

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月24日提出
【計算期間】	第6期中(自 2020年12月29日至 2021年6月28日)
【ファンド名】	野村ターゲットデートファンド2016 2026－2028年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2029－2031年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2032－2034年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型
【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】	CEO兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【電話番号】	03-6387-5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1 【ファンドの運用状況】

以下は2021年7月30日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型

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	144,009,815	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	132,235	0.09
合計（純資産総額）		144,142,050	100.00

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型

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	54,445,813	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	51,619	0.09
合計（純資産総額）		54,497,432	100.00

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型

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	37,073,629	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	35,179	0.09
合計（純資産総額）		37,108,808	100.00

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型

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	27,838,796	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	26,496	0.09
合計（純資産総額）		27,865,292	100.00

（参考）国内株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	383,517,432,790	98.38

現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,299,796,344	1.61
合計（純資産総額）		389,817,229,134	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	6,286,500,000	1.61

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	743,430,065,675	69.66
	カナダ	36,659,396,831	3.43
	ドイツ	30,614,582,120	2.86
	イタリア	7,927,615,011	0.74
	フランス	36,496,329,080	3.42
	オランダ	15,354,949,997	1.43
	スペイン	7,857,128,396	0.73
	ベルギー	2,780,778,967	0.26
	オーストリア	649,097,972	0.06
	ルクセンブルグ	532,740,210	0.04
	フィンランド	3,625,056,251	0.33
	アイルランド	2,331,209,364	0.21
	ポルトガル	603,271,019	0.05
	イギリス	47,090,791,546	4.41
	スイス	32,539,003,048	3.04
	スウェーデン	12,765,284,608	1.19
	ノルウェー	2,011,417,970	0.18
	デンマーク	8,700,199,246	0.81
	オーストラリア	21,614,908,060	2.02
	ニュージーランド	766,038,328	0.07
	香港	9,230,594,631	0.86
	シンガポール	2,978,746,979	0.27
	イスラエル	1,119,329,998	0.10
	小計	1,027,678,535,307	96.30
投資証券	アメリカ	20,506,887,067	1.92
	カナダ	123,961,125	0.01
	フランス	517,800,848	0.04
	イギリス	626,795,360	0.05
	オーストラリア	1,470,621,035	0.13

	香港	443,181,224	0.04
	シンガポール	440,379,676	0.04
	小計	24,129,626,335	2.26
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	15,299,587,050	1.43
合計（純資産総額）		1,067,107,748,692	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,061,673,406	1.03
	買建	カナダ	533,144,876	0.04
	買建	ドイツ	1,583,829,022	0.14
	買建	イギリス	685,098,048	0.06
	買建	スイス	466,384,320	0.04
	買建	オーストラリア	340,851,174	0.03

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	6,464,182,330	9.48
	メキシコ	1,232,191,961	1.80
	ブラジル	3,583,257,801	5.25
	チリ	113,464,064	0.16
	コロンビア	40,509,987	0.05
	ギリシャ	116,314,708	0.17
	イギリス	66,142,788	0.09
	トルコ	168,405,157	0.24
	チェコ	68,060,069	0.09
	ハンガリー	155,945,729	0.22
	ポーランド	492,298,513	0.72
	香港	16,102,616,363	23.62
	マレーシア	828,471,054	1.21
	タイ	1,045,556,262	1.53
	フィリピン	389,086,752	0.57
	インドネシア	765,800,035	1.12
	韓国	8,868,710,471	13.00
	台湾	9,528,521,291	13.97
	インド	6,925,083,234	10.15
	パキスタン	12,348,030	0.01
	カタール	442,074,218	0.64

	エジプト	45,463,136	0.06
	南アフリカ	2,410,313,256	3.53
	アラブ首長国連邦	487,235,865	0.71
	クウェート	360,718,439	0.52
	サウジアラビア	2,008,738,935	2.94
	小計	62,721,510,448	92.00
新株予約権証券	タイ	0	0.00
投資信託受益証券	アメリカ	2,854,869,741	4.18
投資証券	メキシコ	27,748,107	0.04
	南アフリカ	33,186,690	0.04
	小計	60,934,797	0.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,532,511,733	3.71
合計（純資産総額）		68,169,826,719	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,217,844,748	3.25
	買建	シンガポール	236,681,352	0.34

（参考）国内債券NOMURA－B P I 総合 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	627,594,400,700	79.44
地方債証券	日本	52,880,412,912	6.69
特殊債券	日本	64,855,811,991	8.20
社債券	日本	33,654,822,950	4.26
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	10,998,210,832	1.39
合計（純資産総額）		789,983,659,385	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	36,949,536,944	43.72
	カナダ	1,669,503,861	1.97
	メキシコ	632,820,133	0.74
	ドイツ	5,767,599,959	6.82
	イタリア	8,311,366,200	9.83
	フランス	8,162,097,232	9.65

	オランダ	1,610,664,533	1.90
	スペイン	5,350,947,991	6.33
	ベルギー	1,940,828,622	2.29
	オーストリア	1,207,317,987	1.42
	フィンランド	498,549,914	0.58
	アイルランド	764,372,078	0.90
	イギリス	5,565,996,310	6.58
	スウェーデン	264,254,476	0.31
	ノルウェー	151,112,877	0.17
	デンマーク	430,252,233	0.50
	ポーランド	483,982,634	0.57
	オーストラリア	1,687,851,382	1.99
	シンガポール	680,745,181	0.80
	イスラエル	396,285,238	0.46
	小計	82,526,085,785	97.65
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,983,326,345	2.34
合計（純資産総額）		84,509,412,130	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	270,840,916,026	44.83
	カナダ	11,711,021,023	1.93
	メキシコ	4,259,602,751	0.70
	ドイツ	40,745,267,766	6.74
	イタリア	59,923,280,944	9.91
	フランス	58,527,334,023	9.68
	オランダ	10,148,483,838	1.67
	スペイン	38,377,042,853	6.35
	ベルギー	14,144,349,031	2.34
	オーストリア	8,693,786,093	1.43
	フィンランド	2,688,278,310	0.44
	アイルランド	8,125,542,620	1.34
	イギリス	39,576,449,940	6.55
	スウェーデン	1,759,202,577	0.29
	ノルウェー	1,438,627,006	0.23
	デンマーク	2,931,482,511	0.48
	ポーランド	3,647,336,318	0.60
	オーストラリア	12,226,572,273	2.02
	シンガポール	2,574,469,390	0.42
	マレーシア	2,764,345,966	0.45

