |
| 3 | 国庫債券 利付（10年）第345回 | 国債証券 | 0.4 |
| 4 | 国庫債券 利付（10年）第332回 | 国債証券 | 0.4 |
| 5 | 国庫債券 利付（5年）第140回 | 国債証券 | 0.4 |

・「外国株式MSCI-KOKUSAマザーファンド」を通じた投資銘柄

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

・「外国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|------------------|------|----------|
| 1 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 1.1 |
| 2 | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.6 |
| 3 | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.6 |
| 4 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5 |
| 5 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.5 |

・「新興国株式マザーファンド」を通じた投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|--------------------------------|----------------------|----------|
| 1 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 半導体・半導体製造装置 | 0.2 |
| 2 | ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | — | 0.1 |
| 3 | TENCENT HOLDINGS LTD | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.1 |
| 4 | SAMSUNG ELECTRONICS | コンピュータ・周辺機器 | 0.1 |
| 5 | ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED | インターネット販売・通信販売 | 0.1 |

・「新興国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|-----------------------|------|----------|
| 1 | RUSSIAN FEDERATION | 国債証券 | 0.1 |
| 2 | REPUBLIC OF ARGENTINA | 国債証券 | 0.1 |
| 3 | RUSSIAN FEDERATION | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | REPUBLIC OF ARGENTINA | 国債証券 | 0.1 |
| 5 | TURKEY GLOBAL | 国債証券 | 0.1 |

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じた投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|------------------------|------|----------|
| 1 | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.1 |
| 2 | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.1 |
| 3 | LETRA TESOURO NACIONAL | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.1 |
| 5 | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.1 |

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|-----------------------|------|----------|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.2 |
| 2 | シャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.1 |
| 3 | GLP投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.1 |
| 4 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.1 |
| 5 | 日本都市ファンド投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.1 |

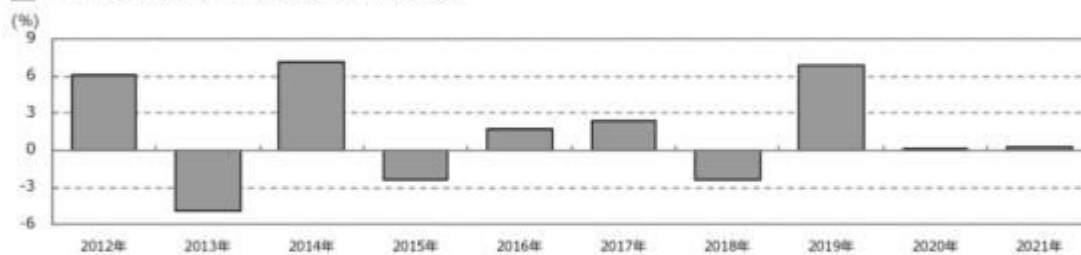
・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|--------------------------|------|----------|
| 1 | PROLOGIS INC | 投資証券 | 0.2 |
| 2 | EQUINIX INC | 投資証券 | 0.1 |
| 3 | PUBLIC STORAGE | 投資証券 | 0.1 |
| 4 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | 0.1 |
| 5 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 投資証券 | 0.1 |

・「野村マネー マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|--------------------------|------|----------|
| 1 | クレディセゾン 第53回社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.0 |
| 2 | 首都高速道路 第19回 | 特殊債券 | 0.0 |
| 3 | NTTファイナンス 第1回社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.0 |
| 4 | 三菱UFJリース 第43回社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.0 |
| 5 | 阪神高速道路 第19回 | 特殊債券 | 0.0 |

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2012年は設定日（2012年2月28日）から年末までの収益率。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)(以下「中間財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2021年2月18日から2021年8月17日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

野村DC運用戦略ファンド

(1) 中間貸借対照表

| | (単位：円) | |
|-----------------|------------------------|--------------------------------|
| | 第9期 (2021年 2月17日現在) | 第10期中間計算期間末 (2021年 8月17日現在) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 886,005,804 | 1,108,933,248 |
| 親投資信託受益証券 | 30,188,243,448 | 33,145,039,113 |
| 派生商品評価勘定 | - | 46,306,083 |
| 流動資産合計 | 31,074,249,252 | 34,300,278,444 |
| 資産合計 | 31,074,249,252 | 34,300,278,444 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 311,261,721 | 16,186,100 |
| 未払収益分配金 | 13,293,302 | - |
| 未払解約金 | 79,232,149 | 44,019,792 |
| 未払受託者報酬 | 8,107,749 | 8,427,528 |
| 未払委託者報酬 | 121,616,281 | 126,412,906 |
| 未払利息 | 751 | 940 |
| その他未払費用 | 486,406 | 505,593 |
| 流動負債合計 | 533,998,359 | 195,552,859 |
| 負債合計 | 533,998,359 | 195,552,859 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 26,586,604,324 | 29,487,554,536 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 3,953,646,569 | 4,617,171,049 |
| (分配準備積立金) | 1,623,744,664 | 1,481,263,181 |
| 元本等合計 | 30,540,250,893 | 34,104,725,585 |
| 純資産合計 | 30,540,250,893 | 34,104,725,585 |
| 負債純資産合計 | 31,074,249,252 | 34,300,278,444 |

(2) 中間損益及び剰余金計算書

| | (単位：円) | |
|-------------|---|--|
| | 第9期中間計算期間 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日 | 第10期中間計算期間 自 2021年 2月18日 至 2021年 8月17日 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 778,759,505 | 536,795,665 |
| 為替差損益 | 36,725,719 | 183,809,092 |
| 営業収益合計 | 815,485,224 | 352,986,573 |

| | 第9期中間計算期間 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日 | 第10期中間計算期間 自 2021年 2月18日 至 2021年 8月17日 |
|---|---|--|
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 1,874,585 | 465,429 |
| 受託者報酬 | 7,425,778 | 8,427,528 |
| 委託者報酬 | 111,386,601 | 126,412,906 |
| その他費用 | 445,487 | 505,593 |
| 営業費用合計 | 121,132,451 | 135,811,456 |
| 営業利益又は営業損失() | 936,617,675 | 217,175,117 |
| 経常利益又は経常損失() | 936,617,675 | 217,175,117 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 936,617,675 | 217,175,117 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額() | 80,236,758 | 13,008,508 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 3,749,411,768 | 3,953,646,569 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 397,467,175 | 799,498,150 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 397,467,175 | 799,498,150 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 342,536,007 | 366,157,295 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 342,536,007 | 366,157,295 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 2,947,962,019 | 4,617,171,049 |

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |
| 4. その他 | 当ファンドの中間計算期間は、2021年 2月18日から2021年 8月17日までとなっております。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 第9期 2021年 2月17日現在 | 第10期中間計算期間末 2021年 8月17日現在 |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 26,586,604,324口 | 1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 29,487,554,536口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |

| | | | |
|------------------|-----------|------------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 1,148円 | 1口当たり純資産額 | 1,156円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (11,487円) | (10,000口当たり純資産額) | (11,566円) |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 第9期 2021年 2月17日現在 | 第10期中間計算期間末 2021年 8月17日現在 |
|---|--|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 2 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p> | <p>1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 2 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p> |

