

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月8日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	野村世界R E I Tインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）
【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】	6,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2021年4月9日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

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

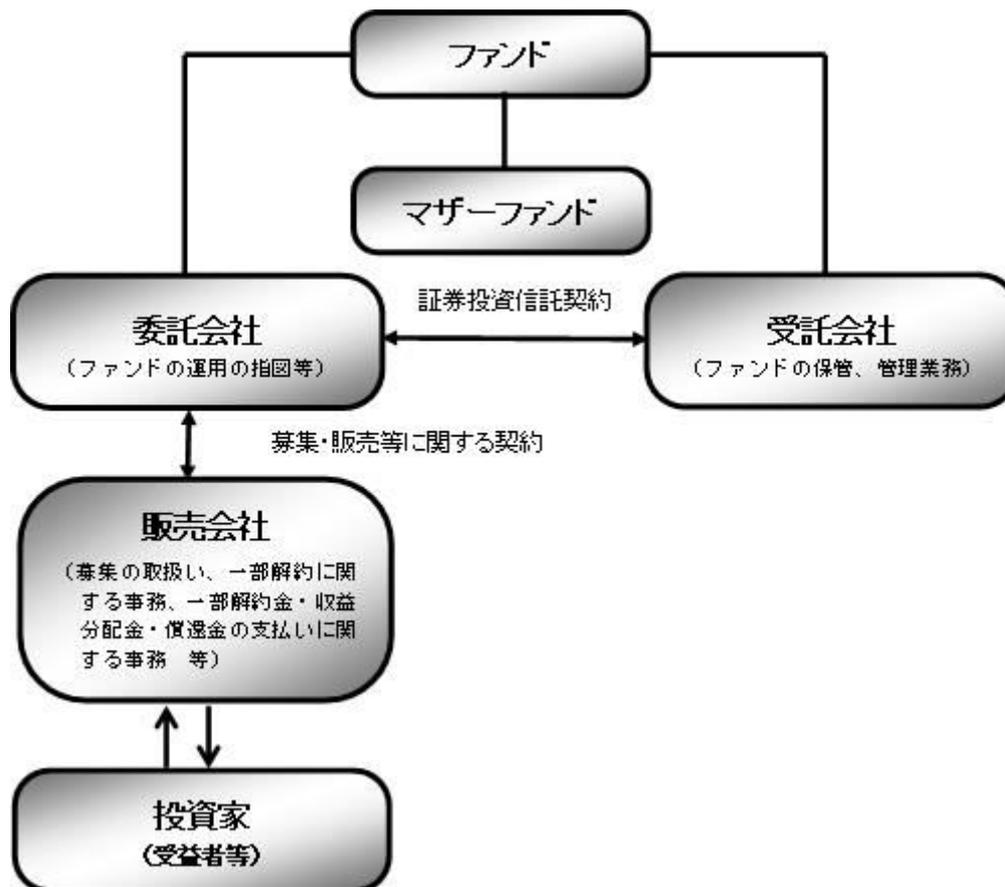
## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

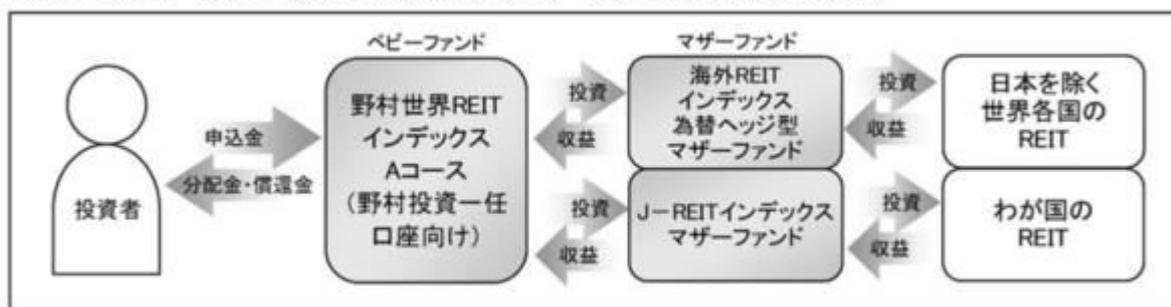
## (3) ファンドの仕組み

&lt;更新後&gt;



ファンド	野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）
マザーファンド (親投資信託)	海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

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



※各マザーファンドに代えて、ETFに直接投資する場合があります。

## &lt; 更新後 &gt;

委託会社の概況(2021年8月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村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1-13-1	5,150,693株	100%

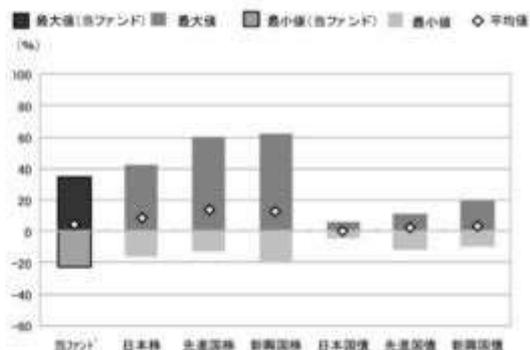
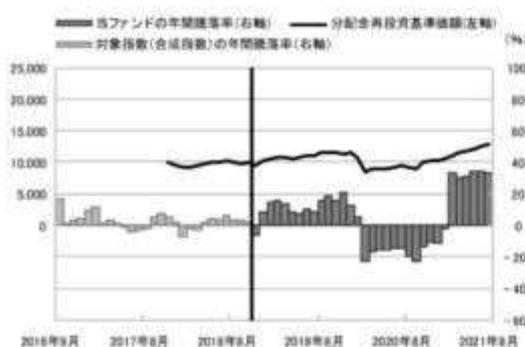
## 3 投資リスク

## &lt; 更新後 &gt;

## リスクの定量的比較

(2016年9月末～2021年8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〉 〈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(%)	34.4	42.1	59.8	62.7	6.2	11.4
最小値(%)	△ 23.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 11.4
平均値(%)	4.2	6.9	13.7	12.8	0.4	2.5

- 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。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- 年間騰落率は、2016 年 9 月から 2021 年 8 月の 5 年間の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、2018 年 11 月までは、対象指数(合成指数)の騰落率を表示しております。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2016 年 9 月から 2021 年 8 月の 5 年間の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象指数(合成指数)を用いて算出しております。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

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

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株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、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 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、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社の正確性、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 L.L.C.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 L.L.C.の知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income L.L.C.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)については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製品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan 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予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities L.L.C.(ここでは「JPM S.L.L.C.」)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)についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPM S.L.L.C.はNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JP S.L. JP Morgan Securities PLC、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4 手数料等及び税金

## (3) 信託報酬等

## &lt;更新後&gt;

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。

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

信託報酬率	年0.418%（税抜年0.38%）以内 （2021年9月末現在 年0.418%（税抜年0.38%））
-------	--

信託報酬率の配分は下記の通りとします。

支払先の配分（税抜）および役務の内容	
<委託会社> ファンドの運用とそれに伴う調査、 受託会社への指図、 法定書面等の作成、 基準価額の算出等	年0.30%以内 （2021年9月末現在年0.30%）
<販売会社> 購入後の情報提供、 運用報告書等各種書類の送付、 口座内でのファンドの管理 および事務手続き等	年0.05%
<受託会社> ファンドの財産の保管・管理、 委託会社からの指図の実行等	年0.03%