	イスラエル	2,708,162,653	0.44
	小計	597,811,553,912	98.95
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,324,848,253	1.04
合計（純資産総額）		604,136,402,165	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	854,456,316	8.89
	ブラジル	796,081,807	8.29
	チリ	193,113,004	2.01
	コロンビア	413,011,543	4.30
	ペルー	191,302,292	1.99
	ウルグアイ	10,428,959	0.10
	ドミニカ共和国	17,498,891	0.18
	トルコ	180,754,533	1.88
	チェコ	385,656,568	4.01
	ハンガリー	360,133,772	3.75
	ポーランド	811,251,237	8.44
	ロシア	701,765,212	7.30
	ルーマニア	296,937,027	3.09
	マレーシア	704,527,686	7.33
	タイ	812,108,654	8.45
	フィリピン	25,739,378	0.26
	インドネシア	915,703,870	9.53
	南アフリカ	726,705,358	7.56
	中国	943,963,089	9.83
	小計	9,341,139,196	97.27
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	261,251,052	2.72
合計（純資産総額）		9,602,390,248	100.00

（２）【運用実績】

①【純資産の推移】

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型

2021年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間 (2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544

第2計算期間	(2017年12月26日)	87	87	1.1699	1.1699
第3計算期間	(2018年12月26日)	88	88	1.0553	1.0553
第4計算期間	(2019年12月26日)	114	114	1.1863	1.1863
第5計算期間	(2020年12月28日)	131	131	1.2347	1.2347
	2020年 7月末日	118	—	1.1579	—
	8月末日	121	—	1.1864	—
	9月末日	122	—	1.1818	—
	10月末日	122	—	1.1714	—
	11月末日	128	—	1.2249	—
	12月末日	131	—	1.2398	—
	2021年 1月末日	133	—	1.2469	—
	2月末日	135	—	1.2495	—
	3月末日	138	—	1.2744	—
	4月末日	139	—	1.2764	—
	5月末日	141	—	1.2847	—
	6月末日	143	—	1.2933	—
	7月末日	144	—	1.2897	—

野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型

2021年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
第2計算期間	(2017年12月26日)	21	21	1.1664	1.1664
第3計算期間	(2018年12月26日)	27	27	1.0377	1.0377
第4計算期間	(2019年12月26日)	40	40	1.1878	1.1878
第5計算期間	(2020年12月28日)	50	50	1.2467	1.2467
	2020年 7月末日	43	—	1.1452	—
	8月末日	46	—	1.1844	—
	9月末日	45	—	1.1770	—
	10月末日	45	—	1.1647	—
	11月末日	49	—	1.2335	—
	12月末日	50	—	1.2532	—
	2021年 1月末日	51	—	1.2648	—
	2月末日	52	—	1.2759	—
	3月末日	52	—	1.3089	—
	4月末日	53	—	1.3117	—
	5月末日	56	—	1.3222	—
	6月末日	54	—	1.3339	—
	7月末日	54	—	1.3245	—

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

2021年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
第2計算期間	(2017年12月26日)	15	15	1.1589	1.1589
第3計算期間	(2018年12月26日)	19	19	1.0320	1.0320
第4計算期間	(2019年12月26日)	28	28	1.1848	1.1848
第5計算期間	(2020年12月28日)	37	37	1.2479	1.2479
	2020年 7月末日	31	—	1.1359	—
	8月末日	32	—	1.1798	—
	9月末日	32	—	1.1710	—
	10月末日	32	—	1.1580	—
	11月末日	35	—	1.2334	—
	12月末日	37	—	1.2550	—
	2021年 1月末日	33	—	1.2692	—
	2月末日	34	—	1.2844	—
	3月末日	35	—	1.3211	—
	4月末日	36	—	1.3241	—
	5月末日	36	—	1.3357	—
	6月末日	37	—	1.3486	—
	7月末日	37	—	1.3361	—

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

2021年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
第2計算期間	(2017年12月26日)	10	10	1.1478	1.1478
第3計算期間	(2018年12月26日)	13	13	1.0248	1.0248
第4計算期間	(2019年12月26日)	18	18	1.1734	1.1734
第5計算期間	(2020年12月28日)	23	23	1.2457	1.2457
	2020年 7月末日	19	—	1.1277	—
	8月末日	20	—	1.1734	—
	9月末日	20	—	1.1638	—
	10月末日	20	—	1.1504	—
	11月末日	22	—	1.2300	—
	12月末日	23	—	1.2532	—

2021年 1月末日	23	—	1.2684	—
2月末日	24	—	1.2868	—
3月末日	26	—	1.3264	—
4月末日	26	—	1.3297	—
5月末日	27	—	1.3420	—
6月末日	27	—	1.3560	—
7月末日	27	—	1.3412	—

②【分配の推移】

野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円

③【収益率の推移】

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.4%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	11.0%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△9.8%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	12.4%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	4.1%
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	4.9%

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

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.9%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	5.0%
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	7.3%

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

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.7%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.7%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.8%

第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	5.3%
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	8.4%

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

野村ターゲットデットファンド2016 2035－2037年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.3%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△10.7%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	6.2%
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	9.2%