（その他の注記）

1 元本の移動

| 第9期 自 2020年 2月18日 至 2021年 2月17日 | 第10期中間計算期間 自 2021年 2月18日 至 2021年 8月17日 |
|---------------------------------------|--|
| 期首元本額 23,909,728,573円 | 期首元本額 26,586,604,324円 |
| 期中追加設定元本額 6,769,091,284円 | 期中追加設定元本額 5,371,741,833円 |
| 期中一部解約元本額 4,092,215,533円 | 期中一部解約元本額 2,470,791,621円 |

2 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

| | 第9期(2021年 2月17日現在) | 第10期中間計算期間末(2021年 8月17日現在) |
|---------|--------------------|----------------------------|
| 契約額等(円) | | |

| 種類 | | うち1年 | | | うち1年 | | | |
|-----------|----------------|------|----------------|-------------|----------------|-------|----------------|------------|
| | | 超 | 時価(円) | 評価損益(円) | 超 | 時価(円) | 評価損益(円) | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売建 | 14,101,256,279 | - | 14,412,518,000 | 311,261,721 | 15,552,751,793 | - | 15,522,631,810 | 30,119,983 |
| 米ドル | 6,764,428,280 | - | 6,921,632,000 | 157,203,720 | 8,331,158,582 | - | 8,311,150,850 | 20,007,732 |
| カナダドル | 742,719,250 | - | 760,032,000 | 17,312,750 | 644,328,000 | - | 651,164,250 | 6,836,250 |
| ユーロ | 4,573,300,574 | - | 4,646,270,000 | 72,969,426 | 4,859,003,224 | - | 4,835,747,160 | 23,256,064 |
| 英ポンド | 1,179,077,250 | - | 1,222,009,000 | 42,931,750 | 1,003,130,700 | - | 1,012,480,550 | 9,349,850 |
| 豪ドル | 841,730,925 | - | 862,575,000 | 20,844,075 | 715,131,287 | - | 712,089,000 | 3,042,287 |
| 合計 | 14,101,256,279 | - | 14,412,518,000 | 311,261,721 | 15,552,751,793 | - | 15,522,631,810 | 30,119,983 |

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(参考)

当ファンドは、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」および「野村マネーマザーファンド」受益証券に投資しており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年 8月17日現在)

資産の部

流動資産

| | |
|-----------------|-----------------|
| コール・ローン | 15,177,008,951 |
| 株式 | 386,459,728,270 |
| 派生商品評価勘定 | 17,058,385 |
| 未収配当金 | 436,023,932 |
| 未収利息 | 367,986 |
| その他未収収益 | 16,276,444 |
| 差入委託証拠金 | 281,139,400 |
| 流動資産合計 | 402,387,603,368 |
| 資産合計 | 402,387,603,368 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 36,128,715 |
| 未払金 | 15,246,000 |
| 未払解約金 | 99,643,702 |
| 未払利息 | 12,865 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 7,847,037,379 |
| 流動負債合計 | 7,998,068,661 |
| 負債合計 | 7,998,068,661 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 196,670,516,776 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 197,719,017,931 |
| 元本等合計 | 394,389,534,707 |
| 純資産合計 | 394,389,534,707 |
| 負債純資産合計 | 402,387,603,368 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 株式、新株予約権証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|----------------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 2.0053円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (20,053円) |
| 2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | |
| | 7,304,381,520円 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 株式、新株予約権証券 | |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| 先物取引 | |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。 | |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------------|------------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 205,869,301,151円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 18,175,034,717円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 27,373,819,092円 |
| 期末元本額 | 196,670,516,776円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 140,250,481円 |
| バランスセレクト50 | 319,411,191円 |
| バランスセレクト70 | 457,023,319円 |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース） | 2,351,748,582円 |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース） | 3,037,661,338円 |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース） | 7,802,259,719円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 39,507,596円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 39,613,375円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 69,870,335円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 97,941,755円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 84,311,903円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 161,378,779円 |

| | |
|-------------------------------------|-----------------|
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け） | 14,650,714,023円 |
| のむらップ・ファンド（保守型） | 2,376,514,892円 |
| のむらップ・ファンド（普通型） | 10,175,034,851円 |
| のむらップ・ファンド（積極型） | 3,208,418,159円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 26,883,649円 |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | 1,842,972,849円 |
| マイ・ロード | 3,329,532,344円 |
| ネクストコア | 35,212,100円 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型 | 1,422,258,808円 |
| 野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け） | 2,320,317,359円 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース） | 1,384,065,803円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 39,453,852円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 | 13,128,997円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 | 6,641,735円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 | 5,225,234円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型 | 4,350,216円 |
| のむらップ・ファンド（やや保守型） | 345,843,393円 |
| のむらップ・ファンド（やや積極型） | 426,879,763円 |
| インデックス・ブレンド（タイプ ） | 2,979,886円 |
| インデックス・ブレンド（タイプ ） | 3,623,159円 |
| インデックス・ブレンド（タイプ ） | 22,887,093円 |
| インデックス・ブレンド（タイプ ） | 5,958,973円 |
| インデックス・ブレンド（タイプ ） | 24,937,829円 |
| 野村6資産均等バランス | 2,230,077,501円 |
| 世界6資産分散ファンド | 79,544,272円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 19,961,969円 |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式 | 1,125,289,588円 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 316,735,949円 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 152,261,475円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 498,473,762円 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 488,860,672円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用） | 3,390,891円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用） | 7,587,915円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用） | 1,031,060円 |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 2,452,723,303円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用） | 6,992,740円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 67,011,550円 |
| 野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 65,786,720円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 23,402,410円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 96,414,835円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 208,900,745円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用） | 4,324,051,161円 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 57,941,674円 |
| ノムラ日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 375,975,916円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用） | 1,619,891,659円 |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用） | 176,424,985円 |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用） | 89,716,407円 |

| | |
|---|-----------------|
| 野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 2,491,759円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 5,946,142円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 27,777,285円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 32,602,951円 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 120,368,978円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 9,074,843,113円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 24,829,499,053円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 28,235,295,412円 |
| 野村国内株式インデックスファンド・T O P I X(確定拠出年金向け) | 33,456,648,631円 |
| マイバランスD C 3 0 | 3,252,864,174円 |
| マイバランスD C 5 0 | 5,501,559,505円 |
| マイバランスD C 7 0 | 5,541,697,130円 |
| 野村D C国内株式インデックスファンド・T O P I X | 10,190,591,054円 |
| 野村D C運用戦略ファンド | 832,334,712円 |
| 野村D C運用戦略ファンド(マイルド) | 70,855,905円 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 1,243,220,340円 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 967,434,071円 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 862,933,254円 |
| 野村世界6資産分散投信(D C)安定コース | 10,339,973円 |
| 野村世界6資産分散投信(D C)インカムコース | 4,722,524円 |
| 野村世界6資産分散投信(D C)成長コース | 75,115,296円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2030 | 20,610,904円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040 | 18,952,768円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050 | 15,128,136円 |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 437,697,635円 |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 367,292,282円 |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け) | 227,072,986円 |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け) | 300,064,634円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2060 | 10,122,048円 |
| マイターゲット2065(確定拠出年金向け) | 51,140,275円 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 120,031,347円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 8月17日現在)

| | |
|---------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 449,923,202 |
| 国債証券 | 23,908,124,930 |
| 未収利息 | 53,881,925 |
| 前払費用 | 647,197 |
| 流動資産合計 | 24,412,577,254 |
| 資産合計 | 24,412,577,254 |
| 負債の部 | |

