

## 【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】	2020年5月14日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【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】	世界三資産バランスファンド
【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】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2019年11月12日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

## (3) ファンドの仕組み

## &lt; 更新後 &gt;

委託会社の概況(2020年3月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

## 3 投資リスク

## &lt; 更新後 &gt;

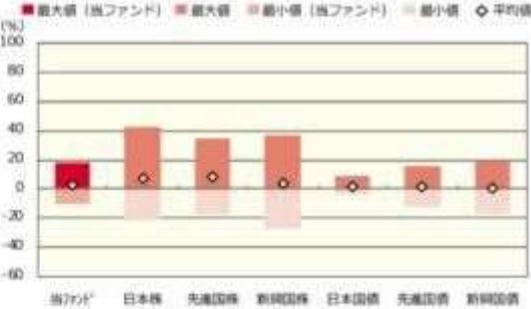
## ■ リスクの定量的比較 (2015年4月末～2020年3月末：月次)

### 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



2015年4月 2016年3月 2017年3月 2018年3月 2019年3月 2020年3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 (%)	18.0	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値 (%)	△ 9.8	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.2	6.8	8.0	4.2	2.0	1.2	0.6

※ 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。2015年4月末を10,000として指数化しております。  
※ 年間騰落率は、2015年4月から2020年3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。  
※ 2015年4月から2020年3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-KOKUSA1 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、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSA1 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-KOKUSA1 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種類や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去の「パフォーマンス」は将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあります。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、または買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) についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする種類の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝言または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPMSI, 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表示する名称です。

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

## 4 手数料等及び税金

### (5) 課税上の取扱い

## &lt; 更新後 &gt;

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

## 個人、法人別の課税について

## 個人の投資家に対する課税

## &lt; 収益分配金に対する課税 &gt;

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

なお、配当控除は適用されません。

## &lt; 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 &gt;

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

## 損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 特定公社債<sup>(注1)</sup>の利子</li> <li>・ 公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul>	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 譲渡益</li> <li>・ 譲渡損</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 上場株式の配当</li> <li>・ 公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul>

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

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

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

## 法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 換金（解約）時および償還時の課税について

## [個人の投資家の場合]

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

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

## [法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

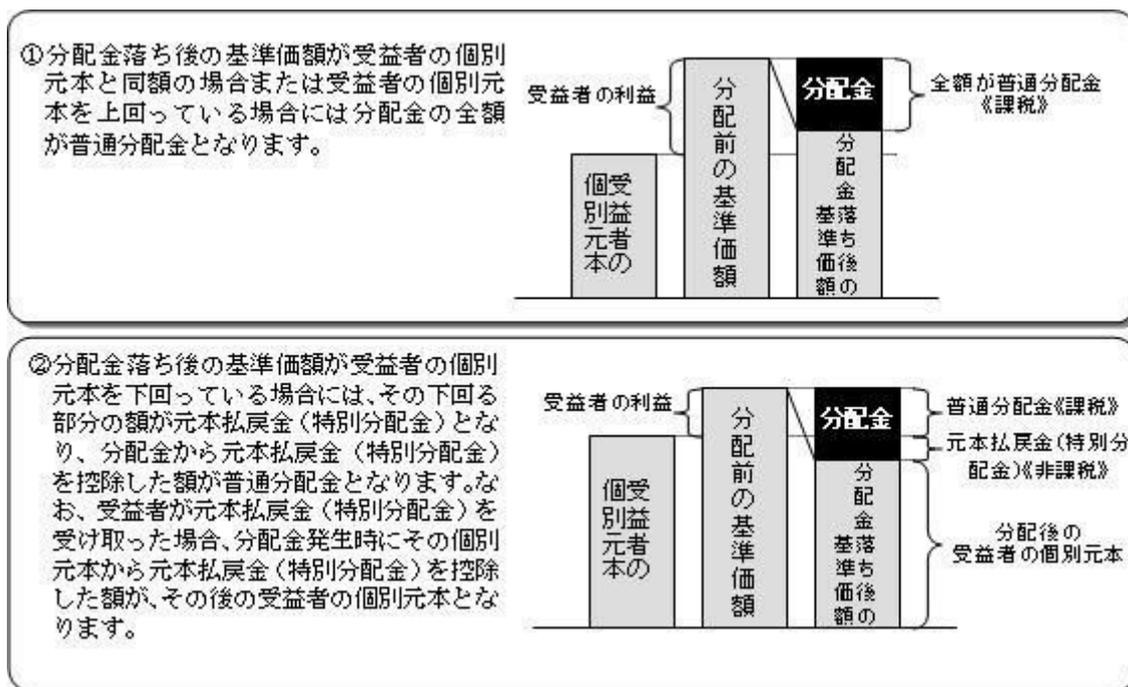
## 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

## 分配金の課税について

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



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

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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2020年3月末現在）が変更になる場合があります。

## 5 運用状況

以下は2020年3月31日現在の運用状況であります。

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

## （１）投資状況

## 世界三資産バランスファンド

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	12,806,849,942	99.54
現金・預金・その他資産（負債控除後）		58,014,172	0.45
合計（純資産総額）		12,864,864,114	100.00

## （参考）世界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	1,246,594,850	13.95
	アメリカ	2,817,954,282	31.53
	メキシコ	444,629,421	4.97
	イタリア	2,141,351,864	23.96
	フランス	179,034,063	2.00
	スペイン	466,202,669	5.21
	ベルギー	90,994,096	1.01
	イギリス	179,672,697	2.01
	スウェーデン	211,881,080	2.37
	ポーランド	127,773,072	1.42
	オーストラリア	368,192,525	4.12
	マレーシア	236,402,868	2.64
	小計	8,510,683,487	95.24
現金・預金・その他資産（負債控除後）		425,188,783	4.75
合計（純資産総額）		8,935,872,270	100.00

## （参考）世界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	153,886,460	5.94
	アメリカ	1,521,041,636	58.79
	カナダ	70,107,077	2.71
	ドイツ	73,559,596	2.84
	イタリア	9,257,965	0.35
	フランス	33,768,494	1.30
	オランダ	52,841,005	2.04
	スペイン	39,091,483	1.51
	ベルギー	10,557,981	0.40

	イギリス	9,646,501	0.37
	イギリス	228,654,085	8.83
	スイス	116,607,003	4.50
	スウェーデン	9,644,953	0.37
	デンマーク	17,299,519	0.66
	オーストラリア	13,017,416	0.50
	香港	34,191,612	1.32
	シンガポール	17,469,637	0.67
	台湾	15,415,367	0.59
	小計	2,426,057,790	93.78
現金・預金・その他資産（負債控除後）		160,904,441	6.21
合計（純資産総額）		2,586,962,231	100.00

（参考）世界REIT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	772,384,700	9.31
	アメリカ	5,797,586,952	69.91
	カナダ	79,182,561	0.95
	ドイツ	80,784,215	0.97
	フランス	97,610,818	1.17
	オランダ	28,591,996	0.34
	スペイン	29,993,621	0.36
	ベルギー	43,923,076	0.52
	アイルランド	28,483,982	0.34
	イギリス	380,782,537	4.59
	オーストラリア	353,996,177	4.26
	香港	181,515,360	2.18
	シンガポール	147,795,955	1.78
	小計	8,022,631,950	96.74
現金・預金・その他資産（負債控除後）		269,883,474	3.25
合計（純資産総額）		8,292,515,424	100.00

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

世界三資産バランスファンド

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	世界債券マザーファンド	5,085,770,082	1.7331	8,814,639,473	1.7570	8,935,698,034	69.45
2	日本	親投資信託 受益証券	世界株式マザーファンド	1,084,446,047	2.3481	2,546,436,056	2.3855	2,586,946,045	20.10
3	日本	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	536,068,569	2.4979	1,339,072,425	2.3956	1,284,205,863	9.98

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.54
合計	99.54

## (参考)世界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	14,200,000	11,361.12	1,613,279,766	11,682.22	1,658,875,285	2.5	2023/8/15	18.56
2	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000	12,009.03	564,424,720	11,959.06	562,076,041	0.35	2020/6/15	6.29
3	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,200,000	12,036.29	505,524,348	11,960.97	502,361,055	0.7	2020/5/1	5.62
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,954.82	416,283,456	11,136.36	423,182,033	2.25	2021/4/30	4.73
5	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000	22,168.12	376,858,062	21,827.91	371,074,592	5.15	2044/10/31	4.15
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,900,000	11,059.87	320,736,459	11,187.80	324,446,458	2.625	2021/5/15	3.63
7	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000	13,999.13	293,981,819	13,616.74	285,951,645	3	2029/8/1	3.20
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	11,128.95	278,223,895	11,289.41	282,235,287	1.125	2025/2/28	3.15
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 57回	280,000,000	100.51	281,448,400	98.68	276,309,600	0.2	2036/6/20	3.09
10	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000	16,711.89	267,390,312	16,487.14	263,794,248	6.5	2027/11/1	2.95
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 50回	220,000,000	118.00	259,603,600	116.22	255,690,600	1.4	2034/9/20	2.86
12	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000	7,517.01	210,476,294	7,815.80	218,842,495	2.75	2029/11/21	2.44
13	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	18,000,000	1,195.87	215,258,016	1,177.11	211,881,080	0.75	2029/11/12	2.37
14	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	42,000,000	524.48	220,282,524	495.16	207,970,829	8.5	2029/5/31	2.32
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 54回	170,000,000	117.03	198,951,000	113.98	193,766,000	1.2	2035/9/20	2.16
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 68回	190,000,000	102.65	195,051,400	101.52	192,889,900	0.4	2039/3/20	2.15
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000	16,894.80	168,948,060	16,595.93	165,959,310	7.25	2026/11/1	1.85