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

2【設定及び解約の実績】

野村ターゲットデートファンド2016 2026－2028年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	55,225,894	2,600,834	52,625,060
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	24,780,288	2,633,235	74,772,113
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	18,821,572	10,010,450	83,583,235
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	16,232,168	3,027,760	96,787,643
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	12,106,975	2,687,771	106,206,847
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	5,315,520	578,170	110,944,197

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029－2031年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	9,846,136	172	9,845,964
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	8,525,619	19,110	18,352,473
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	8,382,826	156,480	26,578,819
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	7,806,968	403,555	33,982,232
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	8,125,766	1,891,861	40,216,137
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	4,244,721	3,666,603	40,794,255

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032－2034年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,747,567	22	6,747,545
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	6,892,208	7,296	13,632,457
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	5,291,632	64,250	18,859,839
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	5,443,331	88,292	24,214,878
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	6,341,882	549,936	30,006,824
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	1,882,889	4,316,632	27,573,081

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,671,960	59,305	6,612,655

第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	2,418,017	29,744	9,000,928
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	4,410,696	625,991	12,785,633
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	3,370,205	55,192	16,100,646
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	3,607,259	1,199,279	18,508,626
第6期（中間期）	2020年12月29日～2021年 6月28日	2,015,598	79,239	20,444,985

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

野村ターゲットデットファンド2016	2026－2028年目標型
野村ターゲットデットファンド2016	2029－2031年目標型
野村ターゲットデットファンド2016	2032－2034年目標型
野村ターゲットデットファンド2016	2035－2037年目標型

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2020年12月29日から2021年6月28日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期中間計算期間末 (2021年 6月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	758,604	837,792
親投資信託受益証券	131,031,690	143,578,992
未収入金	-	28,443
流動資産合計	131,790,294	144,445,227
資産合計	131,790,294	144,445,227
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	34,322	37,911
未払委託者報酬	617,667	682,289
その他未払費用	1,992	2,207
流動負債合計	653,981	722,407
負債合計	653,981	722,407
純資産の部		
元本等		
元本	106,206,847	110,944,197
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	24,929,466	32,778,623
（分配準備積立金）	16,739,869	16,652,731
元本等合計	131,136,313	143,722,820
純資産合計	131,136,313	143,722,820
負債純資産合計	131,790,294	144,445,227

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	△2,314,700	7,296,912
営業収益合計	△2,314,700	7,296,912
営業費用		
支払利息	16	6
受託者報酬	31,024	37,911
委託者報酬	558,368	682,289
その他費用	1,799	2,207
営業費用合計	591,207	722,413
営業利益又は営業損失（△）	△2,905,907	6,574,499
経常利益又は経常損失（△）	△2,905,907	6,574,499
中間純利益又は中間純損失（△）	△2,905,907	6,574,499
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△64,606	13,994
期首剰余金又は期首欠損金（△）	18,032,693	24,929,466
剰余金増加額又は欠損金減少額	872,482	1,422,792
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	872,482	1,422,792
剰余金減少額又は欠損金増加額	347,224	134,140
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	347,224	134,140
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	15,716,650	32,778,623

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
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	当ファンドの中間計算期間は、2020年12月29日から2021年 6月28日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 106,206,847口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 110,944,197口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2347円 (10,000口当たり純資産額) (12,347円)	2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2955円 (10,000口当たり純資産額) (12,955円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。	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。 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）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日	
期首元本額	96,787,643円	期首元本額	106,206,847円
期中追加設定元本額	12,106,975円	期中追加設定元本額	5,315,520円
期中一部解約元本額	2,687,771円	期中一部解約元本額	578,170円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期中間計算期間末 (2021年 6月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	286,220	322,317
親投資信託受益証券	50,098,958	54,500,216
未収入金	-	9,695
流動資産合計	50,385,178	54,832,228
資産合計	50,385,178	54,832,228
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	12,944	14,561
未払委託者報酬	232,938	262,086
その他未払費用	733	795
流動負債合計	246,615	277,442
負債合計	246,615	277,442
純資産の部		
元本等		
元本	40,216,137	40,794,255
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	9,922,426	13,760,531
（分配準備積立金）	6,216,409	5,696,391
元本等合計	50,138,563	54,554,786
純資産合計	50,138,563	54,554,786
負債純資産合計	50,385,178	54,832,228

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1,192,283	3,965,152
営業収益合計	△1,192,283	3,965,152
営業費用		
支払利息	2	8
受託者報酬	11,018	14,561
委託者報酬	198,299	262,086
その他費用	590	795
営業費用合計	209,909	277,450
営業利益又は営業損失（△）	△1,402,192	3,687,702
経常利益又は経常損失（△）	△1,402,192	3,687,702
中間純利益又は中間純損失（△）	△1,402,192	3,687,702
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	7,464	222,026
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,380,861	9,922,426
剰余金増加額又は欠損金減少額	570,692	1,278,952
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	570,692	1,278,952
剰余金減少額又は欠損金増加額	174,151	906,523
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	174,151	906,523
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,367,746	13,760,531

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
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	当ファンドの中間計算期間は、2020年12月29日から2021年 6月28日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 40,216,137口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 40,794,255口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2467円 (10,000口当たり純資産額) (12,467円)	2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3373円 (10,000口当たり純資産額) (13,373円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。	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。 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）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日	
期首元本額	33,982,232円	期首元本額	40,216,137円
期中追加設定元本額	8,125,766円	期中追加設定元本額	4,244,721円
期中一部解約元本額	1,891,861円	期中一部解約元本額	3,666,603円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【野村ターゲットデットファンド2016 2032－2034年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期中間計算期間末 (2021年 6月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	206,984	216,814
親投資信託受益証券	37,417,180	37,262,608
未収入金	-	6,766
流動資産合計	37,624,164	37,486,188
資産合計	37,624,164	37,486,188
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	9,304	9,780
未払委託者報酬	167,549	175,950
その他未払費用	490	551
流動負債合計	177,343	186,281
負債合計	177,343	186,281
純資産の部		
元本等		
元本	30,006,824	27,573,081
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	7,439,997	9,726,826
（分配準備積立金）	4,677,082	4,019,599
元本等合計	37,446,821	37,299,907
純資産合計	37,446,821	37,299,907
負債純資産合計	37,624,164	37,486,188

