

【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】	2023年7月28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】	ミリオン（インデックスポートフォリオ） ミリオン（バランスポートフォリオ） ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ） ミリオン（リザーブ ポートフォリオ） ミリオン（インデックスポートフォリオ）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。 ミリオン（バランスポートフォリオ） 1兆円を上限とします。 ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ） 1兆円を上限とします。 ミリオン（リザーブ ポートフォリオ） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2023年1月27日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

（１）ファンドの目的及び基本的性格

< 更新後 >

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（2023年1月19日現在）

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

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

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運

用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

（３）ファンドの仕組み

< 更新後 >

■ 委託会社の概況(2023年6月末現在) ■

・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

・ 資本金の額

17,180百万円

・ 会社の沿革

1959年12月 1 日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月 1 日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村

アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月 1 日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・ 大株主の状況

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

2 投資方針

（３）運用体制

< 更新後 >

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

3 投資リスク

< 更新後 >

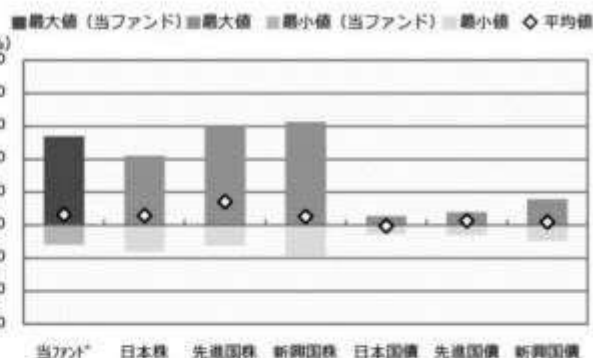
■ リスクの定量的比較 (2018年6月末～2023年5月末：月次)

■ インデックスポートフォリオ

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



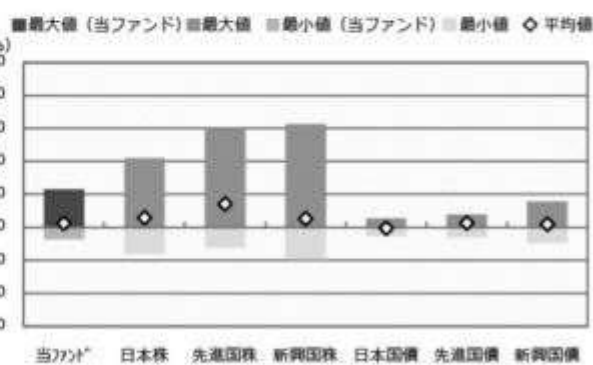
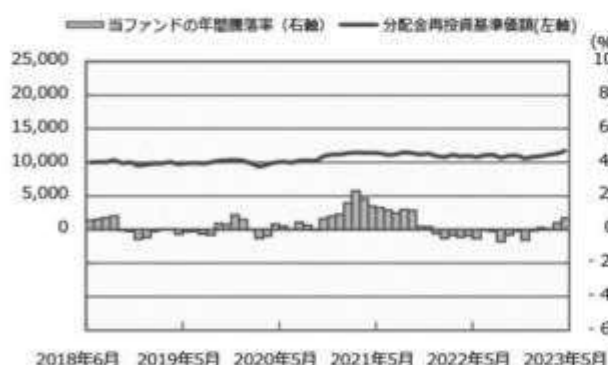
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	53.9	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 11.8	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	6.5	5.8	14.2	5.3	△ 0.4	2.7	2.0

- * 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。2018年6月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年6月から2023年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2018年6月から2023年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

■ バランスポートフォリオ

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



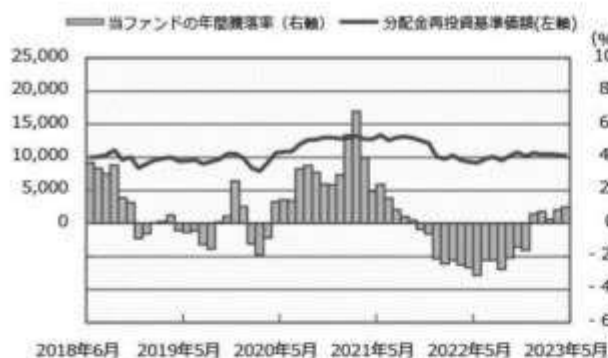
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	23.0	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 7.2	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	2.5	5.8	14.2	5.3	△ 0.4	2.7	2.0