\* ファンドが実質的な投資対象とするREITは市場の需給により価格形成されるため、その費用は表示してありません。

\* ファンドがETFに投資する場合は、上記の信託報酬に加え、投資するETFに関連する費用がかかりますが投資するETFとその比率があらかじめ定まっていないため記載することができません。  
 なお、当該費用のうち委託会社が収受する分に関しては、信託報酬の調整を行いません。

## 信託報酬率の調整について

信託報酬率の調整は以下の計算方法をもって行いません。信託報酬率は毎月1回計算し、当月の第5営業日目以降で前日が営業日となる最初の営業日（「適用開始営業日」といいます。）から翌月の適用開始営業日の前日まで適用することとします。

信託報酬率=年0.38%（税抜）- 対象ETFの委託会社報酬率（税抜）×対象ETFの投資割合

なお、信託報酬率は、信託報酬率のうち委託会社が受取る部分がゼロとなる水準を下限値とし、年0.38%（税抜）以内の範囲で委託会社が定めるものとします。

- ・対象ETFは、ファンドが投資するETFのうち、ファンドの委託会社が設定したETFとし、各マザーファンドに代えて投資するものをいいます。
- ・対象ETFの委託会社報酬率は、原則として、目論見書その他公表資料で開示されている当該各月の前月最終営業日時点の対象ETFの信託報酬率（税抜の年率値）のうち、純資産総額に応じて一定の率で委託会社が受取る部分（税抜の年率値）をいいます。
- ・対象ETFの投資割合は、当該各月の前月における対象ETFの投資割合の平均値とします。
- ・複数の対象ETFに投資する場合の「対象ETFの委託会社報酬率（税抜）×対象ETFの投資割合」は、各対象ETFについて算出した「当該各対象ETFの委託会社報酬率（税抜）×当該各対象ETFの投資割合」を合計した値とします。

## (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。

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。

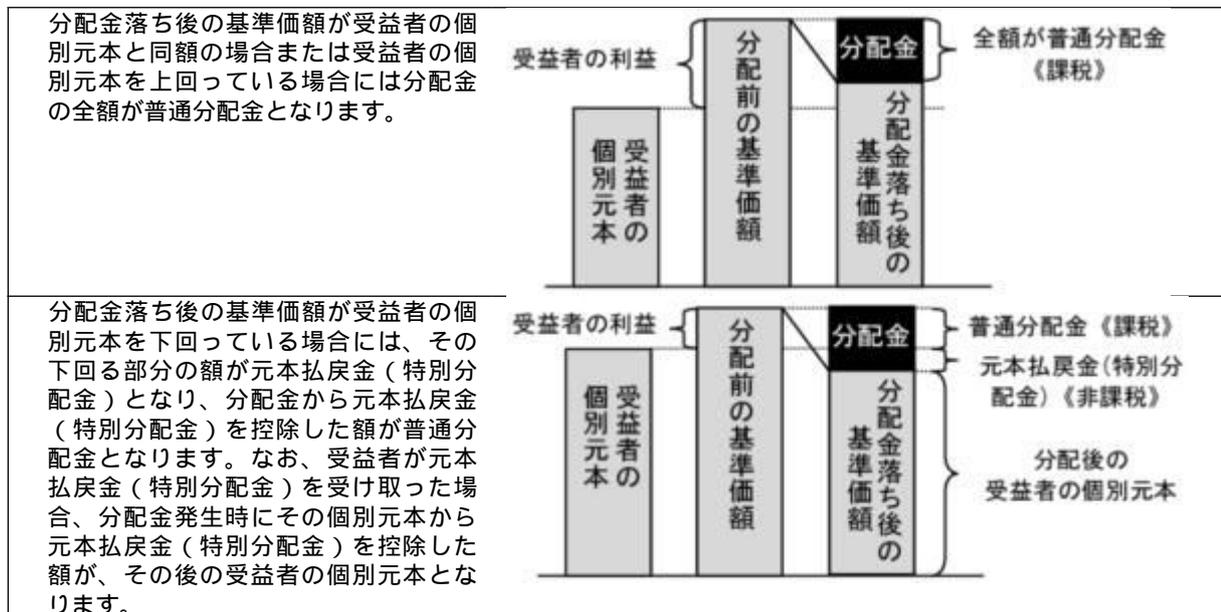
個別元本について

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（2021年8月末現在）が変更になる場合があります。

## 5 運用状況

以下は2021年8月31日現在の運用状況であります。

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

### (1) 投資状況

## 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

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	3,039,523,840	99.97
現金・預金・その他資産（負債控除後）		865,002	0.02
合計（純資産総額）		3,040,388,842	100.00

（参考）海外REITインデックス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（％）
投資証券	アメリカ	5,309,043,646	73.39
	カナダ	136,865,306	1.89
	ドイツ	19,963,312	0.27
	イタリア	1,311,685	0.01
	フランス	156,804,754	2.16
	オランダ	13,235,903	0.18
	スペイン	31,384,590	0.43
	ベルギー	100,124,700	1.38
	アイルランド	8,172,286	0.11
	シンガポール	3,745,966	0.05
	イギリス	417,959,660	5.77
	オーストラリア	479,032,671	6.62
	ニュージーランド	29,598,287	0.40
	香港	107,893,243	1.49
	シンガポール	232,255,343	3.21
	韓国	11,714,756	0.16
イスラエル	4,834,350	0.06	
	小計	7,063,940,458	97.65
現金・預金・その他資産（負債控除後）		169,283,534	2.34
合計（純資産総額）		7,233,223,992	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	171,435,208	2.37

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	45,101,544,100	97.22
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,286,476,967	2.77
合計（純資産総額）		46,388,021,067	100.00

## その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	1,281,514,000	2.76

## （２）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

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	海外REITインデックス為替 ヘッジ型マザーファンド	1,542,919,677	1.7812	2,748,398,841	1.7999	2,777,101,126	91.34
2	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マ ザーファンド	92,418,635	2.8096	259,662,537	2.8395	262,422,714	8.63

## 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	99.97
合計	99.97

## （参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	30,210	11,151.83	336,896,923	14,696.92	443,994,165	6.13
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,659	82,757.18	302,808,534	92,319.29	337,796,308	4.67
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	6,224	23,888.71	148,683,372	35,228.44	219,261,842	3.03
4	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,510	15,965.79	183,766,296	17,849.95	205,453,017	2.84
5	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,440	8,040.12	108,059,340	14,661.75	197,054,041	2.72
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	17,090	6,717.10	114,795,265	9,425.02	161,073,660	2.22
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,710	17,830.61	101,812,810	25,081.37	143,214,668	1.97