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1,044,666	3,004,076
営業収益合計	△1,044,666	3,004,076
営業費用		
支払利息	-	13
受託者報酬	7,960	9,780
委託者報酬	143,287	175,950
その他費用	408	551
営業費用合計	151,655	186,294
営業利益又は営業損失（△）	△1,196,321	2,817,782
経常利益又は経常損失（△）	△1,196,321	2,817,782
中間純利益又は中間純損失（△）	△1,196,321	2,817,782
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△51,993	26,374
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,473,823	7,439,997
剰余金増加額又は欠損金減少額	432,158	550,363
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	432,158	550,363
剰余金減少額又は欠損金増加額	95,890	1,054,942
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	95,890	1,054,942
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,665,763	9,726,826

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
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	当ファンドの中間計算期間は、2020年12月29日から2021年 6月28日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 30,006,824口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 27,573,081口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2479円 (10,000口当たり純資産額) (12,479円)	2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3528円 (10,000口当たり純資産額) (13,528円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。	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。 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）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日	
期首元本額	24,214,878円	期首元本額	30,006,824円
期中追加設定元本額	6,341,882円	期中追加設定元本額	1,882,889円
期中一部解約元本額	549,936円	期中一部解約元本額	4,316,632円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期中間計算期間末 (2021年 6月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	128,894	159,722
親投資信託受益証券	23,038,068	27,790,633
未収入金	-	4,397
流動資産合計	23,166,962	27,954,752
資産合計	23,166,962	27,954,752
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,500
未払受託者報酬	5,829	7,074
未払委託者報酬	104,790	127,137
その他未払費用	269	381
流動負債合計	110,888	136,092
負債合計	110,888	136,092
純資産の部		
元本等		
元本	18,508,626	20,444,985
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,547,448	7,373,675
（分配準備積立金）	3,148,088	3,135,784
元本等合計	23,056,074	27,818,660
純資産合計	23,056,074	27,818,660
負債純資産合計	23,166,962	27,954,752

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	△686,052	2,363,342
営業収益合計	△686,052	2,363,342
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	5,047	7,074
委託者報酬	90,815	127,137
その他費用	230	381
営業費用合計	96,093	134,592
営業利益又は営業損失（△）	△782,145	2,228,750
経常利益又は経常損失（△）	△782,145	2,228,750
中間純利益又は中間純損失（△）	△782,145	2,228,750
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△120,155	6,584
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,791,490	4,547,448
剰余金増加額又は欠損金減少額	176,415	623,623
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	176,415	623,623
剰余金減少額又は欠損金増加額	149,932	19,562
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	149,932	19,562
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,155,983	7,373,675

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
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	当ファンドの中間計算期間は、2020年12月29日から2021年 6月28日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 18,508,626口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 20,444,985口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2457円 (10,000口当たり純資産額) (12,457円)	2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3607円 (10,000口当たり純資産額) (13,607円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期中間計算期間末 2021年 6月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。	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。 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）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期中間計算期間 自 2020年12月29日 至 2021年 6月28日	
期首元本額	16,100,646円	期首元本額	18,508,626円
期中追加設定元本額	3,607,259円	期中追加設定元本額	2,015,598円
期中一部解約元本額	1,199,279円	期中一部解約元本額	79,239円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（参考）

「野村ターゲットデートファンド2016」の各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOK USAマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「新興国債券（現地通貨建て）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。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 6月28日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,926,511,847
株式	388,840,219,060
派生商品評価勘定	32,052,365
未収配当金	1,129,711,360
未収利息	384,491
その他未収収益	11,921,559
差入委託証拠金	252,558,395
流動資産合計	401,193,359,077
資産合計	401,193,359,077
負債の部	
流動負債	

(2021年 6月28日現在)

派生商品評価勘定	1,264,405
未払解約金	98,648,183
未払利息	9,782
有価証券貸借取引受入金	4,974,361,398
流動負債合計	5,074,283,768
負債合計	5,074,283,768
純資産の部	
元本等	
元本	192,743,078,784
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	203,375,996,525
元本等合計	396,119,075,309
純資産合計	396,119,075,309
負債純資産合計	401,193,359,077

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 6月28日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0552円
(10,000口当たり純資産額)	(20,552円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	4,789,813,230円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
先物取引	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29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	233,420,305,440円
同期中における追加設定元本額	13,159,272,314円
同期中における一部解約元本額	53,836,498,970円
期末元本額	192,743,078,784円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	138,319,601円
バランスセレクト50	315,920,386円
バランスセレクト70	445,477,288円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,308,792,470円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,983,865,760円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,595,716,685円
野村資産設計ファンド2015	38,886,995円
野村資産設計ファンド2020	38,955,612円
野村資産設計ファンド2025	73,537,776円
野村資産設計ファンド2030	100,607,702円
野村資産設計ファンド2035	84,319,875円
野村資産設計ファンド2040	161,240,838円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	14,944,371,277円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,317,379,644円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,438,982,250円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,868,506,805円
野村資産設計ファンド2045	28,417,017円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,700,045,123円
マイ・ロード	3,242,367,142円
ネクストコア	35,817,117円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,354,476,551円