18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	150,000,000	101.34	152,012,600	101.81	152,718,000	0.1	2027/9/20	1.70
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	5,200,000	2,752.25	143,117,244	2,737.09	142,328,920	4.642	2033/11/7	1.59
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	11,555.96	127,115,565	11,746.83	129,215,219	1.5	2030/2/15	1.44
21	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000	2,848.87	128,199,456	2,839.40	127,773,072	2.75	2029/10/25	1.42
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第6 4回	125,000,000	101.01	126,266,250	99.47	124,343,750	0.4	2049/9/20	1.39
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000	15,002.32	120,018,636	15,338.26	122,706,120	4	2037/2/1	1.37
24	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000	468.92	117,231,925	481.15	120,289,255	8	2024/9/5	1.34
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000	11,964.56	119,645,640	11,941.96	119,419,690	0.05	2021/4/15	1.33
26	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000	455.31	113,828,417	465.47	116,369,337	7.5	2027/6/3	1.30
27	イギリス	国債証券	UK TREASURY	500,000	21,324.53	106,622,670	22,979.03	114,895,176	4.75	2038/12/7	1.28
28	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000	7,894.45	102,627,856	8,084.32	105,096,166	4.25	2026/4/21	1.17
29	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	800,000	12,742.83	101,942,676	12,654.52	101,236,183	0.5	2029/5/25	1.13
30	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000	12,330.26	98,642,139	11,891.00	95,128,077	0.5	2030/4/30	1.06

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.24
合計	95.24

## (参考)世界株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	6,190	15,191.57	94,035,837	17,437.83	107,940,173	4.17
2	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	16,200	5,731.07	92,843,435	4,388.02	71,086,015	2.74
3	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	1,833	30,348.34	55,628,513	34,959.24	64,080,301	2.47
4	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	10,300	6,183.50	63,690,124	5,960.61	61,394,377	2.37
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	3,660	14,530.55	53,181,849	14,475.47	52,980,251	2.04
6	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	6,390	8,625.80	55,118,917	7,895.61	50,452,989	1.95
7	アメリカ	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケ ア機器・ 用品	4,910	10,862.68	53,335,762	10,017.80	49,187,405	1.90
8	アメリカ	株式	LOCKHEED MARTIN	航空宇 宙・防衛	1,295	38,736.98	50,164,399	37,965.34	49,165,122	1.90

9	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1,855	30,000.07	55,650,145	26,131.17	48,473,323	1.87
10	イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品	5,073	8,573.75	43,494,647	9,469.71	48,039,887	1.85
11	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	9,450	5,617.63	53,086,652	4,897.35	46,279,958	1.78
12	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	3,380	14,302.70	48,343,138	13,655.98	46,157,241	1.78
13	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品	23,210	2,174.09	50,460,834	1,975.80	45,858,374	1.77
14	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	1,470	30,010.62	44,115,621	27,561.19	40,514,960	1.56
15	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	10,200	4,790.60	48,864,195	3,862.37	39,396,242	1.52
16	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	3,870	12,387.03	47,937,808	10,175.60	39,379,591	1.52
17	オランダ	株式	UNILEVER NV	パーソナル用品	7,314	6,186.81	45,250,334	5,230.31	38,254,506	1.47
18	アメリカ	株式	3M CORP	コングロマリット	2,390	18,500.67	44,216,607	14,990.24	35,826,684	1.38
19	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	4,370	7,684.31	33,580,439	8,188.36	35,783,173	1.38
20	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	3,008	11,598.36	34,887,881	11,298.35	33,985,461	1.31
21	アメリカ	株式	CVS HEALTH CORP	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	5,200	6,412.76	33,346,369	6,494.97	33,773,867	1.30
22	アメリカ	株式	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	航空貨物・物流サービス	2,980	11,492.44	34,247,495	10,647.92	31,730,823	1.22
23	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	1,140	27,400.52	31,236,602	27,346.80	31,175,355	1.20
24	アメリカ	株式	AMGEN INC	バイオテクノロジー	1,355	19,805.03	26,835,825	22,688.87	30,743,430	1.18
25	アメリカ	株式	CORTEVA INC	化学	11,547	2,933.96	33,878,519	2,621.71	30,272,940	1.17
26	アメリカ	株式	DUPONT DE NEMOURS INC	化学	8,247	6,716.45	55,390,641	3,658.86	30,174,656	1.16
27	カナダ	株式	ENBRIDGE INC	石油・ガス・消耗燃料	9,700	3,589.81	34,821,188	3,060.17	29,683,649	1.14
28	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	4,900	5,492.11	26,911,340	6,038.97	29,590,986	1.14
29	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	7,950	5,015.27	39,871,427	3,256.19	25,886,739	1.00
30	アメリカ	株式	TJX COS INC	専門小売り	4,780	5,797.21	27,710,680	5,174.86	24,735,862	0.95

## 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	建設業	0.49
		食料品	0.46
		化学	0.60
		医薬品	0.50
		石油・石炭製品	0.28
		機械	0.32
		電気機器	0.41
		輸送用機器	0.42

	情報・通信業	0.88
	卸売業	0.84
	銀行業	0.41
	保険業	0.27
国外	メディア	1.52
	エネルギー設備・サービス	0.06
	石油・ガス・消耗燃料	3.43
	化学	2.96
	容器・包装	0.42
	金属・鉱業	0.50
	航空宇宙・防衛	1.90
	建設関連製品	0.59
	建設・土木	0.31
	電気設備	0.22
	コングロマリット	1.71
	商業サービス・用品	0.47
	航空貨物・物流サービス	2.05
	旅客航空輸送業	0.45
	陸運・鉄道	0.89
	運送インフラ	0.39
	自動車部品	0.45
	自動車	0.84
	家庭用耐久財	0.66
	繊維・アパレル・贅沢品	0.34
	専門小売り	2.12
	飲料	3.98
	食品	1.31
	タバコ	2.78
	パーソナル用品	1.94
	ヘルスケア機器・用品	2.51
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.64
	バイオテクノロジー	3.37
	医薬品	8.82
	銀行	6.51
	保険	4.29
	情報技術サービス	2.46
	ソフトウェア	5.69
	通信機器	2.74
	コンピュータ・周辺機器	0.82
	電子装置・機器・部品	0.41
	半導体・半導体製造装置	3.91
	各種電気通信サービス	3.78
	無線通信サービス	0.45
	電力	2.09

	総合公益事業	1.45
	資本市場	3.05
	専門サービス	0.37
合 計		93.78

## (参考) 世界REIT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	EQUINIX INC	8,859	61,607.99	545,785,260	70,181.20	621,735,269	7.49
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	60,686	8,870.71	538,328,174	9,019.83	547,377,428	6.60
3	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	45,550	8,321.40	379,040,144	6,810.58	310,221,983	3.74
4	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,304	15,931.51	275,678,967	15,742.25	272,404,058	3.28
5	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	93,626	3,420.44	320,242,748	2,650.01	248,109,883	2.99
6	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	65,013	3,625.31	235,692,307	3,596.83	233,840,806	2.81
7	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTL CORP	14,203	15,360.38	218,163,503	16,113.36	228,858,191	2.75
8	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	87,284	2,860.35	249,663,019	2,306.10	201,286,304	2.42
9	アメリカ	投資証券	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	70,434	3,112.78	219,245,710	2,730.54	192,323,185	2.31
10	香港	投資証券	LINK REIT	200,441	1,252.95	251,143,182	905.57	181,515,360	2.18
11	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,403	18,911.86	196,740,129	16,553.04	172,201,306	2.07
12	アメリカ	投資証券	CUBESMART	51,854	3,488.32	180,883,409	2,950.38	152,989,072	1.84
13	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	5,801	24,772.04	143,702,647	25,094.02	145,570,418	1.75
14	アメリカ	投資証券	LIFE STORAGE INC	14,049	11,650.30	163,675,072	10,349.73	145,403,399	1.75
15	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	532	270,928	144,133,799	271,200	144,278,400	1.73
16	アメリカ	投資証券	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	51,457	3,523.95	181,332,292	2,750.13	141,513,650	1.70
17	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	15,574	11,384.22	177,297,892	9,069.89	141,254,501	1.70
18	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,062	13,933.07	168,060,768	11,658.95	140,630,350	1.69
19	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投 資証券	955	132,325	126,371,179	145,800	139,239,000	1.67
20	オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	171,171	953.67	163,240,932	788.45	134,960,408	1.62
21	アメリカ	投資証券	QTS REALTY TRUST INC CL A	19,807	5,258.48	104,154,814	6,323.02	125,240,117	1.51
22	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	220,111	954.36	210,067,147	541.97	119,294,307	1.43
23	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,994	11,333.85	124,604,352	10,529.30	115,759,152	1.39
24	アメリカ	投資証券	STAG INDUSTRIAL INC	45,103	3,190.97	143,922,445	2,485.67	112,111,499	1.35
25	シンガ ポール	投資証券	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	1,184,619	116.08	137,513,417	90.88	107,658,530	1.29
26	アメリカ	投資証券	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	100,862	1,821.89	183,760,303	1,066.53	107,572,752	1.29
27	アメリカ	投資証券	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	28,189	4,762.66	134,254,869	3,785.10	106,698,392	1.28
28	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	18,056	7,478.70	135,035,507	5,782.13	104,402,282	1.25
29	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	100,115	1,013.55	101,472,108	999.63	100,078,294	1.20
30	アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	14,917	7,019.29	104,706,824	6,686.51	99,742,747	1.20