8	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	14,090	6,358.02	89,584,612	9,271.16	130,630,701	1.80
9	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,620	18,419.33	103,516,656	22,630.60	127,184,017	1.75
10	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	68,900	1,465.82	100,995,563	1,812.86	124,906,729	1.72
11	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	15,310	7,003.07	107,217,154	7,919.39	121,245,922	1.67
12	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,480	12,148.96	66,576,321	20,402.93	111,808,084	1.54
13	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	23,260	3,166.75	73,658,628	4,538.86	105,574,116	1.45
14	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,590	16,118.40	73,983,471	22,227.27	102,023,192	1.41
15	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,700	13,177.80	61,935,706	21,170.03	99,499,174	1.37
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,669	24,773.21	66,119,708	35,915.31	95,857,989	1.32
17	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	49,100	1,401.40	68,808,815	1,939.28	95,218,717	1.31
18	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	15,400	4,901.32	75,480,342	6,091.75	93,813,058	1.29
19	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	15,430	4,217.36	65,073,878	5,701.61	87,975,873	1.21
20	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,170	3,130.80	69,409,935	3,934.41	87,226,091	1.20
21	香港	投資証券	LINK REIT	85,400	897.84	76,675,786	1,015.21	86,699,318	1.19
22	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	21,700	2,581.55	56,019,657	3,379.42	73,333,523	1.01
23	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	5,850	9,673.05	56,587,368	12,305.50	71,987,193	0.99
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	11,980	3,869.57	46,357,557	5,875.25	70,385,543	0.97
25	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,940	10,315.21	40,641,943	16,352.02	64,426,963	0.89
26	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,840	7,144.59	48,869,057	9,230.50	63,136,627	0.87
27	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	7,170	7,653.43	54,875,136	8,563.40	61,399,635	0.84
28	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	11,640	3,298.09	38,389,873	5,131.23	59,727,529	0.82
29	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	24,300	1,436.39	34,904,350	2,399.11	58,298,543	0.80
30	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,580	5,147.39	28,722,470	9,678.76	54,007,507	0.74

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.65
合計	97.65

## (参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,372	728,794	3,186,287,990	715,000	3,125,980,000	6.73
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,858	686,951	2,650,258,362	681,000	2,627,298,000	5.66
3	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	12,493	188,186	2,351,015,121	199,700	2,494,852,100	5.37
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,111	355,714	2,173,770,170	396,500	2,423,011,500	5.22
5	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,474	182,625	2,278,066,737	169,700	2,116,837,800	4.56

6	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,463	115,388	2,245,813,861	106,900	2,080,594,700	4.48
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,588	326,695	1,825,573,546	325,500	1,818,894,000	3.92
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,686	213,728	1,642,721,040	196,100	1,507,224,600	3.24
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,857	367,601	1,417,840,647	374,500	1,444,446,500	3.11
10	日本	投資証券	ユニテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,684	161,042	1,398,497,000	155,600	1,351,230,400	2.91
11	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,476	206,010	1,128,111,605	221,200	1,211,291,200	2.61
12	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,346	92,768	1,052,547,486	94,000	1,066,524,000	2.29
13	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,535	449,250	1,138,848,874	411,500	1,043,152,500	2.24
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,193	807,678	963,559,889	808,000	963,944,000	2.07
15	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,434	589,599	845,485,835	652,000	934,968,000	2.01
16	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,722	181,044	854,889,789	192,000	906,624,000	1.95
17	日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,933	508,260	982,468,101	461,500	892,079,500	1.92
18	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,520	323,101	814,214,626	353,000	889,560,000	1.91
19	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,332	651,405	867,671,878	661,000	880,452,000	1.89
20	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,818	70,291	830,709,477	65,000	768,170,000	1.65
21	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,978	46,434	788,369,648	42,750	725,809,500	1.56
22	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,536	164,332	745,410,471	159,500	723,492,000	1.55
23	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,537	158,438	718,833,768	151,000	685,087,000	1.47
24	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	816	794,808	648,563,694	792,000	646,272,000	1.39
25	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,352	520,594	703,843,894	476,500	644,228,000	1.38
26	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,391	185,074	627,586,218	185,200	628,013,200	1.35
27	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,046	119,589	603,447,360	123,500	623,181,000	1.34

28	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人 投資証券	2,635	233,371	614,935,054	236,200	622,387,000	1.34
29	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投 資法人 投資証券	1,737	356,915	619,962,349	353,000	613,161,000	1.32
30	日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	3,484	166,126	578,785,272	159,300	555,001,200	1.19

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.22
合 計	97.22

## 投資不動産物件

野村世界 R E I T インデックス A コース (野村投資一任口座向け)

該当事項はありません。

(参考) 海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) J - R E I T インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

野村世界 R E I T インデックス A コース (野村投資一任口座向け)

該当事項はありません。

(参考) 海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2021年09月限)	買建	37	米ドル	1,522,820	167,357,918	1,559,920	171,435,208	2.37

(参考) J - R E I T インデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物 取引	大阪取引所	REIT指数先物(2021年09月限)	買建	598	日本円	1,277,418,170	1,281,514,000	2.76

### (3) 運用実績

#### 純資産の推移

#### 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

2021年8月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間	(2018年 1月17日)	112	112	0.9611	0.9611
第2特定期間	(2018年 7月17日)	1,718	1,720	0.9982	0.9997
第3特定期間	(2019年 1月17日)	2,172	2,174	0.9726	0.9736
第4特定期間	(2019年 7月17日)	2,303	2,306	1.0725	1.0740
第5特定期間	(2020年 1月17日)	2,261	2,265	1.1187	1.1207
第6特定期間	(2020年 7月17日)	2,109	2,114	0.8552	0.8572
第7特定期間	(2021年 1月18日)	2,341	2,346	0.9536	0.9556
第8特定期間	(2021年 7月19日)	3,001	3,010	1.1550	1.1585
	2020年 8月末日	2,195		0.9072	
	9月末日	2,098		0.8714	
	10月末日	2,027		0.8483	
	11月末日	2,338		0.9435	
	12月末日	2,344		0.9539	
	2021年 1月末日	2,370		0.9666	
	2月末日	2,605		0.9970	
	3月末日	2,691		1.0326	
	4月末日	2,847		1.0865	
	5月末日	2,771		1.0980	
	6月末日	2,898		1.1270	
	7月末日	3,041		1.1610	
	8月末日	3,040		1.1768	

#### 分配の推移

## 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	0.0000円
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	0.0081円
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	0.0075円
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	0.0090円
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	0.0115円
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	0.0120円
第7特定期間	2020年 7月18日～2021年 1月18日	0.0120円
第8特定期間	2021年 1月19日～2021年 7月19日	0.0160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

## 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	収益率
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	3.9%
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	4.7%
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	1.8%
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	11.2%
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	5.4%
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	22.5%
第7特定期間	2020年 7月18日～2021年 1月18日	12.9%
第8特定期間	2021年 1月19日～2021年 7月19日	22.8%

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

## 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	117,350,544		117,350,544
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	1,709,552,099	105,497,766	1,721,404,877
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	994,511,510	482,547,532	2,233,368,855
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	382,226,336	468,070,816	2,147,524,375
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	278,047,448	404,013,634	2,021,558,189

第6特定期間	2020年 1月18日 ~ 2020年 7月17日	831,204,042	385,482,667	2,467,279,564
第7特定期間	2020年 7月18日 ~ 2021年 1月18日	318,197,823	330,091,363	2,455,386,024
第8特定期間	2021年 1月19日 ~ 2021年 7月19日	589,186,949	445,994,982	2,598,577,991