野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）	2,373,325,670円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,386,324,750円
野村資産設計ファンド2050	39,294,918円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	12,948,651円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,615,146円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,137,557円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	4,167,835円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	327,502,531円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	394,632,035円
インデックス・ブレンド（タイプI）	3,393,388円
インデックス・ブレンド（タイプII）	3,780,527円
インデックス・ブレンド（タイプIII）	17,101,849円
インデックス・ブレンド（タイプIV）	5,544,903円
インデックス・ブレンド（タイプV）	23,501,597円
野村6資産均等バランス	2,033,142,958円
世界6資産分散ファンド	78,562,862円
野村資産設計ファンド2060	19,244,039円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	922,236,290円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	314,281,639円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	149,766,905円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	500,416,296円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	515,689,049円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	3,401,770円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	7,764,608円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	1,678,670円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,416,981,072円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	6,796,434円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	67,325,091円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	66,493,208円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	23,149,193円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	94,757,471円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	206,140,306円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	4,280,639,982円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	56,794,207円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	386,766,694円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	1,626,339,443円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	176,681,163円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	649,444,619円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	2,430,024円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	5,734,269円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	27,007,432円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	33,849,601円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	119,017,380円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	8,954,381,203円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	24,304,003,140円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	27,684,890,030円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX（確定拠出年金向け）	33,012,366,804円

マイバランスDC30	3,161,992,255円
マイバランスDC50	5,313,251,964円
マイバランスDC70	5,341,340,396円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,136,766,616円
野村DC運用戦略ファンド	747,971,653円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	65,580,797円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,193,574,398円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	949,060,101円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	823,116,885円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	9,502,231円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,357,660円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	70,657,734円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	19,727,916円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	17,246,302円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	14,175,484円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	424,389,263円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	345,853,810円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	213,785,787円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	274,331,499円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	8,635,216円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	40,251,049円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	60,645円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 6月28日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	8,568,445,633
コール・ローン	1,007,434,388
株式	998,860,341,254
投資証券	23,440,991,818
派生商品評価勘定	121,295,002
未収入金	13,337,910
未収配当金	844,987,257
差入委託証拠金	6,937,798,931
流動資産合計	1,039,794,632,193
資産合計	1,039,794,632,193
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,674,766
未払解約金	312,243,736
未払利息	901
その他未払費用	3,246,000
流動負債合計	334,165,403
負債合計	334,165,403
純資産の部	

(2021年 6月28日現在)

元本等	
元本	252,495,401,055
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	786,965,065,735
元本等合計	1,039,460,466,790
純資産合計	1,039,460,466,790
負債純資産合計	1,039,794,632,193

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。 投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 6月28日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4.1168円

(10,000口当たり純資産額)

(41,168円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
先物取引	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
為替予約取引	
1）計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。	
①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。	
②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の	
仲値をもとに計算したレートを用いております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物	
相場の仲値を用いております。	
2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しており	
ます。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29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	238,838,088,958円
同期中における追加設定元本額	30,469,308,946円
同期中における一部解約元本額	16,811,996,849円
期末元本額	252,495,401,055円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	34,817,870円
バランスセレクト50	106,872,627円
バランスセレクト70	125,090,467円
野村外国株式インデックスファンド	490,224,064円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,469,521,763円

野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,483,983,449円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,804,642,687円
野村資産設計ファンド2015	11,102,258円
野村資産設計ファンド2020	11,122,176円
野村資産設計ファンド2025	21,118,179円
野村資産設計ファンド2030	28,976,356円
野村資産設計ファンド2035	24,214,848円
野村資産設計ファンド2040	46,519,948円
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	48,731,783,086円
のむラップ・ファンド（保守型）	790,604,743円
のむラップ・ファンド（普通型）	7,603,009,823円
のむラップ・ファンド（積極型）	6,409,193,999円
野村資産設計ファンド2045	8,161,110円
野村インデックスファンド・外国株式	5,621,608,185円
マイ・ロード	1,002,174,546円
ネクストコア	22,720,947円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	128,958,125円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,764,105,506円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	586,289,204円
野村資産設計ファンド2050	11,325,519円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,721,570円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,904,996円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,483,641円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,200,785円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	182,704,407円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	521,996,177円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,328,711円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,794,942円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	19,790,794円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	7,255,261円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	31,914,510円
野村6資産均等バランス	1,018,430,506円
野村つみたて外国株投信	7,821,836,163円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	4,625,591,169円
世界6資産分散ファンド	39,351,600円
野村資産設計ファンド2060	5,535,894円
野村スリーゼロ先進国株式投信	271,496,244円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	2,710,251,748円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	2,554,547,988円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	157,428,181円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	75,020,391円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	753,708,446円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,294,574,049円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	1,703,794円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	4,752,964円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	1,849,764円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	1,361,867円

野村ワールド・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	22,481,614円
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	8,605,873円
野村世界インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	8,695,521円
野村グローバル・インデックス・バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	31,642,228円
野村グローバル・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	103,246,846円
野村グローバル・インデックス・バランス７５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,450,417,166円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	28,676,815円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	201,870,164円
野村ＦｏＦｓ用・外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩインデックスファンド（適格機関投資家専用）	12,222,526,532円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	1,217,124円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	1,426,736円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	8,976,294円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	9,426,259円
野村外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（確定拠出年金向け）	77,594,382,062円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	2,260,123,335円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	8,192,129,516円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	7,749,943,066円
マイバランスＤＣ３０	798,946,219円
マイバランスＤＣ５０	1,785,393,013円
マイバランスＤＣ７０	1,494,594,765円
野村ＤＣ外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ	28,196,355,837円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	475,969,467円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	38,948,377円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	344,929,922円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	285,607,245円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	259,909,555円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	14,278,808円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	6,548,166円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	35,393,457円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	5,682,149円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	4,976,020円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	4,085,637円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	141,721,432円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	104,036,363円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	59,493,549円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	76,342,527円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	2,484,075円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	11,201,300円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	37,974円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 6月28日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,219,382,963
コール・ローン	79,671,758
株式	65,462,276,378
投資信託受益証券	2,919,163,501
投資証券	59,880,255
派生商品評価勘定	28,812,054
未収入金	2,160,445
未収配当金	179,174,513
差入委託証拠金	885,854,116
流動資産合計	71,836,375,983
資産合計	71,836,375,983
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,690
未払金	71,184,739
未払解約金	2,728,868
未払利息	71
その他未払費用	2,212,200
流動負債合計	76,183,568
負債合計	76,183,568
純資産の部	
元本等	
元本	41,564,738,965
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,195,453,450
元本等合計	71,760,192,415
純資産合計	71,760,192,415
負債純資産合計	71,836,375,983