(2021年 8月17日現在)

| | |
|-----------------|----------------|
| 流動負債 | |
| 未払金 | 184,485,800 |
| 未払解約金 | 4,977,299 |
| 未払利息 | 381 |
| 流動負債合計 | 189,463,480 |
| 負債合計 | 189,463,480 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 17,654,145,038 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 6,568,968,736 |
| 元本等合計 | 24,223,113,774 |
| 純資産合計 | 24,223,113,774 |
| 負債純資産合計 | 24,412,577,254 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 1.3721円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (13,721円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |

2021年 8月17日現在

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月17日現在

| 期首 | 2021年 2月18日 |
|------------------------------------|-----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 22,378,002,418円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 3,430,207,491円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 8,154,064,871円 |
| 期末元本額 | 17,654,145,038円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 568,743,416円 |
| バランスセレクト50 | 623,043,289円 |
| バランスセレクト70 | 295,252,456円 |
| ネクストコア | 298,284,579円 |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用） | 1,560,266,227円 |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用） | 810,658,203円 |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け） | 23,757,951円 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 53,801,019円 |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け） | 21,318,216円 |
| 野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け） | 5,195,122,166円 |
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け） | 176,012,852円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 7,075,489,497円 |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド） | 952,395,167円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 8月17日現在)

| 資産の部 | |
|----------|-------------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 10,596,308,739 |
| コール・ローン | 1,119,327,695 |
| 株式 | 1,035,783,679,733 |
| 投資証券 | 24,272,256,775 |
| 派生商品評価勘定 | 556,225,372 |
| 未収入金 | 1,521,320 |
| 未収配当金 | 1,038,718,999 |
| 差入委託証拠金 | 7,129,617,872 |

(2021年 8月17日現在)

| | |
|-----------------|-------------------|
| 流動資産合計 | 1,080,497,656,505 |
| 資産合計 | 1,080,497,656,505 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 2,069,008 |
| 未払解約金 | 364,937,071 |
| 未払利息 | 948 |
| その他未払費用 | 2,423,100 |
| 流動負債合計 | 369,430,127 |
| 負債合計 | 369,430,127 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 256,427,500,359 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 823,700,726,019 |
| 元本等合計 | 1,080,128,226,378 |
| 純資産合計 | 1,080,128,226,378 |
| 負債純資産合計 | 1,080,497,656,505 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-----------------------|---|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法 | <p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3.費用・収益の計上基準 | <p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |

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

（貸借対照表に関する注記）

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 4.2122円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (42,122円) |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 株式 | |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | |
| 投資証券 | |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| 先物取引 | |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| 為替予約取引 | |
| 1）計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。 | |
| 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。 | |
| 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 | |
| ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。 | |
| ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。 | |
| 2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|---------------|--|
|---------------|--|

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 245,346,396,148円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 26,501,241,473円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 15,420,137,262円 |
| 期末元本額 | 256,427,500,359円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 34,058,388円 |
| バランスセレクト50 | 102,568,693円 |
| バランスセレクト70 | 122,307,917円 |
| 野村外国株式インデックスファンド | 490,097,697円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,364,457,103円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 4,345,737,279円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 3,720,687,962円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 10,739,606円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 10,767,436円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 19,038,916円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 26,794,364円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 23,026,393円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 44,288,951円 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 48,114,699,366円 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 794,612,530円 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 7,918,638,178円 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 6,938,245,991円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 7,382,602円 |
| 野村インデックスファンド・外国株式 | 5,880,675,814円 |
| マイ・ロード | 991,808,564円 |
| ネクストコア | 21,122,173円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 130,347,566円 |
| 野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け) | 1,849,496,531円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 549,515,484円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 10,817,678円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 3,582,303円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 1,824,769円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,432,775円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,194,203円 |
| のむらップ・ファンド(やや保守型) | 186,902,751円 |
| のむらップ・ファンド(やや積極型) | 557,935,639円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 2,707,371円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 3,149,433円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 30,709,382円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 7,863,163円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 34,116,447円 |
| 野村6資産均等バランス | 1,063,464,028円 |
| 野村つみたて外国株投信 | 8,299,329,362円 |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 4,738,773,948円 |
| 世界6資産分散ファンド | 37,931,330円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 5,466,813円 |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信 | 323,647,615円 |

| | |
|---|-----------------|
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI - KOKUSAI 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 3,248,619,817円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式 | 3,036,981,945円 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 151,038,097円 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 72,617,573円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 712,592,760円 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 1,164,750,626円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 1,617,025円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 4,422,217円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 1,081,706円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | 1,333,715円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 21,301,400円 |
| 野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用) | 8,390,775円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 8,369,985円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 30,648,449円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 99,619,153円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 2,356,524,278円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 27,730,006円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用) | 177,152,962円 |
| 野村FOFs用・外国株式MSCI - KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 11,981,275,594円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 1,188,168円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 1,417,956円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 8,829,874円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 8,812,190円 |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSAI(確定拠出年金向け) | 79,586,989,787円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 2,200,463,287円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 8,032,150,090円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 7,651,769,025円 |
| マイバランスDC30 | 782,630,613円 |
| マイバランスDC50 | 1,769,835,121円 |
| マイバランスDC70 | 1,488,064,167円 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSAI | 29,007,472,703円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 500,467,931円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 39,682,018円 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 344,147,014円 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 270,054,582円 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 262,307,311円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース | 14,792,555円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース | 6,756,129円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース | 35,820,437円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 5,638,615円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 5,201,497円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 4,148,164円 |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 136,633,257円 |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 106,209,066円 |

| | |
|-------------------------------|-------------|
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け) | 60,620,037円 |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け) | 79,495,972円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 2,772,038円 |
| マイターゲット2065(確定拠出年金向け) | 13,548,568円 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 71,549,590円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年8月17日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 761,239,491 |
| コール・ローン | 1,750,520,796 |
| 国債証券 | 597,122,245,802 |
| 派生商品評価勘定 | 6,591,793 |
| 未収入金 | 1,001,708,422 |
| 未収利息 | 4,604,195,220 |
| 前払費用 | 329,370,699 |
| その他未収収益 | 6,875,329 |
| 流動資産合計 | 605,582,747,552 |
| 資産合計 | 605,582,747,552 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 991,465 |
| 未払金 | 741,450,160 |
| 未払解約金 | 1,704,747,552 |
| 未払利息 | 1,483 |
| その他未払費用 | 3,367,256 |
| 流動負債合計 | 2,450,557,916 |
| 負債合計 | 2,450,557,916 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 237,003,048,080 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 366,129,141,556 |
| 元本等合計 | 603,132,189,636 |
| 純資産合計 | 603,132,189,636 |
| 負債純資産合計 | 605,582,747,552 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------|--|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法 | 国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 |
|-------------------|--|

| | |
|------------------------|---|
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| | 有価証券売買等損益 |
| | 約定日基準で計上しております。 |
| | 為替差損益 |
| | 約定日基準で計上しております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 2,5448円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (25,448円) |
| 2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 204,582,757,575円 |
| なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。 | |
| 3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価 | |
| 貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。 | |
| 有価証券 | 214,559,719,899円 |
| なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。 | |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