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

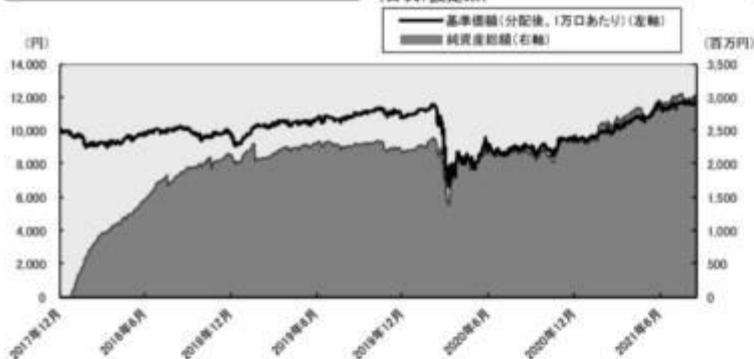
#### 参考情報

< 更新後 >

## 運用実績 (2021年8月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移

(日次:設定来)



## 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2021年8月	35 円
2021年7月	35 円
2021年6月	35 円
2021年5月	25 円
2021年4月	25 円
直近1年間累計	295 円
設定来累計	796 円

## 主要な資産の状況

## 銘柄別投資比率

銘柄	投資比率 (%)
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	91.3
J-REITインデックス マザーファンド	8.6

## 実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	国/地域	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	5.6
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.3
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.8
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.8
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	2.5
6	WELLTOWER INC	アメリカ	2.0
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	1.8
8	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	1.6
9	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.6
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.6

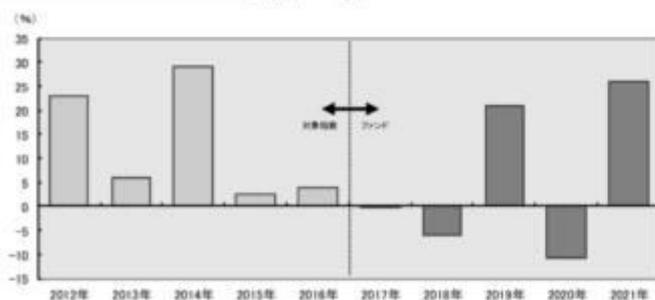
※上記は、組入銘柄の通貨によって国/地域を分類しております。  
なお、ユーロについては発行国で記載しております。

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	0.6
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	0.5
3	GLP投資法人 投資証券	0.5
4	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	0.5
5	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	0.4
6	日本都市ファンド投資法人 投資証券	0.4
7	大和ハウスリート投資法人 投資証券	0.3
8	オリックス不動産投資法人 投資証券	0.3
9	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	0.3
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	0.3

## 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。
- ・2012年から2016年は対象指数(合成指数)の年間収益率。
- ・2017年は設定日(2017年12月15日)から年末までのファンドの収益率。
- ・2021年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

●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。●対象指数(合成指数)の情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●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(2021年1月19日から2021年7月19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

## 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

## (1) 貸借対照表

	前期 (2021年 1月18日現在)	当期 (2021年 7月19日現在)
(単位：円)		
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,726,159	5,350,089
親投資信託受益証券	2,340,494,062	3,000,015,052
未収入金	9,590,209	7,846,864
流動資産合計	2,352,810,430	3,013,212,005
<b>資産合計</b>	2,352,810,430	3,013,212,005
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,910,772	9,095,022
未払解約金	5,522,169	1,652,430
未払受託者報酬	67,174	84,758
未払委託者報酬	783,689	988,858
未払利息	1	4
その他未払費用	6,708	8,466
流動負債合計	11,290,513	11,829,538
<b>負債合計</b>	11,290,513	11,829,538
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,455,386,024	2,598,577,991
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	113,866,107	402,804,476
(分配準備積立金)	259,430,195	500,303,213
元本等合計	2,341,519,917	3,001,382,467
<b>純資産合計</b>	2,341,519,917	3,001,382,467
<b>負債純資産合計</b>	2,352,810,430	3,013,212,005

## (2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
(単位：円)		
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	278,181,229	561,889,418
その他収益	2,521	-

	前期	当期
	自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
営業収益合計	278,183,750	561,889,418
営業費用		
支払利息	518	477
受託者報酬	369,743	447,178
委託者報酬	4,313,600	5,217,038
その他費用	36,912	44,659
営業費用合計	4,720,773	5,709,352
営業利益又は営業損失( )	273,462,977	556,180,066
経常利益又は経常損失( )	273,462,977	556,180,066
当期純利益又は当期純損失( )	273,462,977	556,180,066
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( )	626,949	5,145,194
期首剰余金又は期首欠損金( )	357,364,946	113,866,107
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,462,570	20,928,569
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,462,570	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	20,928,569
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,502,670	13,999,067
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	13,999,067
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,502,670	-
分配金	29,297,089	41,293,791
期末剰余金又は期末欠損金( )	113,866,107	402,804,476

## (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る場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2021年 1月19日から2021年 7月19日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2021年 1月18日現在	当期 2021年 7月19日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 2,455,386,024口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 2,598,577,991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	113,866,107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		2. 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	0.9536円	1口当たり純資産額	1.1550円
(10,000口当たり純資産額)	(9,536円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,550円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日			当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
2020年 7月18日から2020年 8月17日まで			2021年 1月19日から2021年 2月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,857,396円	費用控除後の配当等収益額	A	7,690,193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	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	286,455,124円	収益調整金額	C	370,307,302円
分配準備積立金額	D	285,868,103円	分配準備積立金額	D	249,891,254円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	577,180,623円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	627,888,749円
当ファンドの期末残存口数	F	2,433,100,370口	当ファンドの期末残存口数	F	2,621,124,100口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,372円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,395円
10,000口当たり分配金額	H	20円	10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,866,200円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	5,242,248円
2020年 8月18日から2020年 9月17日まで			2021年 2月18日から2021年 3月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,844,247円	費用控除後の配当等収益額	A	5,851,281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	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	286,458,293円	収益調整金額	C	373,020,182円
分配準備積立金額	D	280,062,015円	分配準備積立金額	D	247,407,171円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	571,364,555円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	626,278,634円
当ファンドの期末残存口数	F	2,407,704,240口	当ファンドの期末残存口数	F	2,609,318,032口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,373円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,400円
10,000口当たり分配金額	H	20円	10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,815,408円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	5,218,636円
2020年 9月18日から2020年10月19日まで			2021年 3月18日から2021年 4月19日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	6,554,642円	費用控除後の配当等収益額	A	10,669,458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	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	56,546,706円
収益調整金額	C	288,199,718円	収益調整金額	C	377,928,773円
分配準備積立金額	D	276,538,778円	分配準備積立金額	D	243,692,106円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	571,293,138円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	688,837,043円

当ファンドの期末残存口数	F	2,399,391,740口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,380円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	4,798,783円

2020年10月20日から2020年11月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,936,602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	316,168,324円
分配準備積立金額	D	272,674,787円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	592,779,713円
当ファンドの期末残存口数	F	2,493,342,682口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,377円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	4,986,685円

2020年11月18日から2020年12月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,882,867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	317,092,206円
分配準備積立金額	D	263,318,217円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	586,293,290円
当ファンドの期末残存口数	F	2,459,620,775口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,383円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	4,919,241円

2020年12月18日から2021年 1月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,935,261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	321,223,344円
分配準備積立金額	D	259,405,706円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	585,564,311円
当ファンドの期末残存口数	F	2,455,386,024口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,384円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	4,910,772円

当ファンドの期末残存口数	F	2,610,339,521口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,638円
10,000口当たり分配金額	H	25円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	6,525,848円