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。 投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。 投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引
-------------------	--

	計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月28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	1.7265円
(10,000口当たり純資産額)	(17,265円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

先物取引

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29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	36,764,031,794円
同期中における追加設定元本額	6,464,076,652円
同期中における一部解約元本額	1,663,369,481円
期末元本額	41,564,738,965円
期末元本額の内訳※	
野村資産設計ファンド2015	19,961,060円
野村資産設計ファンド2020	20,003,519円
野村資産設計ファンド2025	37,481,402円
野村資産設計ファンド2030	51,061,883円
野村資産設計ファンド2035	42,964,352円
野村資産設計ファンド2040	81,674,375円
野村資産設計ファンド2045	14,480,135円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,426,455,166円
ネクストコア	22,876,377円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	307,461,369円
野村資産設計ファンド2050	19,926,803円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	6,675,843円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	3,358,438円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,598,381円

野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	2,114,648円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,125,711円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,342,751円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	7,187,004円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,908,162円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	14,068,571円
野村つみたて外国株投信	2,981,264,445円
野村外国株（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	996,843,550円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	1,763,027,813円
世界6資産分散ファンド	93,816,668円
野村資産設計ファンド2060	9,784,080円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・マーケット・インデックス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	695,303,895円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,298,262,499円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	6,913,551円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式（適格機関投資家専用）	349,389,176円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	725,531円
野村新興国株式インデックスファンド（確定拠出年金向け）	28,743,684,915円
野村DC運用戦略ファンド	471,983,560円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	37,670,048円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	10,013,264円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	8,733,075円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	7,188,513円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	4,390,324円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	18,108円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 6月28日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,191,485,758
国債証券	626,468,204,100
地方債証券	54,082,381,612
特殊債証券	64,904,388,769
社債証券	32,159,704,150
未収利息	1,004,163,805
前払費用	18,634,195
流動資産合計	782,828,962,389
資産合計	782,828,962,389
負債の部	
流動負債	
未払解約金	287,604,793
未払利息	3,752
流動負債合計	287,608,545

(2021年 6月28日現在)

負債合計	287,608,545
純資産の部	
元本等	
元本	588,738,897,689
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	193,802,456,155
元本等合計	782,541,353,844
純資産合計	782,541,353,844
負債純資産合計	782,828,962,389

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 6月28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	1.3292円
(10,000口当たり純資産額)	(13,292円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29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	532,981,539,158円
同期中における追加設定元本額	84,735,128,634円
同期中における一部解約元本額	28,977,770,103円
期末元本額	588,738,897,689円
期末元本額の内訳※	
野村国内債券インデックスファンド	411,637,399円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	41,951,901,221円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,072,772,895円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,285,919,087円
野村資産設計ファンド2015	353,263,799円
野村資産設計ファンド2020	353,898,555円
野村資産設計ファンド2025	334,021,365円
野村資産設計ファンド2030	266,577,174円
野村資産設計ファンド2035	141,854,272円
野村資産設計ファンド2040	195,305,261円
野村日本債券インデックスファンド	887,527,273円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	166,534,797,134円
のむラップ・ファンド（保守型）	13,631,449,194円
のむラップ・ファンド（普通型）	12,426,860,655円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,741,435,955円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,514,914,268円
野村資産設計ファンド2045	21,514,657円
野村円債投資インデックスファンド	843,519,257円
野村インデックスファンド・国内債券	2,268,054,184円
マイ・ロード	33,957,252,775円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,367,305,826円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	18,034,741,468円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,698,713,646円
野村資産設計ファンド2050	22,884,884円
野村ターゲットデートファンド2016 2026－2028年目標型	26,785,452円
野村ターゲットデートファンド2016 2029－2031年目標型	7,218,517円
野村ターゲットデートファンド2016 2032－2034年目標型	3,986,562円
野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型	2,454,265円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	1,029,155,036円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	336,879,598円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	51,824,794円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	27,672,643円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	75,076,773円

2021年 6月28日現在	
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	12,885,817円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	9,649,140円
野村6資産均等バランス	3,078,602,476円
世界6資産分散ファンド	118,952,505円
野村資産設計ファンド2060	8,325,569円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA－BPI総合連動型上場投信	17,585,120,389円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	21,875,584,580円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	571,065,346円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	90,711,306円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,894,208,711円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,171,288,754円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	18,884,847円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	10,449,706円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	1,016,629円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,659,413,091円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	8,232,983円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	67,960,509円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	70,097,564円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	382,596,349円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	312,093,107円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	925,919,518円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	173,349,510円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	775,548,175円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	325,737,364円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2％コース向け）（適格機関投資家専用）	14,718,088円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	37,808,968,502円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	49,765,347,998円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	18,933,770,847円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA－BPI総合（確定拠出年金向け）	50,511,091,748円
マイバランスDC30	13,382,128,927円
マイバランスDC50	10,911,090,880円
マイバランスDC70	3,661,060,474円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA－BPI総合	13,030,705,045円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,064,407,067円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	2,590,078,744円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,196,372,913円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	172,648,559円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	26,391,827円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	30,568,559円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	52,276,318円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	20,891,611円