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

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

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------------|------------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 230,930,264,606円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 20,997,789,626円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 14,925,006,152円 |
| 期末元本額 | 237,003,048,080円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 82,923,810円 |
| バランスセレクト50 | 83,246,928円 |
| バランスセレクト70 | 79,020,344円 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 276,307,856円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,658,435,111円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 23,627,285,955円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 1,733,911,086円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 19,671,859円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 19,719,111円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 34,938,780円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 38,891,994円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 28,917,356円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 49,695,174円 |
| 野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 74,156,776,046円 |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 5,884,413,529円 |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 16,163,585,146円 |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 3,910,982,149円 |
| 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | 519,672,400円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 6,994,173円 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 894,532,492円 |

| | |
|---|----------------|
| マイ・ロード | 9,024,616,890円 |
| ネクストコア | 225,052,712円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 212,605,527円 |
| 野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け) | 8,448,176,330円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 1,314,722,841円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 8,054,684円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 4,764,750円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 2,062,354円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,408,107円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,079,651円 |
| のむらップ・ファンド(やや保守型) | 655,439,476円 |
| のむらップ・ファンド(やや積極型) | 587,163,570円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 2,099,639円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,539,705円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 9,000,039円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,430,634円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 3,972,934円 |
| 野村6資産均等バランス | 1,734,580,354円 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 6,313,002,789円 |
| 世界6資産分散ファンド | 61,876,423円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 2,839,160円 |
| NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 6,748,495,916円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券 | 3,658,277,629円 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 6,365,720円 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 1,182,658,218円 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 189,532,062円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 1,357,015,549円 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 950,603,887円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 2,637,475円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 7,869,291円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 320,788円 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 3,179,527,304円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | 9,790,184円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 52,114,412円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 13,652,001円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 174,997,984円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 162,485,446円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 1,922,088,733円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 90,485,800円 |
| ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 1,337,605,298円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用) | 693,867,011円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 5,814,745円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 3,469,998円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 7,202,769円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 5,714,021円 |
| 野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け) | 566,963,281円 |

| | |
|-------------------------------|-----------------|
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 5,393,885,069円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 6,501,215,131円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 4,945,180,098円 |
| 野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 18,922,662,527円 |
| マイバランスDC30 | 1,925,716,852円 |
| マイバランスDC50 | 1,442,042,836円 |
| マイバランスDC70 | 965,788,271円 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 7,507,838,831円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 5,338,239,200円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 621,213,943円 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 231,134,472円 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 391,535,024円 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 188,406,869円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース | 16,085,087円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース | 36,732,298円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース | 16,692,997円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 8,184,444円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 5,836,500円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 3,088,794円 |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 111,988,881円 |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 73,700,437円 |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け) | 39,869,069円 |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け) | 51,865,280円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 1,439,643円 |
| マイターゲット2065(確定拠出年金向け) | 8,839,445円 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 38,900,692円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 8月17日現在)

| | |
|----------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,649,826,358 |
| コール・ローン | 341,318,400 |
| 株式 | 61,315,582,529 |
| 投資信託受益証券 | 2,905,837,606 |
| 投資証券 | 61,213,266 |
| 派生商品評価勘定 | 6,428,186 |
| 未収入金 | 901,253 |
| 未収配当金 | 158,010,993 |
| 差入委託証拠金 | 765,607,978 |
| 流動資産合計 | 67,204,726,569 |
| 資産合計 | |
| 67,204,726,569 | |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 82,180,328 |
| 未払解約金 | 20,249,068 |

(2021年 8月17日現在)

| | |
|-----------------|----------------|
| 未払利息 | 289 |
| その他未払費用 | 1,643,400 |
| 流動負債合計 | 104,073,085 |
| 負債合計 | 104,073,085 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 42,506,575,683 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 24,594,077,801 |
| 元本等合計 | 67,100,653,484 |
| 純資産合計 | 67,100,653,484 |
| 負債純資産合計 | 67,204,726,569 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | <p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3. 費用・収益の計上基準 | <p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 1.5786円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (15,786円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 株式 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 新株予約権証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 投資信託受益証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 投資証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| 先物取引 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| 為替予約取引 | |
| 1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。 | |
| 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。 | |
| 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 | |
| ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。 | |
| ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。 | |
| 2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|-----------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 38,433,241,479円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 5,890,478,522円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,817,144,318円 |
| 期末元本額 | 42,506,575,683円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村資産設計ファンド2015 | 20,991,754円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 21,067,307円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 37,031,545円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 51,644,441円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 44,547,182円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 84,703,848円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 14,103,299円 |
| 野村インデックスファンド・新興国株式 | 3,470,153,782円 |
| ネクストコア | 24,145,377円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 338,085,593円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 20,730,439円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 | 6,943,510円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 | 3,482,574円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 | 2,747,147円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型 | 2,282,892円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,245,065円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,511,222円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 9,485,070円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 2,581,243円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 10,444,479円 |
| 野村つみたて外国株投信 | 3,160,339,002円 |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け) | 1,035,380,022円 |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 1,804,498,479円 |
| 世界6資産分散ファンド | 98,371,357円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 10,511,103円 |
| NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 786,902,852円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式 | 1,000,331,390円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 7,233,092円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用) | 363,863,959円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 770,395円 |
| 野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 29,382,421,821円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 572,303,330円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 44,504,333円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 10,868,036円 |

| | |
|-------------------------------|-------------|
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040 | 9,950,924円 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050 | 7,952,406円 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060 | 5,329,811円 |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け） | 37,115,602円 |

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

| （単位：円） | |
|-----------------|----------------|
| (2021年 8月17日現在) | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 204,482,634 |
| コール・ローン | 110,691,730 |
| 国債証券 | 25,612,833,025 |
| 派生商品評価勘定 | 361,299 |
| 未収利息 | 246,668,261 |
| 前払費用 | 23,007,231 |
| 流動資産合計 | 26,198,044,180 |
| 資産合計 | 26,198,044,180 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 142,536 |
| 未払金 | 126,197,788 |
| 未払解約金 | 44,213,708 |
| 未払利息 | 93 |
| その他未払費用 | 65,000 |
| 流動負債合計 | 170,619,125 |
| 負債合計 | 170,619,125 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 12,478,610,507 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 13,548,814,548 |
| 元本等合計 | 26,027,425,055 |
| 純資産合計 | 26,027,425,055 |
| 負債純資産合計 | 26,198,044,180 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|-----------------------|---|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3.費用・収益の計上基準 | <p>有価証券売買等損益</p> |