2021年 4月20日から2021年 5月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,999,471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	15,071,539円
収益調整金額	C	374,004,155円
分配準備積立金額	D	283,128,512円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	677,203,677円
当ファンドの期末残存口数	F	2,511,460,684口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,696円
10,000口当たり分配金額	H	25円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	6,278,651円

2021年 5月18日から2021年 6月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,120,728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	166,246,421円
収益調整金額	C	388,890,671円
分配準備積立金額	D	293,219,212円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	853,477,032円
当ファンドの期末残存口数	F	2,552,396,243口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,343円
10,000口当たり分配金額	H	35円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	8,933,386円

2021年 6月18日から2021年 7月19日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,876,721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	47,928,272円
収益調整金額	C	409,632,593円
分配準備積立金額	D	450,593,242円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	919,030,828円
当ファンドの期末残存口数	F	2,598,577,991口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,536円
10,000口当たり分配金額	H	35円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	9,095,022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 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19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、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>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>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2021年 1月18日現在	当期 2021年 7月19日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19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 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
期首元本額 2,467,279,564円	期首元本額 2,455,386,024円
期中追加設定元本額 318,197,823円	期中追加設定元本額 589,186,949円
期中一部解約元本額 330,091,363円	期中一部解約元本額 445,994,982円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2020年 7月18日 至 2021年 1月18日	当期 自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19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	357,824	60,071,223
合計	357,824	60,071,223

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （4）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2021年7月19日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2021年7月19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	J-REITインデックス マザーファンド	91,429,023	258,926,993	
		海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,559,651,812	2,741,088,059	
	小計	銘柄数:2 組入時価比率:100.0%	1,651,080,835	3,000,015,052 100.0%	
合計				3,000,015,052	

(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「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」および「J-REITインデックス 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。

## 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2021年 7月19日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	45,332,012
コール・ローン	176,898,246
投資証券	7,497,179,903
派生商品評価勘定	96,901,738
未収入金	294,128,976
未収配当金	13,392,928
差入委託証拠金	79,471,456
流動資産合計	8,203,305,259
資産合計	
8,203,305,259	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	236
未払金	537,013
未払解約金	307,447,516
未払利息	162

(2021年 7月19日現在)

その他未払費用	129,200
流動負債合計	308,114,127
負債合計	308,114,127
純資産の部	
元本等	
元本	4,492,296,008
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,402,895,124
元本等合計	7,895,191,132
純資産合計	7,895,191,132
負債純資産合計	8,203,305,259

## 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>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>配当株式</p> <p>配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2021年 7月19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	1.7575円
(10,000口当たり純資産額)	(17,575円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、REIT指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とするREIT指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、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

2021年 7月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

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

2021年 7月19日現在	
期首	2021年 1月19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	4,995,761,124円
同期中における追加設定元本額	406,181,215円
同期中における一部解約元本額	909,646,331円
期末元本額	4,492,296,008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	1,637,032,001円
野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型	430,954,458円
野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	1,559,651,812円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	58,476,449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）	186,103,978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）	504,435,565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）	115,641,745円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2021年7月19日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2021年7月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,800	80,598.00	
		AGREE REALTY CORP	3,120	229,288.80	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	3,400	63,376.00	
		ALEXANDERS INC	110	29,863.90	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,050	1,171,340.50	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,260	83,620.00	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6,240	315,182.40	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	5,500	46,420.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	12,240	509,918.40	
AMERICOLD REALTY TRUST	11,050	439,679.50	
APARTMENT INCOME REIT CO	6,840	352,807.20	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	6,800	47,940.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	9,000	130,680.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	2,700	35,937.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,160	1,391,359.20	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,300	14,417.00	
BOSTON PROPERTIES	6,250	725,875.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	7,900	110,205.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,900	289,347.00	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	6,700	164,820.00	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	1,800	33,048.00	
BRT APARTMENTS CORP	500	8,870.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,370	629,367.40	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	4,500	107,145.00	
CENTERSPACE	580	50,222.20	
CHATHAM LODGING TRUST	2,600	31,174.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	1,200	10,020.00	
CITY OFFICE REIT INC	2,300	28,681.00	
CLIPPER REALTY INC	790	6,478.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,100	87,567.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,040	51,469.60	
COREPOINT LODGING INC	1,800	25,146.00	
CORESITE REALTY CORP	1,940	268,127.40	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,900	145,579.00	
COUSINS PROPERTIES INC	6,440	251,224.40	
CTO REALTY GROWTH INC	260	14,380.60	
CUBESMART	8,840	429,535.60	
CYRUSONE INC	5,460	403,876.20	

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,900	80,723.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	12,440	1,957,060.80	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	21,900	158,556.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	10,600	42,930.00	
DOUGLAS EMMETT INC	7,150	243,386.00	
DUKE REALTY CORP	16,500	831,600.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	22,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,800	82,954.00	
EASTGROUP PROPERTIES	1,810	313,238.60	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	6,500	77,025.00	
EPR PROPERTIES	3,210	171,702.90	
EQUINIX INC	3,962	3,294,284.14	
EQUITY COMMONWEALTH	5,200	140,972.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,590	607,959.00	
EQUITY RESIDENTIAL	15,180	1,271,476.80	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5,100	142,596.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,860	939,023.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,890	1,012,726.60	
FARMLAND PARTNERS INC	1,500	18,555.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,090	361,993.50	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,850	317,889.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,500	100,730.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,200	26,468.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,770	456,747.50	
GEO GROUP INC/THE	6,200	40,300.00	
GETTY REALTY CORP	1,700	54,655.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,700	38,845.00	
GLADSTONE LAND CORP	1,200	28,740.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,500	38,225.00	
GLOBAL NET LEASE INC	4,300	79,206.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,500	202,800.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	9,500	265,525.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23,720	843,483.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,700	16,592.00	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,580	215,260.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	30,900	493,782.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6,900	191,130.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,300	84,753.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,900	78,271.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	1,080	225,763.20	
INVITATION HOMES INC	25,010	999,649.70	
IRON MOUNTAIN INC	12,920	559,694.40	
JBG SMITH PROPERTIES	4,700	154,865.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	32,000	25,920.00	
KILROY REALTY CORP	4,620	325,155.60	
KIMCO REALTY CORP	18,900	399,168.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	3,700	77,071.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	12,400	156,364.00	
LIFE STORAGE INC	3,420	389,332.80	
LTC PROPERTIES INC	1,770	70,428.30	
MACERICH CO /THE	7,100	119,138.00	
MACK-CALI REALTY CORP	3,800	66,994.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	65,301	52,893.81	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	25,800	531,996.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,040	930,988.80	
MONMOUTH REIT-CLASS A	4,600	88,458.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,670	371,534.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,010	160,493.20	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,950	132,249.00	
NETSTREIT CORP	1,200	30,312.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3,900	35,880.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	1,110	66,200.40	
OFFICE PROPERTIES INCOME	2,100	61,404.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,480	390,694.40	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	760	22,473.20	
PARAMOUNT GROUP INC	7,700	76,076.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	10,600	194,934.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	6,100	136,335.00	

PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,000	6,030.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,400	175,216.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	5,400	103,140.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,400	30,478.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,800	28,868.00	
PRIME US REIT	21,000	18,060.00	
PROLOGIS INC	32,730	4,165,874.40	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	870	134,658.60	
PUBLIC STORAGE	6,730	2,112,816.20	
QTS REALTY TRUST INC CL A	3,100	240,436.00	
REALTY INCOME CORP	16,470	1,145,653.20	
REGENCY CENTERS CORP	7,050	456,135.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5,600	97,720.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	10,000	115,200.00	
RETAIL VALUE INC	714	17,371.62	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,850	346,086.00	
RLJ LODGING TRUST	7,000	98,140.00	
RPT REALTY	3,900	49,374.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,420	189,800.60	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,500	174,040.00	
SAFEHOLD INC	630	52,340.40	
SAUL CENTERS INC	600	26,496.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	1,900	29,716.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	7,900	92,588.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	14,510	1,806,495.00	
SITE CENTERS CORP	7,800	116,922.00	
SL GREEN REALTY CORP	3,130	237,160.10	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	5,080	246,380.00	
STAG INDUSTRIAL INC	7,070	283,224.20	
STORE CAPITAL CORP	10,630	384,061.90	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,900	43,512.00	
SUN COMMUNITIES INC	4,920	906,165.60	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,200	104,972.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,800	84,864.00	

	TERRENO REALTY CORP	3,000	201,030.00	
	UDR INC	13,050	694,912.50	
	UMH PROPERTIES INC	1,900	43,282.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	580	36,197.80	
	URBAN EDGE PROPERTIES	5,100	94,197.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	1,600	30,624.00	
	VENTAS INC	16,530	985,518.60	
	VEREIT INC	10,240	495,718.40	
	VICI PROPERTIES INC	23,600	734,904.00	
	VORNADO REALTY TRUST	7,120	321,895.20	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	3,900	96,135.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,300	172,091.00	
	WELLTOWER INC	18,440	1,653,699.20	
	WHITESTONE REIT	1,900	15,124.00	
	WP CAREY INC	7,820	619,969.60	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,300	94,234.00	
小計	銘柄数 : 156	1,124,967	51,398,744.87	
			(5,647,694,086)	
	組入時価比率 : 71.5%		75.4%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,770	126,949.10	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,800	33,348.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	900	11,412.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	960	43,603.20	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,780	232,810.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	6,700	98,892.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4,200	47,292.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	2,200	40,150.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,200	37,444.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,100	65,723.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,100	24,706.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,900	89,229.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,370	118,231.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	6,400	107,712.00	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,200	57,792.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,300	48,852.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	900	22,239.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	900	16,200.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,100	53,669.00	
	PLAZA RETAIL REIT	2,000	9,140.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,000	159,530.00	
	SLATE GROCERY REIT	906	12,031.68	
	SLATE OFFICE REIT	2,000	10,820.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,900	88,015.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	3,600	67,752.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,000	15,000.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	1,800	41,940.00	
小計	銘柄数：27	77,986	1,680,482.18	
			(146,134,730)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	1,550	183,675.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,700	129,899.00	
	ALTAREA	170	31,450.00	
	BEFIMMO S.C.A.	1,130	40,171.50	
	CARE PROPERTY INVEST	1,200	34,020.00	
	CARMILA	2,200	25,740.00	
	COFINIMMO	1,270	169,291.00	
	COVIVIO	2,170	168,912.80	
	CROMWELL REIT EUR	13,600	34,408.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA	1,600	34,112.00	
	GECINA SA	2,430	322,218.00	
	HAMBORNER REIT AG	3,400	31,735.60	
	HIBERNIA REIT PLC	29,000	37,410.00	
	ICADE	1,320	98,670.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,600	10,673.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	11,200	96,992.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,100	26,895.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	19,000	30,020.00	
	KLEPIERRE	8,900	189,570.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	2,800	14,448.00	

	MERCIALYS	1,800	18,846.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	14,600	133,268.80	
	MONTEA	480	52,512.00	
	NSI NV	720	25,740.00	
	RETAIL ESTATES	510	37,383.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,070	441,349.70	
	VASTNED RETAIL NV	900	23,265.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,070	213,299.80	
	WERELDHAVE NV	1,900	27,284.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	790	42,818.00	
小計	銘柄数：30	148,180	2,726,077.20	
			(353,544,952)	
	組入時価比率：4.5%		4.7%	
英ボンド	AEW UK REIT PLC	7,000	6,965.00	
	ASSURA PLC	113,000	86,897.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	7,000	98,280.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	38,000	34,656.00	
	BRITISH LAND	40,800	203,388.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	36,000	59,652.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	28,000	32,480.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	20,000	20,040.00	
	DERWENT LONDON PLC	5,060	175,227.80	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	26,000	23,946.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	21,000	45,360.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	11,700	86,170.50	
	HAMMERSON PLC	179,000	64,887.50	
	HOME REIT PLC	10,000	11,250.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	17,000	19,550.00	
	INTU PROPERTIES PLC	39,000	0.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,700	219,744.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	41,000	100,696.00	
	LXI REIT PLC	29,000	41,876.00	
	NEWRIVER REIT PLC	16,000	13,120.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	26,000	23,322.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	60,000	95,820.00	

	REGIONAL REIT LTD	20,000	17,600.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	9,100	93,548.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	25,000	12,250.00	
	SEGRO PLC	52,800	619,608.00	
	SHAFTESBURY PLC	14,000	81,550.00	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	19,000	13,414.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	37,000	43,105.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	17,000	17,748.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	74,000	151,404.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	36,000	28,152.00	
	UNITE GROUP PLC	17,600	198,880.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	6,000	49,680.00	
小計	銘柄数：34	1,130,760	2,790,266.80 (421,693,021)	
	組入時価比率：5.3%		5.6%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	19,000	59,850.00	
	APN INDUSTRIA REIT	7,000	23,100.00	
	ARENA REIT	16,000	57,600.00	
	AVENTUS GROUP	18,000	55,080.00	
	BWP TRUST	23,000	96,830.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	26,666	81,597.96	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	21,000	80,010.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	18,000	43,920.00	
	CHARTER HALL GROUP	20,900	319,770.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	24,156	118,364.40	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	24,000	88,800.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	16,000	56,800.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	87,000	76,125.00	
	DEXUS/AU	48,000	493,440.00	
	GDI PROPERTY GROUP	26,000	28,730.00	
	GOODMAN GROUP	75,600	1,659,420.00	
	GPT GROUP	86,800	411,432.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	13,000	50,700.00	
	HOME CONSORTIUM	8,000	44,000.00	

	HOMECO DAILY NEEDS REIT	21,000	31,290.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	9,000	29,070.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	13,100	77,552.00	
	IRONGATE GROUP	26,000	38,220.00	
	MIRVAC GROUP	178,000	509,080.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	47,336	100,825.68	
	RURAL FUNDS GROUP	17,000	44,200.00	
	RURAL FUNDS GROUP RTS	2,023	262.99	
	SCENTRE GROUP	236,000	618,320.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	47,000	114,680.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	106,000	465,340.00	
	VICINITY CENTRES	170,000	257,550.00	
	WAYPOINT REIT LTD	35,000	90,650.00	
小計	銘柄数：32	1,485,581	6,222,610.03	
			(504,031,412)	
	組入時価比率：6.4%		6.7%	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	40,000	64,800.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	48,000	114,240.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	67,000	80,065.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	55,000	93,225.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	61,370.00	
小計	銘柄数：5	229,000	413,700.00	
			(31,705,968)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	87,000	388,020.00	
	FORTUNE REIT	61,000	512,400.00	
	LINK REIT	91,800	6,940,080.00	
	PROSPERITY REIT	56,000	170,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	49,000	235,200.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	75,000	301,500.00	
小計	銘柄数：6	419,800	8,548,000.00	
			(120,954,200)	
	組入時価比率：1.5%		1.6%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	20,025	31,639.50	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	54,927	49,159.66	