- * 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。2018年6月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年6月から2023年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2018年6月から2023年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

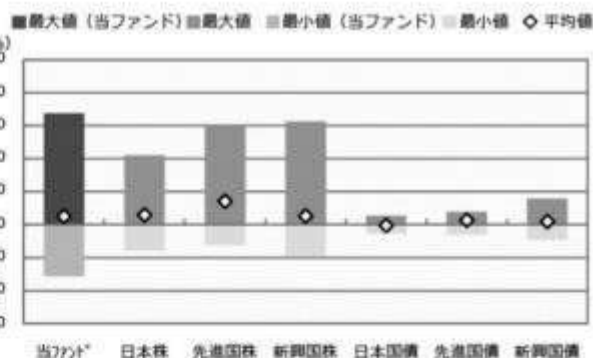
「ジャパン ドリーム ポートフォリオ

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



- * 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。2018年6月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年6月から2023年5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。

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 (%)	67.6	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 31.4	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	5.1	5.8	14.2	5.3	△ 0.4	2.7	2.0

- * 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。
- * 2018年6月から2023年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

「リザーブ ポートフォリオ

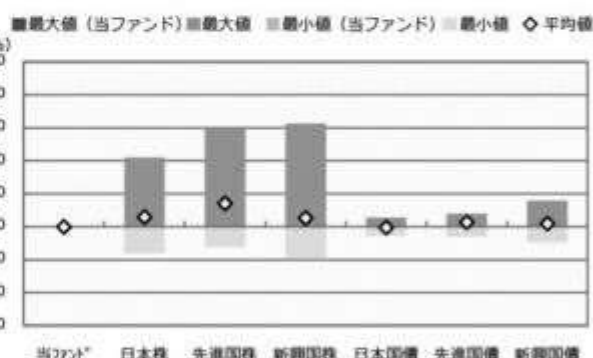
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



- * 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。2018年6月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年6月から2023年5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。

※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。

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 (%)	△ 0.0	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	15.7
最小値 (%)	△ 0.0	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	△ 0.0	5.8	14.2	5.3	△ 0.4	2.7	2.0

- * 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。
- * 2018年6月から2023年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

＜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）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社J P X 総研又は株式会社J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P X は責任を負いません。
- 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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、ブレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。
- 米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、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もありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4 手数料等及び税金

（3）信託報酬等

＜更新後＞

「インデックスポートフォリオ」および「バランスポートフォリオ」

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.44%（税抜年0.40%）以内(2023年7月28日現在年0.44%（税抜年0.40%））の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
年0.185%	年0.185%	年0.03%

* 上記配分は、2023年7月28日現在の信託報酬率における配分です。

「ジャパン ドリーム ポートフォリオ」

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.847%（税抜年0.77%）以内(2023年7月28日現在年0.847%（税抜年0.77%））の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
年0.37%	年0.37%	年0.03%

* 上記配分は、2023年7月28日現在の信託報酬率における配分です。

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初

の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

「リザーブ ポートフォリオ」

前月の最終営業日の翌日から当月の最終営業日までの日々の信託報酬率は、当該各月の前月最終5営業日間の当該信託の日々の基準価額算出に用いたコール・ローンのオーバーナイト物レートの最低レート(以下「コールレート」といいます。)に応じた次に掲げる率とします。なお、月中において、日々の基準価額算出に用いたコール・ローンのオーバーナイト物レートが信託報酬率を下回った場合には、その翌日以降の信託報酬率はそのコール・ローンのオーバーナイト物レートをコールレートとし、次に掲げる率として見直す場合があります。

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に次に掲げる信託報酬率を乗じて得た額とします。また、信託報酬およびその配分については、「コールレート」に応じて次の通り（税抜）とします。

コールレート	0.4%未満	0.4%以上
信託報酬率	年0.165% (税抜年0.15%)以内	年0.33% (税抜年0.30%)
委託会社	年0.055%以内	年0.065%
販売会社	年0.080%以内	年0.210%
受託会社	年0.015%以内	年0.025%

* 2023年7月28日現在の信託報酬率は年0.00121%（税抜年0.0011%）となっております。

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

支払先の役務の内容

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

(5) 課税上の取扱い

< 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■ 個人、法人別の課税について ■

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、「リザーブ ポートフォリオ」を除く各ファンドは、配当控除の適用があります。「リザー

「ポートフォリオ」は、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
・ 特定公社債 ^(注1) の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・ 譲渡益 ・ 譲渡損	・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