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.74

合 計	96.74
-----	-------

### 投資不動産物件

#### 世界三資産バランスファンド

該当事項はありません。

（参考）世界債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）世界株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）世界REIT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

#### 世界三資産バランスファンド

該当事項はありません。

（参考）世界債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）世界株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）世界REIT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

#### 世界三資産バランスファンド

2020年3月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第10特定期間	(2010年 8月16日)	89,744	90,183	0.7159	0.7194
第11特定期間	(2011年 2月15日)	78,069	78,342	0.7143	0.7168
第12特定期間	(2011年 8月15日)	63,264	63,496	0.6803	0.6828
第13特定期間	(2012年 2月15日)	53,348	53,542	0.6879	0.6904
第14特定期間	(2012年 8月15日)	47,096	47,268	0.6838	0.6863
第15特定期間	(2013年 2月15日)	48,547	48,698	0.7987	0.8012
第16特定期間	(2013年 8月15日)	41,557	41,684	0.8153	0.8178
第17特定期間	(2014年 2月17日)	35,072	35,133	0.8613	0.8628
第18特定期間	(2014年 8月15日)	30,609	30,660	0.8941	0.8956
第19特定期間	(2015年 2月16日)	29,298	29,342	1.0082	1.0097
第20特定期間	(2015年 8月17日)	25,752	25,790	1.0195	1.0210
第21特定期間	(2016年 2月15日)	21,657	21,692	0.9204	0.9219
第22特定期間	(2016年 8月15日)	19,951	19,984	0.8902	0.8917
第23特定期間	(2017年 2月15日)	19,519	19,550	0.9309	0.9324
第24特定期間	(2017年 8月15日)	18,701	18,731	0.9376	0.9391
第25特定期間	(2018年 2月15日)	16,839	16,867	0.9224	0.9239
第26特定期間	(2018年 8月15日)	16,143	16,169	0.9324	0.9339
第27特定期間	(2019年 2月15日)	15,265	15,290	0.9276	0.9291
第28特定期間	(2019年 8月15日)	14,510	14,534	0.9318	0.9333
第29特定期間	(2020年 2月17日)	14,445	14,467	0.9893	0.9908
	2019年 3月末日	15,355		0.9472	
	4月末日	15,201		0.9520	
	5月末日	14,797		0.9307	
	6月末日	14,906		0.9422	
	7月末日	14,886		0.9519	
	8月末日	14,676		0.9445	
	9月末日	14,719		0.9579	
	10月末日	14,798		0.9720	
	11月末日	14,624		0.9745	
	12月末日	14,508		0.9802	
	2020年 1月末日	14,383		0.9818	
	2月末日	13,969		0.9621	
	3月末日	12,864		0.8996	

## 分配の推移

## 世界三資産バランスファンド

	計算期間	1口当たりの分配金
第10特定期間	2010年 2月16日～2010年 8月16日	0.0210円

第11特定期間	2010年 8月17日～2011年 2月15日	0.0160円
第12特定期間	2011年 2月16日～2011年 8月15日	0.0150円
第13特定期間	2011年 8月16日～2012年 2月15日	0.0150円
第14特定期間	2012年 2月16日～2012年 8月15日	0.0150円
第15特定期間	2012年 8月16日～2013年 2月15日	0.0150円
第16特定期間	2013年 2月16日～2013年 8月15日	0.0150円
第17特定期間	2013年 8月16日～2014年 2月17日	0.0120円
第18特定期間	2014年 2月18日～2014年 8月15日	0.0090円
第19特定期間	2014年 8月16日～2015年 2月16日	0.0090円
第20特定期間	2015年 2月17日～2015年 8月17日	0.0090円
第21特定期間	2015年 8月18日～2016年 2月15日	0.0090円
第22特定期間	2016年 2月16日～2016年 8月15日	0.0090円
第23特定期間	2016年 8月16日～2017年 2月15日	0.0090円
第24特定期間	2017年 2月16日～2017年 8月15日	0.0090円
第25特定期間	2017年 8月16日～2018年 2月15日	0.0090円
第26特定期間	2018年 2月16日～2018年 8月15日	0.0090円
第27特定期間	2018年 8月16日～2019年 2月15日	0.0090円
第28特定期間	2019年 2月16日～2019年 8月15日	0.0090円
第29特定期間	2019年 8月16日～2020年 2月17日	0.0090円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

#### 収益率の推移

#### 世界三資産バランスファンド

	計算期間	収益率
第10特定期間	2010年 2月16日～2010年 8月16日	0.5%
第11特定期間	2010年 8月17日～2011年 2月15日	2.0%
第12特定期間	2011年 2月16日～2011年 8月15日	2.7%
第13特定期間	2011年 8月16日～2012年 2月15日	3.3%
第14特定期間	2012年 2月16日～2012年 8月15日	1.6%
第15特定期間	2012年 8月16日～2013年 2月15日	19.0%
第16特定期間	2013年 2月16日～2013年 8月15日	4.0%
第17特定期間	2013年 8月16日～2014年 2月17日	7.1%
第18特定期間	2014年 2月18日～2014年 8月15日	4.9%
第19特定期間	2014年 8月16日～2015年 2月16日	13.8%
第20特定期間	2015年 2月17日～2015年 8月17日	2.0%
第21特定期間	2015年 8月18日～2016年 2月15日	8.8%
第22特定期間	2016年 2月16日～2016年 8月15日	2.3%
第23特定期間	2016年 8月16日～2017年 2月15日	5.6%
第24特定期間	2017年 2月16日～2017年 8月15日	1.7%
第25特定期間	2017年 8月16日～2018年 2月15日	0.7%

第26特定期間	2018年 2月16日～2018年 8月15日	2.1%
第27特定期間	2018年 8月16日～2019年 2月15日	0.5%
第28特定期間	2019年 2月16日～2019年 8月15日	1.4%
第29特定期間	2019年 8月16日～2020年 2月17日	7.1%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

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

#### (4) 設定及び解約の実績

##### 世界三資産バランスファンド

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第10特定期間	2010年 2月16日～2010年 8月16日	1,014,584,727	9,599,468,041	125,358,266,667
第11特定期間	2010年 8月17日～2011年 2月15日	703,201,276	16,760,736,303	109,300,731,640
第12特定期間	2011年 2月16日～2011年 8月15日	538,454,390	16,845,138,020	92,994,048,010
第13特定期間	2011年 8月16日～2012年 2月15日	462,768,739	15,903,999,565	77,552,817,184
第14特定期間	2012年 2月16日～2012年 8月15日	412,706,829	9,086,660,407	68,878,863,606
第15特定期間	2012年 8月16日～2013年 2月15日	377,849,719	8,476,671,371	60,780,041,954
第16特定期間	2013年 2月16日～2013年 8月15日	492,382,399	10,301,268,399	50,971,155,954
第17特定期間	2013年 8月16日～2014年 2月17日	249,436,986	10,502,758,947	40,717,833,993
第18特定期間	2014年 2月18日～2014年 8月15日	196,350,251	6,680,928,872	34,233,255,372
第19特定期間	2014年 8月16日～2015年 2月16日	203,505,566	5,377,693,590	29,059,067,348
第20特定期間	2015年 2月17日～2015年 8月17日	219,972,470	4,018,853,718	25,260,186,100
第21特定期間	2015年 8月18日～2016年 2月15日	235,384,365	1,965,077,116	23,530,493,349
第22特定期間	2016年 2月16日～2016年 8月15日	283,945,589	1,402,352,909	22,412,086,029
第23特定期間	2016年 8月16日～2017年 2月15日	694,578,526	2,139,443,487	20,967,221,068
第24特定期間	2017年 2月16日～2017年 8月15日	564,294,558	1,585,251,874	19,946,263,752
第25特定期間	2017年 8月16日～2018年 2月15日	270,203,480	1,959,357,399	18,257,109,833
第26特定期間	2018年 2月16日～2018年 8月15日	165,105,962	1,106,985,181	17,315,230,614
第27特定期間	2018年 8月16日～2019年 2月15日	151,777,839	1,010,167,906	16,456,840,547
第28特定期間	2019年 2月16日～2019年 8月15日	142,693,130	1,026,404,421	15,573,129,256
第29特定期間	2019年 8月16日～2020年 2月17日	96,752,565	1,068,351,208	14,601,530,613

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

< 更新後 >



## 運用実績（2020年3月31日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2020年3月	15 円
2020年2月	15 円
2020年1月	15 円
2019年12月	15 円
2019年11月	15 円
直近1年間累計	180 円
設定来累計	4,955 円

### ■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「世界債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	12.9
2	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	4.4
3	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	3.9
4	US TREASURY N/B	国債証券	3.3
5	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	国債証券	2.9
6	US TREASURY N/B	国債証券	2.5
7	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.2
8	US TREASURY N/B	国債証券	2.2
9	国庫債券 利付（20年）第157回	国債証券	2.1
10	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.0

・「世界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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.8
2	CISCO SYSTEMS	通信機器	0.6
3	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	0.5
4	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	0.5
5	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.4
6	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	0.4
7	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア機器・用品	0.4
8	LOCKHEED MARTIN	航空宇宙・防衛	0.4
9	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	0.4
10	ASTRAZENECA PLC	医薬品	0.4

・「世界REITマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	投資比率(%)
1	EQUINIX INC	0.7
2	PROLOGIS INC	0.7
3	EQUITY RESIDENTIAL	0.4
4	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.3
5	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.3
6	DUKE REALTY CORP	0.3
7	CROWN CASTLE INTL CORP	0.3
8	INVITATION HOMES INC	0.2
9	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	0.2
10	LINK REIT	0.2