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

（貸借対照表に関する注記）

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 2.0858円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (20,858円) |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 国債証券 | |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| 為替予約取引 | |
| 1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。 | |
| 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当 | |
| 該為替予約は当該仲値で評価しております。 | |
| 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 | |
| ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の | |
| 仲値をもとに計算したレートを用いております。 | |
| ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物 | |
| 相場の仲値を用いております。 | |
| 2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており | |
| ます。 | |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 10,970,246,851円 |

| | |
|---|------------------------------|
| 同期中における追加設定元本額 | 3,049,529,523円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,541,165,867円 |
| 期末元本額 | 12,478,610,507円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型 ネクストコア | 629,267,216円 33,544,890円 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型 | 906,526,278円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 4,170,933円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 4,001,251円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 20,781,503円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 5,027,975円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 12,970,697円 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け) | 873,358,510円 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 1,369,651,980円 |
| NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信 ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券 | 634,658,325円 748,112,234円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 5,589,492円 |
| ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 2,141,658円 |
| 新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用) | 1,331,326,134円 |
| 野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 4,956,075,016円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 764,344,393円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 81,422,432円 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 95,639,590円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年 8月17日現在)

| | |
|----------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 208,109,038 |
| コール・ローン | 7,335,632 |
| 国債証券 | 9,444,224,463 |
| 派生商品評価勘定 | 322,697 |
| 未収利息 | 105,511,544 |
| 前払費用 | 12,032,641 |
| 流動資産合計 | 9,777,536,015 |
| 資産合計 | 9,777,536,015 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 251,857 |
| 未払金 | 134,116,656 |
| 未払解約金 | 11,934,092 |
| 未払利息 | 6 |
| その他未払費用 | 403,500 |
| 流動負債合計 | 146,706,111 |
| 負債合計 | 146,706,111 |

(2021年 8月17日現在)

| | |
|-----------------|---------------|
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 6,909,080,303 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2,721,749,601 |
| 元本等合計 | 9,630,829,904 |
| 純資産合計 | 9,630,829,904 |
| 負債純資産合計 | 9,777,536,015 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3. 費用・収益の計上基準 | <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 2021年 8月17日現在 | |
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 1.3939円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (13,939円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| | |
|--|--|
| 2021年 8月17日現在 | |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

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

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

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|----------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 6,503,881,954円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,250,359,873円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 845,161,524円 |
| 期末元本額 | 6,909,080,303円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村資産設計ファンド2015 | 20,041,891円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 20,114,988円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 35,188,519円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 38,517,823円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 28,626,498円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 49,219,335円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 6,926,886円 |
| 野村インデックスファンド・新興国債券 | 764,646,915円 |
| ネクストコア | 42,131,335円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 385,365,148円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 7,995,497円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 | 4,730,320円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 | 2,042,004円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 | 1,394,211円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型 | 1,069,265円 |
| 世界6資産分散ファンド | 112,121,516円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 2,894,744円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用） | 3,854,731,211円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用） | 878,745円 |

| | |
|--|--------------|
| オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用) | 86,603,437円 |
| 野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド | 384,538,714円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 955,678,207円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 85,203,276円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 8,105,696円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 5,780,346円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 3,065,949円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 1,467,827円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年8月17日現在)

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,192,758,034 |
| 投資証券 | 44,487,378,450 |
| 派生商品評価勘定 | 2,010,240 |
| 未収配当金 | 268,295,813 |
| 差入委託証拠金 | 66,669,580 |
| 流動資産合計 | 46,017,112,117 |
| 資産合計 | 46,017,112,117 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,757,170 |
| 未払金 | 161,628,630 |
| 未払解約金 | 13,998,853 |
| 未払利息 | 1,011 |
| 流動負債合計 | 177,385,664 |
| 負債合計 | 177,385,664 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 16,314,994,533 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 29,524,731,920 |
| 元本等合計 | 45,839,726,453 |
| 純資産合計 | 45,839,726,453 |
| 負債純資産合計 | 46,017,112,117 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------|---|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法 | 投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 |
|-------------------|---|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 2.8097円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (28,097円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 先物取引 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。 | |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 17,302,956,232円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,566,003,362円 |

| | |
|--|-----------------|
| 同期中における一部解約元本額 | 2,553,965,061円 |
| 期末元本額 | 16,314,994,533円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 1,644,089,099円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 2,123,604,918円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 779,214,200円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 13,809,600円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 13,846,467円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 17,444,462円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 18,018,581円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 18,753,655円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 34,535,736円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 3,564,414円 |
| 野村インデックスファンド・J-REIT | 3,235,497,322円 |
| ネクストコア | 19,002,938円 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型 | 994,289,832円 |
| 野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け) | 2,173,983,733円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 823,609,079円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 4,309,422円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 936,317円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,046,403円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 5,400,819円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,109,186円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 3,611,016円 |
| 野村6資産均等バランス | 1,559,029,868円 |
| 野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け) | 91,366,658円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 1,993,607円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT | 200,557,869円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用) | 71,861,935円 |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用) | 143,447,316円 |
| J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,704,270,780円 |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用) | 72,585,877円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 435,469円 |
| オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用) | 2,107,611円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 450,792,633円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 37,345,971円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース | 7,228,642円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース | 3,301,503円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース | 7,501,851円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 3,791,850円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 4,056,064円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 1,652,502円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 1,010,895円 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 20,978,433円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 8月17日現在)

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 123,821,174 |
| コール・ローン | 137,972,782 |
| 投資証券 | 42,802,571,687 |
| 派生商品評価勘定 | 6,014,204 |
| 未収入金 | 1,952,557 |
| 未収配当金 | 74,724,277 |
| 差入委託証拠金 | 167,582,652 |
| 流動資産合計 | 43,314,639,333 |
| 資産合計 | |
| 43,314,639,333 | |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 212,133 |
| 未払金 | 91,773,543 |
| 未払解約金 | 29,903,474 |
| 未払利息 | 116 |
| その他未払費用 | 146,000 |
| 流動負債合計 | 122,035,266 |
| 負債合計 | |
| 122,035,266 | |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 14,666,287,419 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 28,526,316,648 |
| 元本等合計 | 43,192,604,067 |
| 純資産合計 | |
| 43,192,604,067 | |
| 負債純資産合計 | |
| 43,314,639,333 | |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 受取配当金 |

| | |
|------------------------|--|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> |
|------------------------|--|

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 2,9450円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (29,450円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