2021年 6月28日現在	
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	8,255,634円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	775,213,206円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	396,531,807円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	143,874,106円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	184,619,504円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	3,735,868円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	27,088,353円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	191,315円

※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 6月28日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	92,027,718
コール・ローン	488,527,632
国債証券	80,955,591,825
派生商品評価勘定	608,931,770
未収入金	1,454,484
未収利息	471,143,110
前払費用	36,918,321
差入委託証拠金	2,145,032
流動資産合計	82,656,739,892
資産合計	82,656,739,892
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	278,220,079
未払解約金	31,567,571
未払利息	437
その他未払費用	534,500
流動負債合計	310,322,587
負債合計	310,322,587
純資産の部	
元本等	
元本	67,901,001,734
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,445,415,571
元本等合計	82,346,417,305
純資産合計	82,346,417,305
負債純資産合計	82,656,739,892

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
-------------------	------

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月28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	1.2127円
(10,000口当たり純資産額)	(12,127円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29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	62,722,104,478円
同期中における追加設定元本額	12,246,517,267円
同期中における一部解約元本額	7,067,620,011円
期末元本額	67,901,001,734円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,498,575,776円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	937,265,154円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	29,357,019円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	7,911,539円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	4,369,295円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	2,689,717円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	12,198,734,283円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	6,754,034円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,725,338円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	10,089,600円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,815,546円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	5,268,099円
野村外国債券インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	32,428,788,537円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	8,056,937,549円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	4,017,767,552円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	560,910,531円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	2,081,073,870円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	6,047,758,615円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	209,680円

※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 6月28日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	474,389,703
コール・ローン	426,798,605
国債証券	584,843,250,400
未収利息	5,062,096,096
前払費用	254,666,081
その他未収収益	11,032,486
流動資産合計	591,072,233,371
資産合計	591,072,233,371
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	543,661
未払金	561,953,988
未払解約金	215,994,050
未払利息	382
その他未払費用	5,031,996
流動負債合計	783,524,077
負債合計	783,524,077
純資産の部	
元本等	
元本	232,381,378,877
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	357,907,330,417
元本等合計	590,288,709,294
純資産合計	590,288,709,294
負債純資産合計	591,072,233,371

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。
-----------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月28日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.5402円
(10,000口当たり純資産額)	(25,402円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	194,776,964,652円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	204,529,900,952円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
為替予約取引	
1）計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。	
①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。	
②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。	
2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29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	234,759,829,540円
同期中における追加設定元本額	18,267,753,690円
同期中における一部解約元本額	20,646,204,353円
期末元本額	232,381,378,877円
期末元本額の内訳※	
バランスセレクト30	83,487,503円
バランスセレクト50	83,894,400円
バランスセレクト70	79,199,142円
野村外国債券インデックスファンド	277,030,910円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,649,240,715円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,581,254,432円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,715,160,067円
野村資産設計ファンド2015	19,977,394円
野村資産設計ファンド2020	20,012,338円
野村資産設計ファンド2025	37,583,806円
野村資産設計ファンド2030	38,563,530円
野村資産設計ファンド2035	28,729,214円
野村資産設計ファンド2040	49,443,008円
野村外国債券インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	74,390,918,212円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,756,755,174円
のむラップ・ファンド（普通型）	15,097,629,095円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,488,414,267円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	520,286,648円
野村資産設計ファンド2045	7,261,340円
野村インデックスファンド・外国債券	874,635,706円
マイ・ロード	8,963,121,098円
ネクストコア	207,691,753円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	203,457,152円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	8,444,268,316円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,354,089,820円
野村資産設計ファンド2050	7,739,728円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,809,052円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,053,061円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,401,554円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,044,115円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	623,808,356円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	535,220,539円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,994,864円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,423,461円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	6,191,254円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,350,185円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,761,854円
野村6資産均等バランス	1,606,776,958円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	6,173,741,280円
世界6資産分散ファンド	62,089,941円
野村資産設計ファンド2060	2,824,420円

NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	6,211,968,766円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	3,070,564,323円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	6,369,295円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,192,154,680円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	189,360,715円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,384,214,702円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,018,861,897円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,688,192円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,181,138円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	530,616円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,183,806,863円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	9,669,890円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	53,194,028円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	13,719,951円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	174,740,858円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	162,888,988円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	1,932,850,998円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	90,545,863円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,368,981,930円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	1,067,889,781円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	5,761,286円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,426,652円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,227,874円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	6,021,135円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	558,210,353円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,370,490,626円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	6,471,179,415円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	4,910,548,890円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	18,401,784,451円
マイバランスDC30	1,904,099,400円
マイバランスDC50	1,427,612,500円
マイバランスDC70	952,370,580円
野村DC外国債券インデックスファンド	7,268,030,993円
野村DC運用戦略ファンド	4,296,569,976円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	542,929,716円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	224,480,684円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	354,667,679円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	178,934,874円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	15,019,640円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	34,439,533円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	15,954,363円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	7,561,547円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	5,288,293円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,792,077円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	101,154,096円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	69,223,471円

マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	37,545,181円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	48,178,187円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,267,379円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	7,068,921円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	19,969円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 6月28日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	95,462,394
コール・ローン	27,507,612
国債証券	9,269,894,341
未収利息	105,840,751
前払費用	10,312,978
流動資産合計	9,509,018,076
資産合計	9,509,018,076
負債の部	
流動負債	
未払解約金	24,142,117
未払利息	24
その他未払費用	473,500
流動負債合計	24,615,641
負債合計	24,615,641
純資産の部	
元本等	
元本	6,600,932,323
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,883,470,112
元本等合計	9,484,402,435
純資産合計	9,484,402,435
負債純資産合計	9,509,018,076