## ■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



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

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

## 第3【ファンドの経理状況】

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

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2019年8月16日から2020年2月17日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1 財務諸表

## 世界三資産バランスファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)		
	前期 (2019年 8月15日現在)	当期 (2020年 2月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	59,241,520	66,929,166
親投資信託受益証券	14,461,177,328	14,390,955,612
未収入金	40,000,000	40,000,000
流動資産合計	14,560,418,848	14,497,884,778
<b>資産合計</b>	<b>14,560,418,848</b>	<b>14,497,884,778</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	23,359,693	21,902,295
未払解約金	11,625,144	14,236,443
未払受託者報酬	655,133	716,733
未払委託者報酬	13,757,793	15,051,432
未払利息	40	48
その他未払費用	26,195	28,659
流動負債合計	49,423,998	51,935,610
<b>負債合計</b>	<b>49,423,998</b>	<b>51,935,610</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	15,573,129,256	14,601,530,613
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,062,134,406	155,581,445
(分配準備積立金)	738,229,373	690,948,802
元本等合計	14,510,994,850	14,445,949,168
<b>純資産合計</b>	<b>14,510,994,850</b>	<b>14,445,949,168</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>14,560,418,848</b>	<b>14,497,884,778</b>

## (2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)		
	前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	312,616,583	1,098,778,284
<b>営業収益合計</b>	<b>312,616,583</b>	<b>1,098,778,284</b>

	前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
営業費用		
支払利息	19,754	12,388
受託者報酬	4,041,355	4,063,265
委託者報酬	84,868,437	85,328,489
その他費用	161,588	162,473
営業費用合計	89,091,134	89,566,615
営業利益又は営業損失( )	223,525,449	1,009,211,669
経常利益又は経常損失( )	223,525,449	1,009,211,669
当期純利益又は当期純損失( )	223,525,449	1,009,211,669
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	2,084,070	5,501,982
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,191,505,115	1,062,134,406
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,296,516	41,433,416
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	59,296,516	41,433,416
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,062,860	3,369,776
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,062,860	3,369,776
分配金	143,304,326	135,220,366
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,062,134,406	155,581,445

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2019年 8月16日から2020年 2月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2019年 8月15日現在	当期 2020年 2月17日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 15,573,129,256口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 14,601,530,613口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 1,062,134,406円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 155,581,445円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9318円 (10,000口当たり純資産額) (9,318円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9893円 (10,000口当たり純資産額) (9,893円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日																																										
<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である世界債券マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 3,099,834円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である世界株式マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)及びNOMURA ASSET MANAGEMENT U.S.A. INC. (ノムラ・アセット・マネジメントU.S.A. インク) に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED.</p> <p>支払金額 3,851,948円</p> <p>NOMURA ASSET MANAGEMENT U.S.A. INC.</p> <p>支払金額 462,234円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である世界REITマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 29,681,291円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2019年 2月16日から2019年 3月15日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>29,905,675円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>208,720,821円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>772,064,063円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,010,690,559円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>16,312,059,563口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	29,905,675円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	208,720,821円	分配準備積立金額	D	772,064,063円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,010,690,559円	当ファンドの期末残存口数	F	16,312,059,563口	<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である世界債券マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 3,071,555円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である世界株式マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)及びNOMURA ASSET MANAGEMENT U.S.A. INC. (ノムラ・アセット・マネジメントU.S.A. インク) に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っていません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED.</p> <p>支払金額 3,861,652円</p> <p>NOMURA ASSET MANAGEMENT U.S.A. INC.</p> <p>支払金額 463,398円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である世界REITマザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>支払金額 23,193,031円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2019年 8月16日から2019年 9月17日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>24,441,418円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>204,352,005円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>733,186,179円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>961,979,602円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>15,479,646,707口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	24,441,418円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	204,352,005円	分配準備積立金額	D	733,186,179円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	961,979,602円	当ファンドの期末残存口数	F	15,479,646,707口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	29,905,675円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	208,720,821円																																									
分配準備積立金額	D	772,064,063円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,010,690,559円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	16,312,059,563口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	24,441,418円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	204,352,005円																																									
分配準備積立金額	D	733,186,179円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	961,979,602円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	15,479,646,707口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	619円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	24,468,089円

2019年 3月16日から2019年 4月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	31,986,127円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	206,731,629円
分配準備積立金額	D	766,329,424円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,005,047,180円
当ファンドの期末残存口数	F	16,088,882,529口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	624円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	24,133,323円

2019年 4月16日から2019年 5月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	16,122,081円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	206,224,948円
分配準備積立金額	D	766,418,484円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	988,765,513円
当ファンドの期末残存口数	F	15,949,050,519口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	619円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	23,923,575円

2019年 5月16日から2019年 6月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	31,284,172円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	206,794,854円
分配準備積立金額	D	753,280,872円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	991,359,898円
当ファンドの期末残存口数	F	15,867,214,191口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	624円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	23,800,821円

2019年 6月18日から2019年 7月16日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	26,055,612円

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	621円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	23,219,470円

2019年 9月18日から2019年10月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	23,776,725円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	203,013,901円
分配準備積立金額	D	726,501,362円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	953,291,988円
当ファンドの期末残存口数	F	15,323,165,979口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	622円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	22,984,748円

2019年10月16日から2019年11月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	18,194,745円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	200,277,866円
分配準備積立金額	D	714,828,961円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	933,301,572円
当ファンドの期末残存口数	F	15,067,376,282口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	619円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	22,601,064円

2019年11月16日から2019年12月16日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	24,219,160円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	199,029,347円
分配準備積立金額	D	702,833,337円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	926,081,844円
当ファンドの期末残存口数	F	14,917,540,704口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	620円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	22,376,311円

2019年12月17日から2020年 1月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	25,970,468円

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	206,079,718円
分配準備積立金額	D	754,270,136円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	986,405,466円
当ファンドの期末残存口数	F	15,745,883,770口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	626円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	23,618,825円

2019年 7月17日から2019年 8月15日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	13,926,506円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	204,836,729円
分配準備積立金額	D	747,662,560円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	966,425,795円
当ファンドの期末残存口数	F	15,573,129,256口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	620円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	23,359,693円

費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	197,858,192円
分配準備積立金額	D	696,416,177円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	920,244,837円
当ファンドの期末残存口数	F	14,757,652,494口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	623円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	22,136,478円

2020年 1月16日から2020年 2月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	20,581,699円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	196,568,890円
分配準備積立金額	D	692,269,398円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	909,419,987円
当ファンドの期末残存口数	F	14,601,530,613口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	622円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	21,902,295円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

<p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

## (2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2019年 8月15日現在	当期 2020年 2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ぬ。</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>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. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
期首元本額 16,456,840,547円	期首元本額 15,573,129,256円

期中追加設定元本額	142,693,130円	期中追加設定元本額	96,752,565円
期中一部解約元本額	1,026,404,421円	期中一部解約元本額	1,068,351,208円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年 2月16日 至 2019年 8月15日	当期 自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	206,690,712	161,560,790
合計	206,690,712	161,560,790

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	世界債券マザーファンド	5,534,379,931	9,896,024,754	
		世界株式マザーファンド	983,088,801	3,046,002,341	
		世界REITマザーファンド	420,882,042	1,448,928,517	
	小計	銘柄数:3 組入時価比率:99.6%	6,938,350,774	14,390,955,612 100.0%	
合計			14,390,955,612		

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは「世界債券マザーファンド」、「世界株式マザーファンド」および「世界REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 世界債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）	
(2020年 2月17日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	239,933,200
コール・ローン	167,333,323
国債証券	9,507,558,826
派生商品評価勘定	69,136,627
未収入金	220,677,502
未収利息	42,128,482
前払費用	9,791,879
流動資産合計	10,256,559,839
<b>資産合計</b>	<b>10,256,559,839</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,400,766
未払金	320,031,757
未払解約金	28,000,000
未払利息	121
流動負債合計	360,432,644
<b>負債合計</b>	<b>360,432,644</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	5,534,379,931
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,361,747,264
元本等合計	9,896,127,195
純資産合計	9,896,127,195
<b>負債純資産合計</b>	<b>10,256,559,839</b>

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 2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	1,7881円
(10,000口当たり純資産額)	(17,881円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日	
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の外貨エクスポージャーの調整、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 2月17日現在	
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 2月17日現在	
期首	2019年 8月16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	5,865,489,024円
同期中における追加設定元本額	8,531,938円
同期中における一部解約元本額	339,641,031円
期末元本額	5,534,379,931円
期末元本額の内訳*	
世界三資産バランスファンド	5,534,379,931円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(10年)第348回	440,000,000	447,924,400	
		国庫債券 利付(10年)第349回	50,000,000	50,910,000	
		国庫債券 利付(10年)第351回	330,000,000	335,685,900	
		国庫債券 利付(30年)第56回	50,000,000	56,012,500	
		国庫債券 利付(30年)第64回	75,000,000	75,700,500	

小計	国庫債券 利付(20年)第150回	220,000,000	260,741,800	
	国庫債券 利付(20年)第157回	280,000,000	281,556,800	
	国庫債券 利付(20年)第168回	190,000,000	196,081,900	
	銘柄数: 8 組入時価比率: 17.2%	1,635,000,000	1,704,613,800	17.9%
米ドル	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,044,726.50	
	US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,940,214.59	
	US TREASURY N/B	8,200,000.00	8,508,780.84	
	US TREASURY N/B	100,000.00	123,148.43	
	銘柄数: 4 組入時価比率: 18.4%	16,200,000.00	16,616,870.36	(1,824,532,365) 19.2%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	647,050.00	
小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 0.5%	500,000.00	647,050.00	(53,614,563) 0.6%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000.00	26,482,947.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000.00	26,392,500.00	
	銘柄数: 2 組入時価比率: 3.2%	50,000,000.00	52,875,447.50	(313,022,649) 3.3%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	775,177.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,020,420.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	3,248,902.30	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	2,852,192.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,200,000.00	4,208,988.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,710,810.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000.00	5,720,235.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	411,600.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,442,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	2,299,840.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	1,914,400.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	1,100,560.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	647,400.00	