先物取引

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

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

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

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 14,372,600,337円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,164,761,693円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,871,074,611円 |
| 期末元本額 | 14,666,287,419円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 1,596,632,476円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 2,062,307,462円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 756,722,129円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 13,411,105円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 13,446,791円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 16,940,466円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 17,498,408円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 18,213,009円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 33,538,929円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 3,461,522円 |
| 野村インデックスファンド・外国REIT | 1,651,334,796円 |
| ネクストコア | 12,831,904円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 371,145,438円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 802,006,923円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 4,185,059円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,150,215円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 1,339,638円 |

| | |
|---|----------------|
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 7,887,358円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 2,137,418円 |
| インデックス・ブレンド(タイプ) | 8,064,648円 |
| 野村6資産均等バランス | 1,514,028,415円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 1,936,062円 |
| NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 2,952,453,215円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT | 1,699,371,668円 |
| ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用) | 678,283,995円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用) | 57,860,353円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 422,844円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 302,734,746円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 23,639,377円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース | 7,019,945円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース | 3,206,184円 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース | 7,285,256円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 3,682,373円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 3,938,966円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 1,604,796円 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 981,713円 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 13,581,817円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年 8月17日現在)

| | |
|-----------------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,749,434,463 |
| 地方債証券 | 1,302,492,774 |
| 特殊債券 | 2,398,226,750 |
| 社債券 | 1,801,092,530 |
| 未収利息 | 6,178,971 |
| 前払費用 | 2,450,350 |
| 流動資産合計 | 9,259,875,838 |
| 資産合計 | 9,259,875,838 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 100,718,521 |
| 未払利息 | 3,178 |
| 流動負債合計 | 100,721,699 |
| 負債合計 | 100,721,699 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 8,979,256,768 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 179,897,371 |

(2021年 8月17日現在)

| | |
|---------|---------------|
| 元本等合計 | 9,159,154,139 |
| 純資産合計 | 9,159,154,139 |
| 負債純資産合計 | 9,259,875,838 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 8月17日現在 | |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 1.0200円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (10,200円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2021年 8月17日現在 | |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | 地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 8月17日現在 | |
|---------------|-------------|
| 期首 | 2021年 2月18日 |

| 2021年 8月17日現在 | |
|------------------------------------|-----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 10,605,556,358円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,537,147,689円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 3,163,447,279円 |
| 期末元本額 | 8,979,256,768円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド） | 241,214,028円 |
| ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド） | 101,692,450円 |
| ネクストコア | 2,282,012円 |
| 野村世界高金利通貨投信 | 34,318,227円 |
| 野村新世界高金利通貨投信 | 982,608円 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース） | 982,609円 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース） | 982,609円 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース） | 982,609円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型 | 9,826円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型 | 98,261円 |

| 2021年 8月17日現在 | |
|---------------------------------------|----------|
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型 | 9,826円 |
| 野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 984,834円 |
| 野村アジアC B投信(毎月分配型) | 982,608円 |
| 野村グローバルC B投信(円コース)毎月分配型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(円コース)年2回決算型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 984,543円 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け) | 10,000円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型 | 984,252円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 984,252円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型 | 984,252円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 982,609円 |

| 2021年 8月17日現在 | |
|--------------------------------------|----------|
| 野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型 | 982,609円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村米国ブランド株投資（円コース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（円コース）年2回決算型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型 | 983,768円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）毎月分配型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）毎月分配型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（円コース）年2回決算型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）年2回決算型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）年2回決算型 | 983,672円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Aコース | 983,381円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Bコース | 98,261円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Cコース | 983,381円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Dコース | 983,381円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 98,262円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型 | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型 | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 983,091円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型 | 982,801円 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型 | 491,401円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（円コース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,608円 |

| 2021年 8月17日現在 | |
|------------------------------------|----------|
| 野村日本高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型 | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型 | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,415円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）毎月分配型 | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）年2回決算型 | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,029円 |
| 野村カルミニャック・ファンド Aコース | 981,547円 |
| 野村カルミニャック・ファンド Bコース | 981,547円 |
| 野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）毎月分配型 | 966円 |
| 野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 177,539円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 398,357円 |
| 野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型 | 123,377円 |
| 野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）毎月分配型 | 626,503円 |
| 野村通貨選択日本株投信（中国元コース）毎月分配型 | 23,859円 |
| 野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型 | 27,600円 |
| 野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型 | 149,947円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）毎月分配型 | 48,092円 |
| 野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）年2回決算型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）年2回決算型 | 3,114円 |
| 野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）年2回決算型 | 132,547円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 100,946円 |
| 野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）年2回決算型 | 18,851円 |
| 野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）年2回決算型 | 373,897円 |
| 野村通貨選択日本株投信（中国元コース）年2回決算型 | 41,054円 |
| 野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型 | 14,308円 |
| 野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）年2回決算型 | 63,772円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）年2回決算型 | 13,741円 |
| 野村エマージング債券プレミアム毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村エマージング債券プレミアム年2回決算型 | 981,451円 |
| ノムラ THE USA Aコース | 981,258円 |
| ノムラ THE USA Bコース | 981,258円 |
| 野村日本ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型 | 9,809円 |
| 野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）毎月分配型 | 9,809円 |
| 野村日本ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型 | 9,809円 |
| 野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）年2回決算型 | 9,809円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型 | 9,808円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型 | 9,808円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型 | 9,808円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型 | 9,808円 |
| 野村米国ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型 | 9,807円 |

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|----------|
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型 | 9,807円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型 | 9,807円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型 | 9,807円 |
| 野村グローバルボンド投信 Aコース | 98,049円 |
| 野村グローバルボンド投信 Bコース | 980,489円 |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース | 98,049円 |
| 野村グローバルボンド投信 Dコース | 980,489円 |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース | 98,049円 |
| 野村グローバルボンド投信 Fコース | 980,489円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型 | 9,805円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型 | 9,805円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型 | 9,805円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型 | 9,805円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型 | 9,803円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型 | 980,297円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 980,297円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型 | 9,803円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型 | 980,297円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 9,803円 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け) | 9,801円 |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け) | 9,801円 |
| グローバル・ストック Aコース | 97,953円 |
| グローバル・ストック Bコース | 979,528円 |
| グローバル・ストック Cコース | 97,953円 |
| グローバル・ストック Dコース | 979,528円 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794円 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794円 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794円 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794円 |
| 野村ファンドラップ債券プレミア | 9,795円 |
| 野村ファンドラップオルタナティブプレミア | 9,795円 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型 | 9,797円 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型 | 9,797円 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース | 9,797円 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース | 9,797円 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース | 9,797円 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース | 9,797円 |
| (年3%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型) | 98,001円 |
| (年6%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型) | 98,001円 |
| 野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース | 98,011円 |
| 野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース | 98,011円 |

| 2021年 8月17日現在 | |
|--|----------------|
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース | 98,020円 |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース | 98,020円 |
| 第1回 野村短期公社債ファンド | 3,037,421円 |
| 第2回 野村短期公社債ファンド | 3,919,169円 |
| 第3回 野村短期公社債ファンド | 1,371,897円 |
| 第4回 野村短期公社債ファンド | 1,077,981円 |
| 第5回 野村短期公社債ファンド | 1,959,729円 |
| 第6回 野村短期公社債ファンド | 1,077,981円 |
| 第7回 野村短期公社債ファンド | 204,767円 |
| 第8回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第9回 野村短期公社債ファンド | 5,094,831円 |
| 第10回 野村短期公社債ファンド | 391,715円 |
| 第11回 野村短期公社債ファンド | 1,861,757円 |
| 第12回 野村短期公社債ファンド | 1,901,723円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用) | 287,434,434円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付) | 1,413,674,178円 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用) | 1,977,425,742円 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用) | 1,997,050,289円 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Kプライス(適格機関投資家専用) | 2,690,621,577円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 85,180,134円 |
| 野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース | 9,818円 |
| 野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース | 9,818円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 7,492,405円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