	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	143,108	437,910.48
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	85,562	88,984.48
	CAPITALAND CHINA TRUST	45,750	62,677.50
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	201,609	433,459.35
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	35,000	43,400.00
	EC WORLD REIT	12,000	9,780.00
	ESR REIT	114,821	50,521.24
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	47,000	27,965.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	55,440	14,691.60
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	56,566	139,718.02
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	39,000	20,670.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	122,019	186,689.07
	I REIT GLOBAL	28,242	18,357.30
	KEPPEL DC REIT	57,230	149,942.60
	KEPPEL REIT	82,000	97,580.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	43,000	37,625.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	234,000	14,742.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	95,319	204,935.85
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	87,050	251,574.50
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	125,641	266,358.92
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	92,000	94,760.00
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	110,259	46,860.07
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	18,000	86,400.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	37,360	16,251.60
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	26,000	25,220.00
	SPH REIT	45,000	42,750.00
	STARHILL GLOBAL REIT	62,000	37,820.00
	SUNTEC REIT	91,000	138,320.00
小計	銘柄数：30	2,266,928	3,126,763.74
			(252,955,186)
	組入時価比率：3.2%		3.4%
ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	4,500	33,390,000.00
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	1,000	5,530,000.00
	JR REIT XXVII	5,000	26,450,000.00

		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	1,500	9,240,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	5,700	33,630,000.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	3,700	17,131,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	1,900	15,067,000.00	
	小計	銘柄数：7	23,300	140,438,000.00	
				(13,482,048)	
		組入時価比率：0.2%		0.2%	
	新シケル	REIT 1 LTD	8,600	149,210.00	
	小計	銘柄数：1	8,600	149,210.00	
				(4,984,300)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
	合計			7,497,179,903	
				(7,497,179,903)	

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

(注2)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	2021年 7月19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				
REIT指数先物取引				
買建	161,423,609	-	162,934,459	1,510,850
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	7,804,352,988	-	7,708,962,336	95,390,652
米ドル	5,861,407,317	-	5,802,580,500	58,826,817
カナダドル	154,071,278	-	149,804,635	4,266,643
ユーロ	367,624,415	-	362,398,401	5,226,014
英ポンド	434,758,517	-	428,393,496	6,365,021
豪ドル	548,932,629	-	535,086,000	13,846,629
ニュージーランドドル	33,491,926	-	33,103,958	387,968
香港ドル	133,119,486	-	131,743,932	1,375,554
シンガポールドル	265,089,444	-	260,105,617	4,983,827

新シエケル	5,857,976	-	5,745,797	112,179
合計	-	-	-	96,901,502

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

先物の評価においては、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。

## 2 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。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2021年 7月19日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,408,761,840
投資証券	45,332,644,040
派生商品評価勘定	13,843,140
未収入金	390,451,967
未収配当金	257,749,918
差入委託証拠金	50,444,440
流動資産合計	47,453,895,345
資産合計	47,453,895,345
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	314,580
未払解約金	424,853,933
未払利息	1,291
流動負債合計	425,169,804
負債合計	425,169,804
純資産の部	
元本等	
元本	16,606,270,797
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	30,422,454,744

(2021年 7月19日現在)

元本等合計	47,028,725,541
純資産合計	47,028,725,541
負債純資産合計	47,453,895,345

## 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 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。</p> <p>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。</p>
2.費用・収益の計上基準	<p>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。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>
3.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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 7月19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	2.8320円
(10,000口当たり純資産額)	(28,320円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 1月19日 至 2021年 7月19日
1.金融商品に対する取組方針

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。

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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。

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。

これらは、REITの価格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。

当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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。

### 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っております。

### 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っております。

### 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っております。

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
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

2021年 7月19日現在	
期首	2021年 1月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,474,569,061円
同期中における追加設定元本額	1,574,677,174円
同期中における一部解約元本額	2,442,975,438円
期末元本額	16,606,270,797円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,650,154,627円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,129,615,098円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	784,861,847円

野村資産設計ファンド2015	13,926,916円
野村資産設計ファンド2020	13,952,858円
野村資産設計ファンド2025	17,585,429円
野村資産設計ファンド2030	18,114,395円
野村資産設計ファンド2035	18,957,112円
野村資産設計ファンド2040	34,953,464円
野村資産設計ファンド2045	3,767,542円
野村インデックスファンド・J-REIT ネクストコア	3,290,989,292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	19,074,092円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	987,411,923円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	2,202,740,740円
野村資産設計ファンド2050	844,896,999円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,369,490円
インデックス・ブレンド(タイプ )	915,964円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,038,029円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,706,446円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,047,571円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,454,635円
野村6資産均等バランス	1,512,388,667円
野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	91,429,023円
野村資産設計ファンド2060	1,999,806円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	175,378,194円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	71,757,003円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	143,447,316円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,704,481,463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)	375,358,366円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	435,860円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	2,107,611円
野村DC運用戦略ファンド	402,894,815円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	34,684,981円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	7,048,898円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,206,270円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	7,457,295円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,705,247円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	3,897,153円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,628,472円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	983,969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)	16,445,919円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年7月19日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2021年7月19日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	635	96,837,500	
		サンケイリアルエステート投資法 人 投資証券	951	126,483,000	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,022	169,447,600	
		東海道リート投資法人 投資証券	91	10,374,000	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,339	917,215,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,565	755,507,500	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,494	1,190,549,800	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,692	1,408,498,000	
		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	2,649	640,263,300	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	1,947	961,818,000	
		G L P 投資法人 投資証券	12,543	2,391,950,100	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,747	646,390,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,144	2,184,192,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	591	404,244,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	606	204,828,000	
		イオンリート投資法人 投資証券	3,942	651,218,400	
		ヒューリックリート投資法人 投資 証券	3,222	605,413,800	
		日本リート投資法人 投資証券	1,262	565,376,000	
		インベスコ・オフィス・ジェイリー ト投資法人 投資証券	24,698	557,680,840	
積水ハウス・リート投資法人 投資 証券	11,431	1,115,665,600			

トーセイ・リート投資法人 投資証券	860	122,464,000	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,546	460,862,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	829	129,324,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	748	97,688,800	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,568	2,186,832,000	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	680	63,240,000	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,701	922,336,200	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	3,993	255,951,300	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	364	48,630,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,356	805,464,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	627	53,545,800	
投資法人みらい 投資証券	4,197	237,130,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	842	116,869,600	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	977	478,730,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,243	250,961,700	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	595	74,613,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,168	149,971,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,508	245,653,200	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,374	3,057,426,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,887	2,670,369,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,359	2,216,605,500	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,744	1,635,532,800	