小計	FRANCE (GOVT OF)	2,400,000.00	2,558,577.60	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	661,949.60	
	銘柄数：15	31,300,000.00	36,573,852.30	(4,350,825,469)
	組入時価比率：44.0%			45.7%
英債券	UK TREASURY	500,000.00	824,300.00	
	UK TREASURY	500,000.00	761,450.00	
	UK TREASURY	500,000.00	580,400.00	
小計	銘柄数：3	1,500,000.00	2,166,150.00	(310,192,680)
	組入時価比率：3.1%			3.3%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	18,000,000.00	19,299,330.00	
小計	銘柄数：1	18,000,000.00	19,299,330.00	(218,275,422)
	組入時価比率：2.2%			2.3%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	848,837.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,566,110.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	660,720.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,246,040.00	
小計	銘柄数：4	5,500,000.00	6,321,707.44	(466,099,489)
	組入時価比率：4.7%			4.9%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,325,760.00	
小計	銘柄数：1	1,200,000.00	1,325,760.00	(104,628,979)
	組入時価比率：1.1%			1.1%
リングギ	MALAYSIA GOVERNMENT	5,200,000.00	6,097,000.00	
小計	銘柄数：1	5,200,000.00	6,097,000.00	(161,753,410)
	組入時価比率：1.6%			1.7%
合計			9,507,558,826	(7,802,945,026)

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 2月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,985,035,397	-	2,976,461,500	8,573,897
米ドル	2,509,688,810	-	2,508,244,500	1,444,310
ユーロ	209,004,407	-	208,180,000	824,407
ノルウェークローネ	117,425,700	-	112,670,000	4,755,700
ズロチ	46,228,544	-	44,784,000	1,444,544
シンガポールドル	102,687,936	-	102,583,000	104,936
売建	3,196,666,258	-	3,131,356,500	65,309,758
米ドル	170,312,760	-	170,159,000	153,760
メキシコペソ	157,109,600	-	159,570,000	2,460,400
ユーロ	1,667,534,503	-	1,623,804,000	43,730,503
英ポンド	213,850,911	-	214,778,500	927,589
スウェーデンクローナ	211,621,410	-	205,842,000	5,779,410
豪ドル	424,019,120	-	412,832,000	11,187,120
シンガポールドル	179,402,674	-	173,580,000	5,822,674
リングギ	100,653,480	-	100,776,000	122,520
ランド	72,161,800	-	70,015,000	2,146,800
合計	-	-	-	56,735,861

## (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ありません。

## 世界株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 2月17日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	78,241,032
コール・ローン	21,846,943
株式	2,960,797,817
派生商品評価勘定	38,706
未収入金	4,030,814
未収配当金	4,326,043
流動資産合計	3,069,281,355
資産合計	3,069,281,355
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	15,317,569
未払解約金	8,000,000
未払利息	15
流動負債合計	23,317,584
負債合計	23,317,584
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	983,088,801
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,062,874,970
元本等合計	3,045,963,771
純資産合計	3,045,963,771
負債純資産合計	3,069,281,355

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 2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	3.0984円
(10,000口当たり純資産額)	(30,984円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 2月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 2月17日現在	
期首	2019年 8月16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	1,101,868,565円
同期中における追加設定元本額	0円
同期中における一部解約元本額	118,779,764円
期末元本額	983,088,801円
期末元本額の内訳*	
世界三資産バランスファンド	983,088,801円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	大東建託	800	12,665.00	10,132,000	
		大和ハウス工業	1,800	3,413.00	6,143,400	
		日本たばこ産業	6,000	2,254.50	13,527,000	
		三菱ケミカルホールディングス	11,200	798.50	8,943,200	
		ポーラ・オルビスホールディングス	4,200	2,384.00	10,012,800	
		アステラス製薬	7,400	1,895.00	14,023,000	
		JXTGホールディングス	20,000	474.90	9,498,000	
		小松製作所	4,700	2,324.00	10,922,800	
		三菱電機	8,100	1,564.00	12,668,400	
		トヨタ自動車	1,700	7,725.00	13,132,500	
		KDDI	7,200	3,431.00	24,703,200	
		伊藤忠商事	5,900	2,623.00	15,475,700	
		三井物産	5,800	1,937.00	11,234,600	
		三井住友フィナンシャルグループ	4,100	3,844.00	15,760,400	
		ソニーフィナンシャルホールディングス	3,200	2,445.00	7,824,000	

小計	銘柄数：15			184,001,000
	組入時価比率：6.0%			6.2%
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	1,100	34.42	37,862.00
	CHEVRON CORP	2,170	110.08	238,873.60
	ENBRIDGE INC	3,018	42.20	127,359.60
	EXXON MOBIL CORP	500	60.65	30,325.00
	HOLLYFRONTIER CORP	3,200	43.32	138,624.00
	CORTEVA INC	10,347	30.71	317,756.37
	DUPONT DE NEMOURS INC	6,347	53.10	337,025.70
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,550	82.60	128,030.00
	WESTROCK CO	3,200	40.53	129,696.00
	LOCKHEED MARTIN	990	437.85	433,471.50
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	3,900	41.96	163,644.00
	EATON CORP PLC	890	103.55	92,159.50
	ROCKWELL AUTOMATION INC	490	200.68	98,333.20
	3M CORP	2,290	161.01	368,712.90
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	490	180.81	88,596.90
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,280	105.95	347,516.00
	COPA HOLDINGS SA-CLASS A	1,800	110.01	198,018.00
	UNION PAC CORP	1,380	184.00	253,920.00
	LEAR CORP	1,275	122.76	156,519.00
	GENERAL MOTORS CO	5,600	34.76	194,656.00
	RALPH LAUREN CORPORATION	850	121.84	103,564.00
	FOOT LOCKER INC	4,650	40.38	187,767.00
	HOME DEPOT	875	245.03	214,401.25
	TJX COS INC	4,680	63.38	296,618.40
	COCA COLA CO	8,450	59.95	506,577.50
	PEPSICO INC	2,980	146.99	438,030.20
	ALTRIA GROUP INC	900	45.17	40,653.00
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	5,690	88.50	503,565.00
	COTY INC-CL A	16,869	11.41	192,475.29
	ABBOTT LABORATORIES	1,850	89.66	165,871.00
	MEDTRONIC PLC	4,210	117.33	493,959.30
	AMERISOURCEBERGEN CORP	650	94.36	61,334.00
	CVS HEALTH CORP	5,000	71.37	356,850.00
	UNITEDHEALTH GROUP INC	1,120	298.78	334,633.60
	ABBVIE INC	3,620	94.05	340,461.00
	AMGEN INC	1,275	223.48	284,937.00
	GILEAD SCIENCES INC	3,600	67.56	243,216.00
	JOHNSON & JOHNSON	3,460	150.13	519,449.80
	JPMORGAN CHASE & CO	3,970	137.46	545,716.20
	WELLS FARGO CO	7,450	48.22	359,239.00

	AMERICAN INTL GROUP	5,050	48.48	244,824.00	
	MARSH & MCLENNAN COS	2,140	118.78	254,189.20	
	MASTERCARD INC	1,400	340.95	477,330.00	
	PAYCHEX INC	3,199	89.21	285,382.79	
	MICROSOFT CORP	5,990	185.35	1,110,246.50	
	ORACLE CORPORATION	4,300	55.47	238,521.00	
	CISCO SYSTEMS	15,100	46.97	709,247.00	
	APPLE INC	970	324.95	315,201.50	
	TE CONNECTIVITY LTD	1,060	93.30	98,898.00	
	BROADCOM INC	1,570	317.77	498,898.90	
	INTEL CORP	4,300	67.27	289,261.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY	430	109.36	47,024.80	
	VERIZON COMMUNICATIONS	8,800	58.51	514,888.00	
	EVERSOURCE ENERGY	1,000	93.66	93,660.00	
	EXELON CORPORATION	4,800	49.76	238,848.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	1,340	101.87	136,505.80	
	ARES CAPITAL CORP	15,100	19.02	287,202.00	
	BLACKROCK INC	250	565.94	141,485.00	
	S&P GLOBAL INC	765	307.65	235,352.25	
	COMCAST CORP-CL A	9,500	46.09	437,855.00	
小計	銘柄数：60			16,725,238.55	
				(1,836,431,192)	
	組入時価比率：60.3%			62.0%	
カナダドル	ENBRIDGE INC	9,400	56.03	526,682.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,500	73.76	331,920.00	
	TORONTO DOMINION BANK	5,000	75.29	376,450.00	
小計	銘柄数：3			1,235,052.00	
				(102,336,408)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
ユーロ	ENI SPA	13,662	12.89	176,130.50	
	BASF SE	963	62.51	60,197.13	
	DEUTSCHE POST AG-REG	6,373	33.25	211,934.11	
	AENA SME SA	1,029	168.35	173,232.15	
	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,728	43.06	74,416.32	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,140	67.75	144,985.00	
	UNILEVER NV	6,244	54.85	342,483.40	
	BNP PARIBAS	2,425	53.68	130,174.00	
	ING GROEP NV	21,539	10.71	230,682.69	
	ALLIANZ SE-REG	804	231.25	185,925.00	
	AXA	7,896	25.46	201,032.16	
	SAP SE	1,346	127.14	171,130.44	
	ORANGE SA	6,440	13.36	86,038.40	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,685	19.02	184,208.70	