2 ファンドの現況

純資産額計算書

野村DC運用戦略ファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 49,816,373,765円 |
| 負債総額 | 15,619,930,691円 |
| 純資産総額(-) | 34,196,443,074円 |
| 発行済口数 | 29,806,520,728口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1473円 |

(参考) 国内株式マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 445,693,630,004円 |
| 負債総額 | 25,858,406,908円 |
| 純資産総額（ - ） | 419,835,223,096円 |
| 発行済口数 | 195,950,247,914口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.1426円 |

（参考）国内債券マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 25,663,281,555円 |
| 負債総額 | 969,747,526円 |
| 純資産総額（ - ） | 24,693,534,029円 |
| 発行済口数 | 18,086,839,083口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3653円 |

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|--------------------|
| 資産総額 | 1,092,778,282,685円 |
| 負債総額 | 4,593,001,582円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,088,185,281,103円 |
| 発行済口数 | 260,474,402,383口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 4.1777円 |

（参考）外国債券マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 612,754,062,717円 |
| 負債総額 | 1,279,298,195円 |
| 純資産総額（ - ） | 611,474,764,522円 |
| 発行済口数 | 240,706,502,425口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5403円 |

（参考）新興国株式マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|------------|-----------------|
| 資産総額 | 68,305,462,416円 |
| 負債総額 | 254,137,546円 |
| 純資産総額（ - ） | 68,051,324,870円 |
| 発行済口数 | 42,631,813,394口 |

| | |
|----------------|---------|
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.5963円 |
|----------------|---------|

（参考）新興国債券マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 26,908,714,694円 |
| 負債総額 | 136,211,364円 |
| 純資産総額（ - ） | 26,772,503,330円 |
| 発行済口数 | 12,759,591,676口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.0982円 |

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 9,903,672,665円 |
| 負債総額 | 14,269,331円 |
| 純資産総額（ - ） | 9,889,403,334円 |
| 発行済口数 | 7,062,423,309口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4003円 |

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 46,808,506,442円 |
| 負債総額 | 1,907,798,327円 |
| 純資産総額（ - ） | 44,900,708,115円 |
| 発行済口数 | 16,324,782,138口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.7505円 |

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 44,117,029,489円 |
| 負債総額 | 65,674,781円 |
| 純資産総額（ - ） | 44,051,354,708円 |
| 発行済口数 | 15,064,253,062口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.9242円 |

（参考）野村マネー マザーファンド

2021年9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 8,159,365,229円 |
| 負債総額 | 3,909円 |
| 純資産総額（ - ） | 8,159,361,320円 |
| 発行済口数 | 7,999,240,881口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0200円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2021年9月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

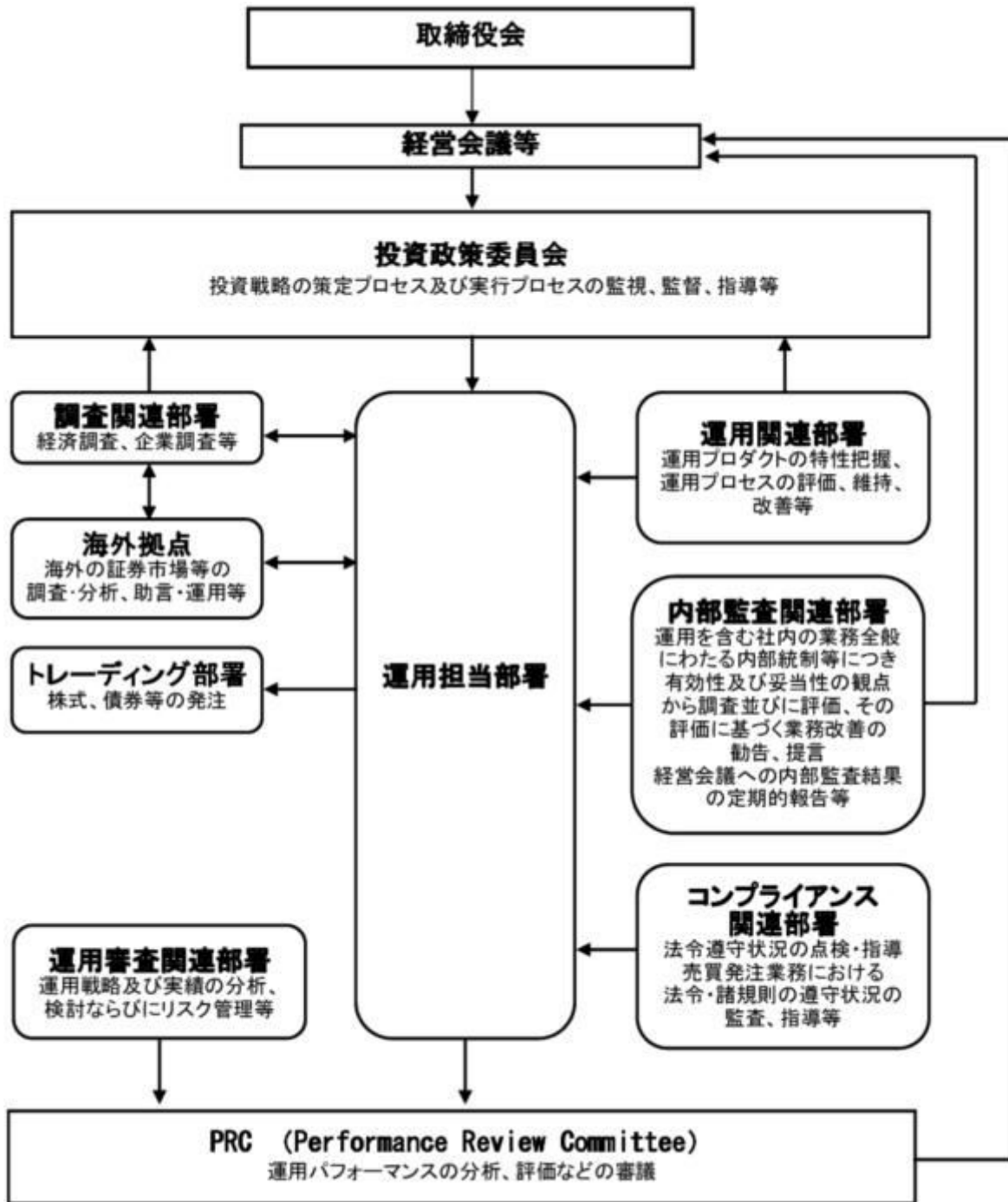
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