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.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。
-----------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

2021年 6月28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	1,4368円
(10,000口当たり純資産額)	(14,368円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 6月28日現在	
期首	2020年12月29日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	6,443,256,508円
同期中における追加設定元本額	1,036,522,677円
同期中における一部解約元本額	878,846,862円
期末元本額	6,600,932,323円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド2015	19,076,981円
野村資産設計ファンド2020	19,112,397円
野村資産設計ファンド2025	36,420,269円
野村資産設計ファンド2030	37,370,103円
野村資産設計ファンド2035	27,840,035円
野村資産設計ファンド2040	47,914,624円
野村資産設計ファンド2045	7,039,159円
野村インデックスファンド・新興国債券	761,924,318円

2021年 6月28日現在	
ネクストコア	42,131,335円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	360,971,438円
野村資産設計ファンド2050	7,459,217円
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	4,662,927円
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,990,241円
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,358,669円
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,012,167円
世界6資産分散ファンド	110,119,366円
野村資産設計ファンド2060	2,698,260円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）	3,668,759,651円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	851,800円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	86,603,437円
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	383,736,777円
野村DC運用戦略ファンド	870,317,558円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	85,203,276円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	7,330,181円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	5,126,484円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,690,884円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,210,769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

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

2021年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

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

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	994	37,262,236
単位型株式投資信託	195	817,802
追加型公社債投資信託	14	6,310,987
単位型公社債投資信託	503	1,626,966
合計	1,706	46,017,992

（３）【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

5【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			2,626		4,281
金銭の信託			41,524		35,912
有価証券			24,399		30,400
前払費用			106		167
未収入金			522		632
未収委託者報酬			23,936		24,499
未収運用受託報酬			4,336		4,347
その他			71		268
貸倒引当金			△14		△14
流動資産計			97,509		100,496
固定資産					
有形固定資産			645		2,666
建物	※ 2	295		1,935	
器具備品	※ 2	349		731	
無形固定資産			5,894		5,429
ソフトウェア		5,893		5,428	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,486		16,487
投資有価証券		1,437		1,767	
関係会社株式		10,171		9,942	
従業員長期貸付金		16		-	
長期差入保証金		329		330	
長期前払費用		19		15	
前払年金費用		1,545		1,301	
繰延税金資産		2,738		3,008	
その他		229		122	
貸倒引当金		△0		-	

固定資産計			23,026		24,583
資産合計			120,536		125,080

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			157		123
未払金			15,279		16,948
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		3		8	
未払手数料		6,948		7,256	
関係会社未払金		7,262		8,671	
その他未払金		1,063		1,011	
未払費用	※ 1		10,290		9,171
未払法人税等			1,564		2,113
前受収益			26		22
賞与引当金			3,985		3,795
その他			67		-
流動負債計			31,371		32,175
固定負債					
退職給付引当金			3,311		3,299
時効後支払損引当金			572		580
資産除去債務			-		1,371
固定負債計			3,883		5,250
負債合計			35,254		37,425
(純資産の部)					
株主資本			85,270		87,596
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			54,360		56,686
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		53,675		56,001	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,069		31,395	
評価・換算差額等			10		57
その他有価証券評価差額金			10		57
純資産合計			85,281		87,654
負債・純資産合計			120,536		125,080

(2) 【損益計算書】

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)

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

		前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	※ 1	4,936		4,540	
受取利息		0		0	
金銭の信託運用益		-		1,698	
その他		309		447	
営業外収益計			5,246		6,687
営業外費用					
金銭の信託運用損		230		-	
投資事業組合等評価損		146		-	
時効後支払損引当金繰入額		18		13	

為替差損		23		26	
その他		23		32	
営業外費用計			443		72
経常利益			35,555		36,157
特別利益					
投資有価証券等売却益		21		71	
株式報酬受入益		59		48	
移転補償金		-		2,077	
特別利益計			81		2,197
特別損失					
投資有価証券等評価損		119		36	
関係会社株式評価損		1,591		582	
固定資産除却損	※ 2	67		105	
事務所移転費用		-		406	
特別損失計			1,778		1,129
税引前当期純利益			33,858		37,225
法人税、住民税及び事業税			9,896		11,239
法人税等調整額			△34		△290
当期純利益			23,996		26,276

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							△25,650	△25,650	△25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	△1,653	△1,653	△1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			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	利 益 準備金	その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							△23,950	△23,950	△23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			△23,950
当期純利益			26,276

株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 6年 附属設備 6～15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	(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。 (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。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ① 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。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。

5. 消費税等の会計処理方法 6. 連結納税制度の適用	(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。 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。 連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。
---	---

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び

「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

◇ 貸借対照表関係

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

◇ 損益計算書関係

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
※ 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円	※ 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円
※ 2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソ フ ト ウ エ 59 ア 合計 67	※ 2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソ フ ト ウ エ 102 ア 合計 105

◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

効力発生日

2021年6月30日

◇ 金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

し、その内容を経営に報告しております。

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

◇ 有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

◇ 退職給付関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	△138
退職給付の支払額	△858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	△393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	△666
年金資産の期末残高	17,413

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

及び前払年金費用の調整表

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

退職給付引当金	3,311
前払年金費用	△1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

◇ 税効果会計関係

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

◇ 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

ております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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

◇ セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

◇ 関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ 1株当たり情報

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

独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子
--------------------	-------	-------

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

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月6日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の2020年12月29日から2021年6月28日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の2021年6月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月29日から2021年6月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月6日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型の2020年12月29日から2021年6月28日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型の2021年6月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月29日から2021年6月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月6日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の2020年12月29日から2021年6月28日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の2021年6月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月29日から2021年6月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年8月6日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の2020年12月29日から2021年6月28日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の2021年6月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月29日から2021年6月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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