	RELX PLC	3,340	24.89	83,132.60	
小計	銘柄数：15			2,455,702.60	
	組入時価比率：9.6%			(292,130,381)	
				9.9%	
英ポンド	BP PLC	50,604	4.56	231,184.37	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	23,298	5.00	116,490.00	
	PERSIMMON PLC	4,526	32.30	146,189.80	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	4,499	33.47	150,581.53	
	ASTRAZENECA PLC	4,973	73.00	363,029.00	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	22,210	16.68	370,596.06	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	125,213	0.56	70,883.07	
	PRUDENTIAL PLC	7,780	14.76	114,871.70	
	BT GROUP PLC	65,000	1.53	99,801.00	
	VODAFONE GROUP PLC	71,837	1.50	107,784.23	
	NATIONAL GRID PLC	18,872	10.40	196,268.80	
小計	銘柄数：11			1,967,679.56	
	組入時価比率：9.3%			(281,771,712)	
				9.5%	
スイスフラン	ABB LTD	3,405	23.79	81,004.95	
	NESTLE SA-REG	3,063	107.56	329,456.28	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	1,768	340.60	602,180.80	
	UBS GROUP AG	16,669	12.96	216,113.58	
小計	銘柄数：4			1,228,755.61	
	組入時価比率：4.5%			(137,387,164)	
				4.6%	
スウェーデンクローナ	SWEDBANK AB	8,469	156.95	1,329,209.55	
	小計	銘柄数：1			1,329,209.55
	組入時価比率：0.5%			(15,033,360)	
				0.5%	
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	2,569	436.05	1,120,212.45	
	小計	銘柄数：1			1,120,212.45
	組入時価比率：0.6%			(17,833,782)	
				0.6%	
豪ドル	RIO TINTO LTD	1,850	97.65	180,652.50	
	小計	銘柄数：1			180,652.50
	組入時価比率：0.4%			(13,319,508)	
				0.4%	
香港ドル	AIA GROUP LTD	8,800	80.65	709,720.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,500	90.90	499,950.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	290,000	3.12	904,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	47,000	11.94	561,180.00	
小計	銘柄数：4			2,675,650.00	

					(37,806,934)	
		組入時価比率：1.2%			1.3%	
シンガポールドル	DBS GROUP HDGS		12,500	25.55	319,375.00	
小計	銘柄数：1				319,375.00	
					(25,205,075)	
		組入時価比率：0.8%			0.9%	
新台湾ドル	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD		26,123	77.40	2,021,920.20	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR		8,271	335.00	2,770,785.00	
小計	銘柄数：2				4,792,705.20	
					(17,541,301)	
		組入時価比率：0.6%			0.6%	
合計					2,960,797,817	
					(2,776,796,817)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年2月17日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	7,280,756	-	7,242,050	38,706
スイスフラン	5,541,742	-	5,511,623	30,119
デンマーククローネ	1,739,014	-	1,730,427	8,587
合計	7,280,756	-	7,242,050	38,706

(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。

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	54,352,802
コール・ローン	39,194,499
投資証券	10,208,460,802
未収入金	27,338,876
未収配当金	17,315,499
流動資産合計	10,346,662,478
資産合計	10,346,662,478
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,641
未払金	35,524,753
未払解約金	9,240,000
未払利息	28
流動負債合計	44,781,422
負債合計	44,781,422
純資産の部	
元本等	
元本	2,992,440,773
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,309,440,283
元本等合計	10,301,881,056
純資産合計	10,301,881,056
負債純資産合計	10,346,662,478

## 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>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>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>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 2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	3.4426円
(10,000口当たり純資産額)	(34,426円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 8月16日 至 2020年 2月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 2月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>

## 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

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 2月17日現在	
期首	2019年 8月16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	4,347,605,515円
同期中における追加設定元本額	777,663,877円
同期中における一部解約元本額	2,132,828,619円
期末元本額	2,992,440,773円
期末元本額の内訳*	
世界三資産バランスファンド	420,882,042円
野村世界REITファンドAコース（野村SMA向け）	253,074,970円
野村世界REITファンドBコース（野村SMA向け）	347,921,113円
野村世界REITファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	901,922,579円
野村世界REITファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	1,068,640,069円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	575	77,797,500	
		SOSiLA物流リート投資法人 投資証券	456	57,228,000	
		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	283	60,590,300	
		GLP投資法人 投資証券	579	85,981,500	
		日本プロロジスリート投資法人 投資証券	391	121,601,000	
		イオンリート投資法人 投資証券	475	69,302,500	

小計	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	251	68,196,700
	ラサールロジポート投資法人 投資 証券	795	145,246,500
	三菱地所物流リート投資法人 投資 証券	99	41,035,500
	オリックス不動産投資法人 投資証 券	663	157,595,100
	銘柄数：10 組入時価比率：8.6%	4,567	884,574,600 8.7%
米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,260	2,494,501.80
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,688	1,136,076.48
	AMERICOLD REALTY TRUST	11,245	427,984.70
	BRANDYWINE REALTY TRUST	58,377	944,539.86
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	109,243	2,254,775.52
	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,710	2,105,541.90
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	48,725	1,090,952.75
	COUSINS PROPERTIES INC	24,854	1,059,526.02
	CROWN CASTLE INTL CORP	10,452	1,734,718.44
	CUBESMART	25,852	853,116.00
	CYRUSONE INC	17,443	1,181,239.96
	DUKE REALTY CORP	58,633	2,256,197.84
	EQUINIX INC	5,728	3,715,467.20
	EQUITY RESIDENTIAL	34,535	2,985,896.10
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,564	1,219,402.52
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	20,318	650,582.36
	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	59,352	1,988,885.52
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	66,954	2,498,053.74
	HOST HOTELS & RESORTS INC	49,906	843,910.46
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	40,688	1,574,625.60
	INVITATION HOMES INC	63,883	2,079,391.65
	LIFE STORAGE INC	10,143	1,188,252.45
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,447	1,214,763.76
	MGM GROWTH PROPERTIES LLC-A	29,864	1,007,910.00
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,118	1,326,760.18
	OFFICE PROPERTIES INCOME	15,987	551,071.89
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	37,472	916,190.40
	PROLOGIS INC	52,310	5,102,840.50
	QTS REALTY TRUST INC CL A	15,859	959,945.27
	RETAIL PROPERTIES OF AME-A	50,394	640,003.80
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,360	580,795.20
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,055	3,202,800.60
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	21,650	1,164,120.50	
STAG INDUSTRIAL INC	40,676	1,337,833.64	

	STORE CAPITAL CORP	25,852	1,003,057.60
	SUN COMMUNITIES INC	6,317	1,061,192.83
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	23,065	311,608.15
	URBAN EDGE PROPERTIES	30,344	562,881.20
	VEREIT INC	252,544	2,533,016.32
	VICI PROPERTIES INC	68,822	1,934,586.42
	VORNADO REALTY TRUST	14,931	1,013,665.59
	WELLTOWER INC	13,275	1,185,723.00
小計	銘柄数：42	1,570,895	63,894,405.72 (7,015,605,748)
	組入時価比率：68.1%		68.7%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	20,847	1,225,386.66
小計	銘柄数：1	20,847	1,225,386.66 (101,535,538)
	組入時価比率：1.0%		1.0%
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	51,012	963,106.56
	GECINA SA	6,192	1,123,848.00
	HIBERNIA REIT PLC	241,643	325,976.40
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	37,279	496,929.07
	NSI NV	6,737	344,934.40
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,519	954,537.05
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	15,701	446,614.94
小計	銘柄数：7	366,083	4,655,946.42 (553,871,386)
	組入時価比率：5.4%		5.4%
英ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	32,478	390,060.78
	DERWENT LONDON PLC	18,486	791,200.80
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	57,349	489,760.46
	SEGRO PLC	87,354	816,759.90
	UNITE GROUP PLC	72,550	970,719.00
	WORKSPACE GROUP PLC	35,656	464,954.24
小計	銘柄数：6	303,873	3,923,455.18 (561,838,781)
	組入時価比率：5.5%		5.5%
豪ドル	CHARTER HALL GROUP	107,218	1,392,761.82
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	374,561	1,374,638.87
	DEXUS	117,419	1,547,582.42
	GOODMAN GROUP	203,262	3,341,627.28
	GPT GROUP	224,193	1,398,964.32
小計	銘柄数：5	1,026,653	9,055,574.71 (667,667,523)
	組入時価比率：6.5%		6.5%
香港ドル	LINK REIT	189,392	14,905,150.40

小計	銘柄数：1	189,392	14,905,150.40 (210,609,775)	2.1%
	組入時価比率：2.0%			
シンガポールドル	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	1,346,389	2,033,047.39	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	334,755	662,814.90	
小計	銘柄数：2	1,681,144	2,695,862.29 (212,757,451)	2.1%
	組入時価比率：2.1%			
合計			10,208,460,802 (9,323,886,202)	

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

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建	11,179,841	-	11,163,200	16,641
ユーロ	2,380,386	-	2,379,200	1,186
豪ドル	7,385,270	-	7,372,000	13,270
香港ドル	1,414,185	-	1,412,000	2,185
合計	11,179,841	-	11,163,200	16,641

(注) 時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

### 世界三資産バランスファンド

2020年3月31日現在

資産総額	12,882,276,222円
負債総額	17,412,108円
純資産総額（ - ）	12,864,864,114円
発行済口数	14,300,740,667口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8996円