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

委託者の運用する証券投資信託は2021年8月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

| 種類 | 本数 | 純資産総額(百万円) |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 991 | 38,257,481 |
| 単位型株式投資信託 | 196 | 822,500 |
| 追加型公社債投資信託 | 14 | 6,278,884 |
| 単位型公社債投資信託 | 503 | 1,622,437 |
| 合計 | 1,704 | 46,981,302 |

3 委託会社等の経理状況

<更新後>

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 貸借対照表

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

| | | | | | |
|----------|---|--------|---------|-------|---------|
| 器具備品 | 2 | 349 | | 731 | |
| 無形固定資産 | | | 5,894 | | 5,429 |
| ソフトウェア | | 5,893 | | 5,428 | |
| その他 | | 0 | | 0 | |
| 投資その他の資産 | | | 16,486 | | 16,487 |
| 投資有価証券 | | 1,437 | | 1,767 | |
| 関係会社株式 | | 10,171 | | 9,942 | |
| 従業員長期貸付金 | | 16 | | - | |
| 長期差入保証金 | | 329 | | 330 | |
| 長期前払費用 | | 19 | | 15 | |
| 前払年金費用 | | 1,545 | | 1,301 | |
| 繰延税金資産 | | 2,738 | | 3,008 | |
| その他 | | 229 | | 122 | |
| 貸倒引当金 | | 0 | | - | |
| 固定資産計 | | | 23,026 | | 24,583 |
| 資産合計 | | | 120,536 | | 125,080 |

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

| | | | | | |
|--------------|--|--------|---------|--------|---------|
| 別途積立金 | | 24,606 | | 24,606 | |
| 繰越利益剰余金 | | 29,069 | | 31,395 | |
| 評価・換算差額等 | | | 10 | | 57 |
| その他有価証券評価差額金 | | | 10 | | 57 |
| 純資産合計 | | | 85,281 | | 87,654 |
| 負債・純資産合計 | | | 120,536 | | 125,080 |

(2) 損益計算書

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

| | 株主資本 | | | | | | | | 株主 資本 合計 |
|-------|--------|-----------|------------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------|-----------------|----------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益 準備金 | 利益剰余金 | | 利益 剰余金 合計 | |
| | | 資本 準備金 | その他 資本 剰余金 | 資本 剰余金 合計 | | その他利益剰余金 | | | |
| | | | | | | 別途 積立金 | 繰越 利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 30,723 | 56,014 | 86,924 |

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

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

| | | | | | | | | | |
|-------|--------|--------|-------|--------|-----|--------|--------|--------|--------|
| 当期末残高 | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 31,395 | 56,686 | 87,596 |
|-------|--------|--------|-------|--------|-----|--------|--------|--------|--------|

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

| | | | | | | | |
|---------------------|--|----|----|------|-------|------|-------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p> | | | | | | |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 | | | | | | |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> | 建物 | 6年 | 附属設備 | 6～15年 | 器具備品 | 4～15年 |
| 建物 | 6年 | | | | | | |
| 附属設備 | 6～15年 | | | | | | |
| 器具備品 | 4～15年 | | | | | | |
| 4. 引当金の計上基準 | <p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> | | | | | | |

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

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

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

| | | | |
|--|----------|--|----------|
| 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 | 4,931百万円 | 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 | 4,334百万円 |
| 2. 固定資産除却損 器具備品 | 7百万円 | 2. 固定資産除却損 器具備品 | 2百万円 |
| ソフトウェア | 59 | ソフトウェア | 102 |
| ア | | ア | |
| 合計 | 67 | 合計 | 105 |

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リ

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．其他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

| 前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|--|
| 1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。 |
| 2．確定給付制度 |

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

| | |
|----------------------|------------|
| 積立型制度の退職給付債務 | 20,462 百万円 |
| 年金資産 | 17,413 |
| | 3,048 |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 3,299 |
| 未積立退職給付債務 | 6,347 |
| 未認識数理計算上の差異 | 4,764 |
| 未認識過去勤務費用 | 185 |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,766 |
| 退職給付引当金 | 3,311 |
| 前払年金費用 | 1,545 |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,766 |

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | |
|-----------------|-----------|
| 勤務費用 | 1,034 百万円 |
| 利息費用 | 154 |
| 期待運用収益 | 436 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 572 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 35 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 1,289 |

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

| | |
|--------|------|
| 債券 | 57% |
| 株式 | 24% |
| 生保一般勘定 | 12% |
| 生保特別勘定 | 7% |
| その他 | 0% |
| 合計 | 100% |

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | |
|--------------|------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 23,761 百万円 |
| 勤務費用 | 1,016 |
| 利息費用 | 139 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 893 |
| 退職給付の支払額 | 781 |
| その他 | 28 |
| 退職給付債務の期末残高 | 23,270 |

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

税効果会計関係

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

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3．当該資産除去債務の総額の増減

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

セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有 (被所有)割合 | 関連当事者との 関係 | 取引の内容 | 取引 金額 (百万円) | 科目 | 期末 残高 (百万円) |
|---------|----------|--------|-----------------|-------|--------------------|---|-----------------------|-------------------|----------|-------------------|
| 親会社の子会社 | 野村證券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000 (百万円) | 証券業 | - | 当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1) | 31,378 | 未払手数料 | 5,536 |
| | | | | | | | コマースナル・ペーパーの購入(*2) | 20,000 | 有価証券 | 19,999 |
| | | | | | | | 有価証券受取利息 | 0 | その他営業外収益 | 0 |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

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

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

<更新後>

(1) 受託者

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

* 2021年8月末現在

(2) 販売会社

| (a)名称 | (b)資本金の額 [*] | (c)事業の内容 |
|--|--|---------------------------------|
| 野村證券株式会社 株式会社SBI証券 損保ジャパンDC証券株式会社 | 10,000百万円 48,323百万円 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。 |
| 株式会社大垣共立銀行 株式会社山陰合同銀行 スルガ銀行株式会社 株式会社南都銀行 株式会社西日本シティ銀行 株式会社八十二銀行 株式会社百五銀行 株式会社広島銀行 株式会社北洋銀行 株式会社北陸銀行 株式会社みずほ銀行 株式会社三井住友銀行 株式会社武蔵野銀行 株式会社山梨中央銀行 | 46,773百万円 20,705百万円 30,043百万円 37,900百万円 85,745百万円 52,243百万円 20,000百万円 54,573百万円 121,101百万円 140,409百万円 1,404,065百万円 1,770,996百万円 45,743百万円 15,400百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 富国生命保険相互会社 | 128,000百万円 ¹ | 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。 |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 139,595百万円 | 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。 |

* 2021年8月末現在

1 富国生命保険相互会社の資本金の額の箇所には「基金」および「基金償却積立金」の合計額を記載しています。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月15日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村DC運用戦略ファンドの2021年2月18日から2021年8月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村DC運用戦略ファンドの2021年8月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年2月18日から2021年8月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

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
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水 永 真太郎

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、継続企業的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。