	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,420	1,028,500,000	
	N T T都市開発リート投資法人	3,510	554,229,000	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,606	533,448,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,699	341,423,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,312	1,373,142,400	
	森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,778	440,035,200	
	インヴィンシブル投資法人 投資証 券	16,251	708,543,600	
	フロンティア不動産投資法人 投資 証券	1,362	689,172,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証 券	2,511	437,416,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	2,539	865,799,000	
	福岡リート投資法人 投資証券	2,010	365,619,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,202	931,550,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	3,185	311,811,500	
	大和証券オフィス投資法人 投資証 券	822	637,050,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,756	293,076,400	
	スターツプロシード投資法人 投資 証券	605	152,520,500	
	大和ハウスリート投資法人 投資証 券	5,545	1,813,215,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	12,521	813,865,000	
	大和証券リビング投資法人 投資証 券	5,075	613,567,500	
	ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券	3,606	544,506,000	
小計	銘柄数：62	244,052	45,332,644,040	
	組入時価比率：96.4%		100.0%	
合計			45,332,644,040	

(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

種類	2021年 7月19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				
REIT指数先物取引				
買建	1,482,294,440	-	1,495,900,000	13,528,560
合計	1,482,294,440	-	1,495,900,000	13,528,560

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

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

#### 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）

2021年8月31日現在

資産総額	3,042,992,043円
負債総額	2,603,201円
純資産総額（ - ）	3,040,388,842円
発行済口数	2,583,657,775口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1768円

(参考) 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	14,261,582,571円
負債総額	7,028,358,579円
純資産総額（ - ）	7,233,223,992円
発行済口数	4,018,670,473口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7999円

## (参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	48,430,940,307円
負債総額	2,042,919,240円
純資産総額( - )	46,388,021,067円
発行済口数	16,336,731,105口
1口当たり純資産額( / )	2.8395円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

2021年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年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### (a) 会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

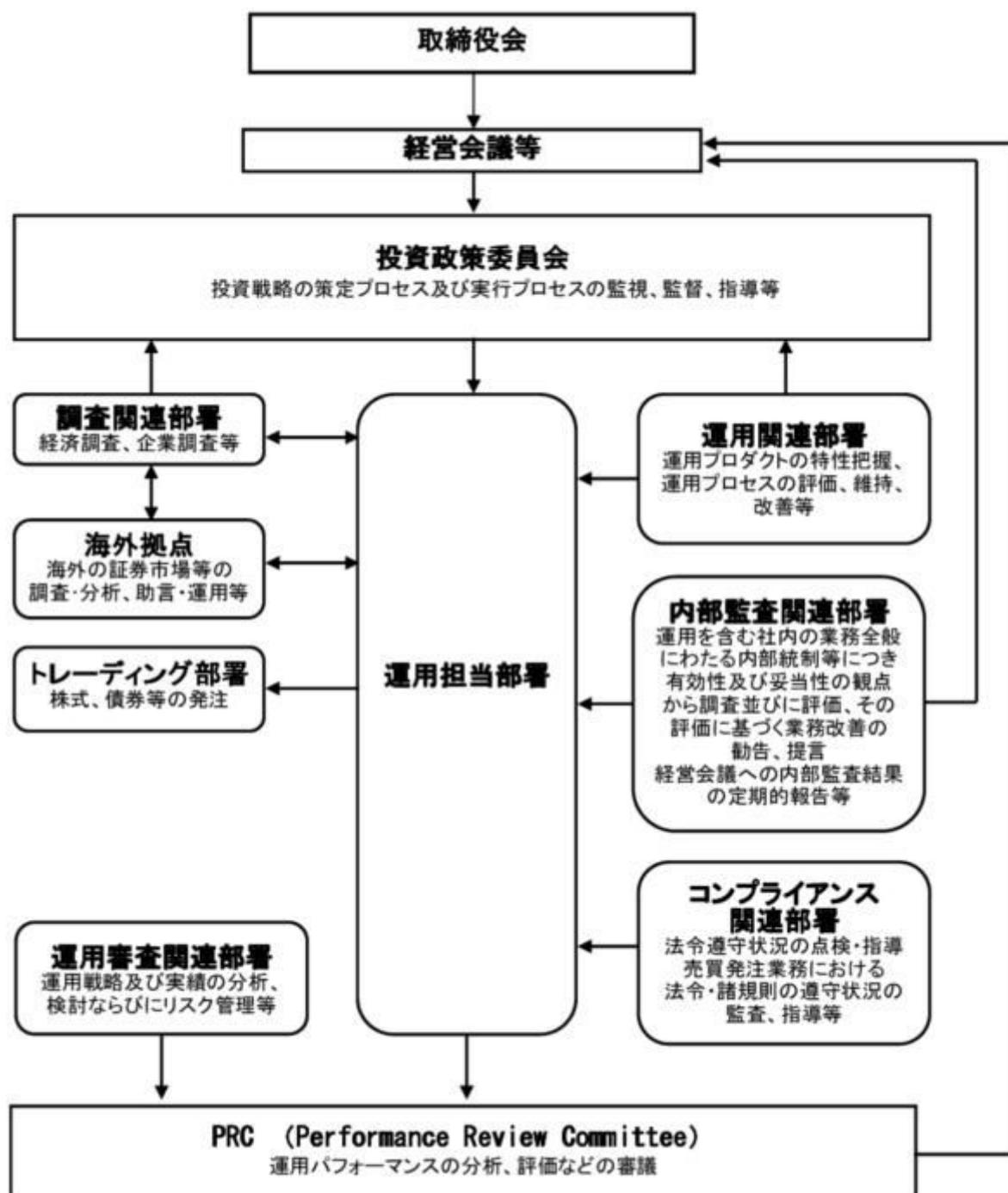
###### 代表取締役・業務執行取締役

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

###### 監査等委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2 事業の内容及び営業の概況

## &lt;更新後&gt;

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

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

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

### 3 委託会社等の経理状況

#### < 更新後 >

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

#### (1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			2,626		4,281
金銭の信託			41,524		35,912
有価証券			24,399		30,400
前払費用			106		167
未収入金			522		632
未収委託者報酬			23,936		24,499
未収運用受託報酬			4,336		4,347
その他			71		268
貸倒引当金			14		14
流動資産計			97,509		100,496
固定資産					
有形固定資産			645		2,666
建物	2	295		1,935	
器具備品	2	349		731	
無形固定資産			5,894		5,429

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

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

評価・換算差額等			10	57
その他有価証券評価差額金			10	57
純資産合計			85,281	87,654
負債・純資産合計			120,536	125,080

## ( 2 ) 損益計算書

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

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

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>						
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3．固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。  <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
4．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>						

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

[ 会計上の見積りに関する注記 ]

該当事項はありません。

[ 未適用の会計基準等 ]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

## (1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

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

## 損益計算書関係

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

<p>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</p> <p>2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 ア 合計 67</p>	<p>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</p> <p>2. 固定資産除却損 器具備品 2百万円 ソフトウェア 102 ア 合計 105</p>
--	--

## 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

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

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

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

## 有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．其他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
<p>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。</p>
<p>2．確定給付制度</p>

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

## 税効果会計関係

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

## 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## 3．当該資産除去債務の総額の増減

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

## セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

## 1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

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

### (2) 地域ごとの情報

#### 売上高

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等  
該当はありません。

### (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

### 1株当たり情報

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1 名称、資本金の額及び事業の内容

<更新後>

#### (1) 受託者

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

\* 2021年7月末現在

## (2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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んでいます。

\*2021年7月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2021年9月3日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保  
業務執行社員

## 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世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）の2021年1月19日から2021年7月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）の2021年7月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
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、継続企業的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。継続企業的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。