## （参考）世界債券マザーファンド

2020年3月31日現在

資産総額	10,599,410,619円
負債総額	1,663,538,349円
純資産総額（ - ）	8,935,872,270円
発行済口数	5,085,770,082口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7570円

## （参考）世界株式マザーファンド

2020年3月31日現在

資産総額	2,586,962,470円
負債総額	239円
純資産総額（ - ）	2,586,962,231円
発行済口数	1,084,446,047口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3855円

## （参考）世界REITマザーファンド

2020年3月31日現在

資産総額	8,518,034,685円
負債総額	225,519,261円
純資産総額（ - ）	8,292,515,424円
発行済口数	3,461,513,288口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3956円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

2020年3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。

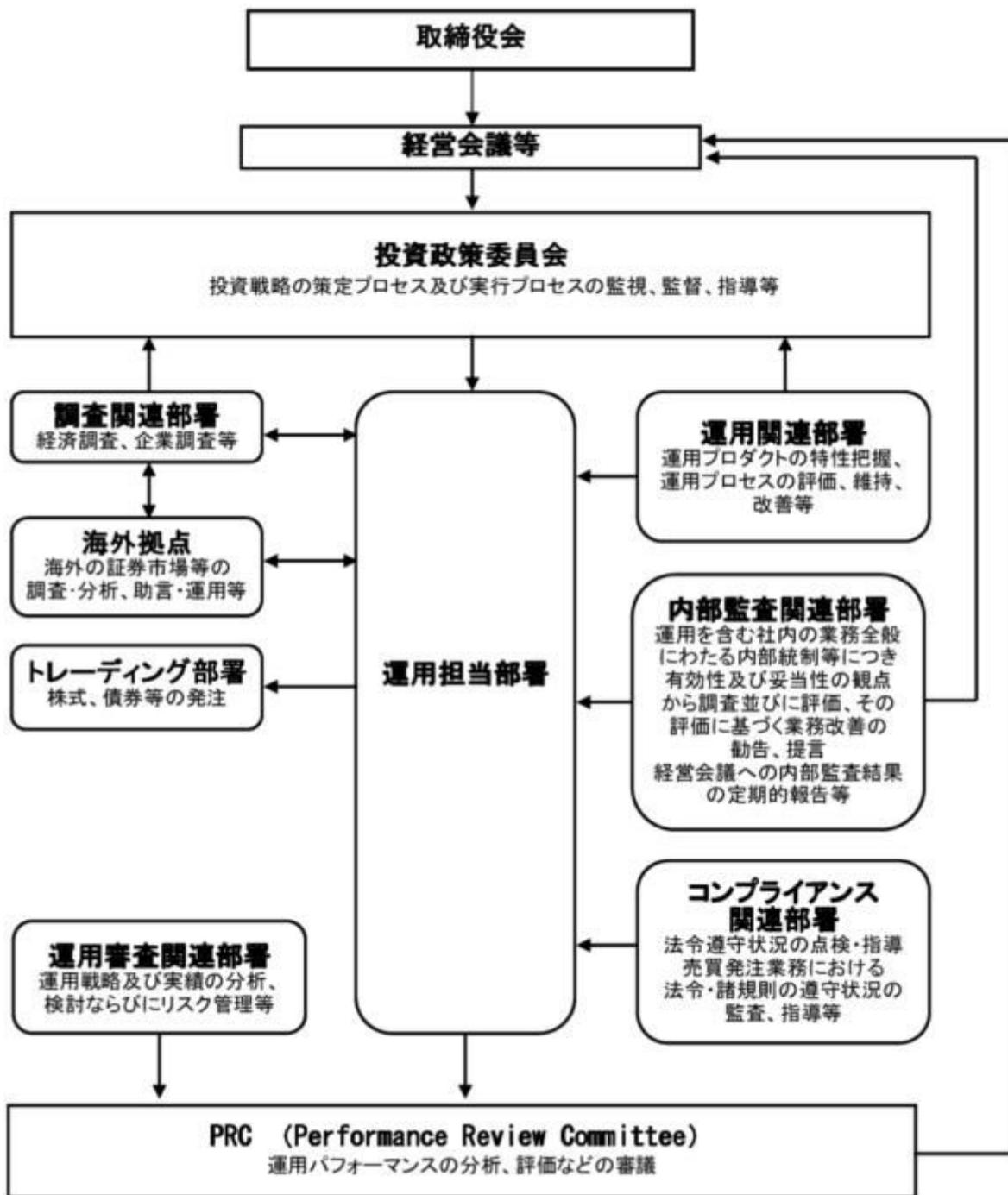
###### 代表取締役・業務執行取締役

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

## &lt;更新後&gt;

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年2月28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	1,004	27,856,953
単位型株式投資信託	184	891,086
追加型公社債投資信託	14	5,668,377
単位型公社債投資信託	455	1,701,274
合計	1,657	36,117,690

### 3 委託会社等の経理状況

#### < 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

#### (1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2018年3月31日)	(2019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		919	1,562
金銭の信託		47,936	45,493
有価証券		22,600	19,900
前払金		0	-
前払費用		26	27
未収入金		464	500
未収委託者報酬		24,059	25,246
未収運用受託報酬		6,764	5,933

その他			181		269
貸倒引当金			15		15
流動資産計			102,937		98,917
固定資産					
有形固定資産			874		714
建物	2	348		320	
器具備品	2	525		393	
無形固定資産			7,157		6,438
ソフトウェア		7,156		6,437	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,825		18,608
投資有価証券		1,184		1,562	
関係会社株式		9,033		12,631	
従業員長期貸付金		36		-	
長期差入保証金		54		235	
長期前払費用		36		22	
前払年金費用		2,350		2,001	
繰延税金資産		3,074		2,694	
その他		168		168	
貸倒引当金		0		-	
投資損失引当金		-		707	
固定資産計			23,969		25,761
資産合計			126,906		124,679

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019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			133		145
未払金	1		17,853		16,709
未払収益分配金		1		0	
未払償還金		31		25	
未払手数料		7,884		7,724	
関係会社未払金		7,930		7,422	
その他未払金		2,005		1,535	
未払費用	1		12,441		11,704
未払法人税等			2,241		1,560
前受収益			33		29
賞与引当金			4,626		3,792
流動負債計			37,329		33,942
固定負債					
退職給付引当金			2,938		3,219
時効後支払損引当金			548		558
固定負債計			3,486		3,777
負債合計			40,816		37,720
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,078		86,924
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729

資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,168		56,014
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,483		55,329	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,876		30,723	
評価・換算差額等			11		33
その他有価証券評価差額金			11		33
純資産合計			86,090		86,958
負債・純資産合計			126,906		124,679

## (2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			115,907		119,196
運用受託報酬			26,200		21,440
その他営業収益			338		355
営業収益計			142,447		140,992
営業費用					
支払手数料			45,252		42,675
広告宣伝費			1,079		1,210
公告費			0		0
調査費			30,516		30,082
調査費		5,830		5,998	
委託調査費		24,685		24,083	
委託計算費			1,376		1,311
営業雑経費			5,464		5,435
通信費		125		92	
印刷費		966		970	
協会費		79		86	
諸経費		4,293		4,286	
営業費用計			83,689		80,715
一般管理費					
給料			11,716		11,113
役員報酬		425		379	
給料・手当		6,856		7,067	
賞与		4,433		3,666	
交際費			132		107
旅費交通費			482		514
租税公課			1,107		1,048
不動産賃借料			1,221		1,223
退職給付費用			1,110		1,474
固定資産減価償却費			2,706		2,835

諸経費			9,131		10,115
一般管理費計			27,609		28,433
営業利益			31,148		31,843

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,031		6,538	
受取利息		4		0	
その他		362		424	
営業外収益計			4,398		6,964
営業外費用					
支払利息		2		1	
金銭の信託運用損		312		489	
時効後支払損引当金繰入額		13		43	
為替差損		46		34	
その他		31		17	
営業外費用計			405		585
経常利益			35,141		38,222
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		20	
関係会社清算益	3	-		29	
株式報酬受入益		75		85	
特別利益計			95		135
特別損失					
投資有価証券等評価損		2		938	
関係会社株式評価損		-		161	
固定資産除却損	2	58		310	
投資損失引当金繰入額		-		707	
特別損失計			60		2,118
税引前当期純利益			35,176		36,239
法人税、住民税及び事業税			10,775		10,196
法人税等調整額			439		370
当期純利益			24,840		25,672

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(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	41	41	86,878
当期変動額			
剰余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672

株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位:百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
剰余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目 の当期変動額(純 額)	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法  (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年  (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

4．引当金の計上基準	<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>(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業年金について、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 確定給付型企業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業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>(5) 投資損失引当金 子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p>
5．消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してあります。
6．連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

## 【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 平成30年3月30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 平成30年3月30日）

### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 【表示方法の変更に関する注記】

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」2,111百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」3,074百万円に含めて表示しております。

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019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 1,781百万円	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 1,434百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 736百万円 器具備品 3,106 合計 3,842

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019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 4,026百万円 支払利息 2	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1
2. 固定資産除却損 建物 4百万円 器具備品 0 ソフトウェア 53 合計 58	2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 3 ソフトウェア 307 合計 310
	3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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

2017年5月12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	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円

基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

## 金融商品関係

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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

2018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	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-
その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

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。

す。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）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。

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	919	-	-	-
金銭の信託	47,936	-	-	-
未収委託者報酬	24,059	-	-	-
未収運用受託報酬	6,764	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバ

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-
(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関して

は、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2018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(2018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(2018年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2018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	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

## 当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2019年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
----	-----------------------	---------------	-------------

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

## 5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

## 退職給付関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398
(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	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

## (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	18,163百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	929百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	887

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.9%
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、195百万円でした。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469

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

積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019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 1,434	賞与引当金 1,175
退職給付引当金 910	退職給付引当金 998
投資有価証券評価減 417	投資有価証券評価減 708
未払事業税 409	未払事業税 288
投資損失引当金 -	投資損失引当金 219
ゴルフ会員権評価減 207	ゴルフ会員権評価減 192
時効後支払損引当金 169	時効後支払損引当金 172
減価償却超過額 171	減価償却超過額 171
子会社株式売却損 148	子会社株式売却損 148
未払社会保険料 107	未払社会保険料 82
その他 566	その他 466
繰延税金資産小計 4,543	繰延税金資産小計 4,625
評価性引当額 735	評価性引当額 1,295
繰延税金資産合計 3,808	繰延税金資産合計 3,329
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 5	その他有価証券評価差額金 15
前払年金費用 728	前払年金費用 620
繰延税金負債合計 733	繰延税金負債合計 635
繰延税金資産の純額 3,074	繰延税金資産の純額 2,694
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 0.2%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.6%
タックスヘイブン税制 1.8%	タックスヘイブン税制 2.6%
外国税額控除 0.2%	外国税額控除 0.6%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.3%
その他 0.4%	その他 1.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.3%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.1%

## セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等  役員の兼任	資金の借入 (*1)	3,000	短期借 入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	2	未払費 用	-

(イ) 子会社等  
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売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(*2)	37,482	未払手数料	6,691

(エ) 役員及び個人主要株主等  
該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
							資金の借入 (*1)	3,000		

親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等	資金の返済	3,000	短期借入金	-
						役員の兼任	借入金利息 の支払	1	未払費用	-

(イ) 子会社等  
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売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(*2)	34,646	未払手数料	6,410

(エ) 役員及び個人主要株主等  
該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

### 1株当たり情報

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,714円33銭	1株当たり純資産額	16,882円89銭
1株当たり当期純利益	4,822円68銭	1株当たり当期純利益	4,984円30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 24,840百万円	損益計算書上の当期純利益 25,672百万円
普通株式に係る当期純利益 24,840百万円	普通株式に係る当期純利益 25,672百万円
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

## 中間財務諸表

## 中間貸借対照表

		2019年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,212
金銭の信託		42,268
有価証券		5,800
未収委託者報酬		25,161
未収運用受託報酬		4,788
その他		957
貸倒引当金		15
流動資産計		81,173
固定資産		
有形固定資産	1	679
無形固定資産		5,940
ソフトウェア		5,939
その他		0
投資その他の資産		17,485
投資有価証券		1,362
関係会社株式		12,869
前払年金費用		1,736
繰延税金資産		2,096
その他		420
投資損失引当金		999
固定資産計		24,105
資産合計		105,278

		2019年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		11,888
未払収益分配金		0
未払償還金		25
未払手数料		7,472
関係会社未払金		3,649
その他未払金	2	739
未払費用		9,291
未払法人税等		1,661
賞与引当金		2,294
その他		181

流動負債計		25,317
固定負債		
退職給付引当金		3,267
時効後支払損引当金		565
固定負債計		3,832
負債合計		29,150
(純資産の部)		
株主資本		76,122
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		45,212
利益準備金		685
その他利益剰余金		44,527
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,920
評価・換算差額等		6
その他有価証券評価差額金		6
純資産合計		76,128
負債・純資産合計		105,278

## 中間損益計算書

		自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		58,947
運用受託報酬		8,401
その他営業収益		158
営業収益計		67,507
営業費用		
支払手数料		20,298
調査費		13,552
その他営業費用		3,856
営業費用計		37,706
一般管理費	1	14,394
営業利益		15,406
営業外収益	2	5,561
営業外費用	3	27
経常利益		20,940
特別利益	4	44
特別損失	5	410
税引前中間純利益		20,574

法人税、住民税及び事業税		5,116
法人税等調整額		610
中間純利益		14,847

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	30,723	56,014	86,924
当中間期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
中間純利益							14,847	14,847	14,847
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	10,802	10,802	10,802
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	19,920	45,212	76,122

(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
当中間期変動額			
剰余金の配当			25,650
中間純利益			14,847
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	27	27	27
当中間期変動額合計	27	27	10,830
当中間期末残高	6	6	76,128

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。  (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業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業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 (5) 投資損失引当金 子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。
5 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
6 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

2019年9月30日現在

1 有形固定資産の減価償却累計額	3,881百万円
2 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

## 中間損益計算書関係

		自 2019年4月 1日	至 2019年9月30日
1 減価償却実施額			
有形固定資産	38百万円		
無形固定資産	1,145百万円		
2 営業外収益のうち主要なもの			
受取配当金	4,936百万円		
金銭信託運用益	433百万円		
3 営業外費用のうち主要なもの			
時効後支払損引当金繰入	10百万円		
為替差損	6百万円		
4 特別利益の内訳			
投資有価証券等売却益	1百万円		
株式報酬受入益	43百万円		
5 特別損失の内訳			
投資有価証券等評価損	119百万円		
投資損失引当金繰入額	291百万円		

## 中間株主資本等変動計算書関係

					自 2019年4月 1日	至 2019年9月30日
1 発行済株式に関する事項						
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株	
2 配当に関する事項						
	配当金支払額					
	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					
	(1) 配当金の総額			25,650百万円		
	(2) 1株当たり配当額			4,980円		
	(3) 基準日			2019年3月31日		
	(4) 効力発生日			2019年6月28日		

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,212	2,212	-
(2)金銭の信託	42,268	42,268	-
(3)未収委託者報酬	25,161	25,161	-
(4)未収運用受託報酬	4,788	4,788	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
其他有価証券	5,800	5,800	-
資産計	80,231	80,231	-
(6)未払金	11,888	11,888	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,472	7,472	-
関係会社未払金	3,649	3,649	-
その他未払金	739	739	-
(7)未払費用	9,291	9,291	-
(8)未払法人税等	1,661	1,661	-
負債計	22,841	22,841	-

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

    其他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等(中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,362百万円、関係会社株式12,869百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

#### 有価証券関係

当中間会計期間末(2019年9月30日)

##### 1. 満期保有目的の債券(2019年9月30日)

該当事項はありません。

##### 2. 子会社株式及び関連会社株式(2019年9月30日)

該当事項はありません。

##### 3. その他有価証券(2019年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	5,800	5,800	-
小計	5,800	5,800	-
合計	5,800	5,800	-

#### セグメント情報等

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

##### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

##### 2. 関連情報

###### (1) 製品・サービスごとの情報

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

###### (2) 地域ごとの情報

###### 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

		自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
1 株当たり純資産額		14,780円24銭
1 株当たり中間純利益		2,882円67銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
	中間純利益	14,847百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	14,847百万円
	期中平均株式数	5,150千株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

## (1) 受託者

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

\* 2020年2月末現在

## (2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
いちよし証券株式会社	14,577百万円	「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。
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
九州 F G 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社証券ジャパン	3,000百万円	
セントレード証券株式会社	450百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	

ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸八証券株式会社	3,751百万円	
めぶき証券株式会社	3,000百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
北洋証券株式会社	500百万円	
野村證券株式会社 <sup>2</sup>	10,000百万円	
株式会社あおぞら銀行	100,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562百万円	
株式会社阿波銀行	23,452百万円	
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社北九州銀行	10,000百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社静岡銀行	90,845百万円	
株式会社十八銀行	24,404百万円	
株式会社親和銀行	36,878百万円	
株式会社第三銀行	37,461百万円	
株式会社千葉興業銀行	62,120百万円	
株式会社中京銀行	31,844百万円	
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社長崎銀行	6,121百万円	
株式会社長野銀行	13,000百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社豊和銀行	12,400百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
労働金庫連合会	120,000百万円 <sup>1</sup>	労働金庫法に基づき労働金庫の事業を営んでいます。
近畿産業信用組合	27,528百万円 <sup>1</sup>	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

\* 2020年2月末現在

- 労働金庫連合会および近畿産業信用組合の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。
- 野村證券株式会社は、新規の募集・販売は行ないません。

## (3) 投資顧問会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)	4,744,391	英国の1986年金融サービス業法に基づき英国金融サービス庁に登録された当該法律の定める範囲内で行う投資顧問業およびそれに付随する一切の業務を営んでいます。

<p>NOMURA ASSET MANAGEMENT U.S.A. INC. (ノムラ・アセット・マネジ メントU.S.A.インク)</p>	<p>US\$37,934,529</p>	<p>米国の1940年投資顧問法に基づき合衆 国証券取引委員会(SEC)に登録された当 該法律の定める範囲内で行う投資顧問業 およびそれに付随する一切の業務を営ん でいます。</p>
<p>CBRE Clarion Securities, LLC (シービーアールイー・クラリオ ン・セキュリティーズ・エルエ ルシー)</p>	<p>27,777,960米ドル<sup>**</sup></p>	<p>シービーアールイー・クラリオン・セ キュリティーズ・エルエルシーは、REIT を含む不動産証券の運用に特化している 米国籍の投資顧問会社です。</p>

\* 2019年9月末現在

\*\* 2018年12月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2020年4月3日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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	伊藤志保

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」に掲げられている世界三資産バランスファンドの2019年8月16日から2020年2月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

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、世界三資産バランスファンドの2020年2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特定期間の損益の状況をすべ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。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月5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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井 雄一郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 監査意見

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2019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すべ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。

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津村健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 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。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監

査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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