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

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

公募株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

* 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。（2023年5月末現在）

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■ 換金(解約)時および償還時の課税について ■

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

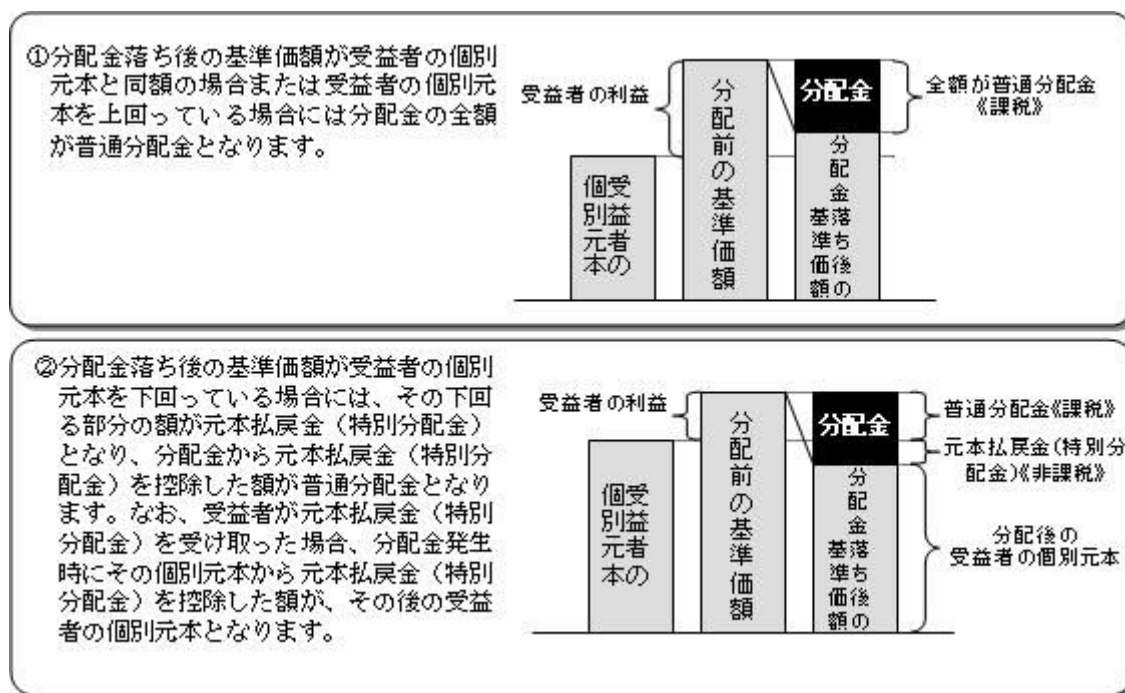
■ 個別元本について ■

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■ 分配金の課税について ■

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



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

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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2023年5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2023年5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

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

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	20,754,924,893	99.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,103,518	0.01
合計（純資産総額）		20,757,028,411	100.00

ミリオン（バランスポートフォリオ）

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	627,015,500	46.04
親投資信託受益証券	日本	680,693,844	49.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	54,130,737	3.97
合計（純資産総額）		1,361,840,081	100.00

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	6,396,308,600	95.56
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	297,175,243	4.43
合計（純資産総額）		6,693,483,843	100.00

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	日本	80,046,772	13.12
特殊債券	日本	140,152,288	22.98
社債券	日本	120,175,969	19.71
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	269,311,447	44.17
合計（純資産総額）		609,686,476	100.00

(参考) ミリオン・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（％）
株式	日本	106,640,807,130	98.04
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,122,128,192	1.95
合計（純資産総額）		108,762,935,322	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	2,097,800,000	1.92

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

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	ミリオン・インデックスマザー ファンド	10,147,618,879	1.8001	18,266,728,745	2.0453	20,754,924,893	99.98

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.98
合 計	99.98

ミリオン（バランスポートフォリオ）

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	ミリオン・イン デックスマザー ファンド	332,808,803	1.8008	599,322,093	2.0453	680,693,844	—	—	49.98
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 （１０年）第３ ５８回	35,000,000	98.75	34,564,600	99.32	34,765,150	0.1	2030/3/20	2.55
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 （３０年）第１ ３回	30,000,000	116.77	35,033,400	115.49	34,649,700	2	2033/12/20	2.54
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 （１０年）第３ ３５回	30,000,000	101.01	30,305,100	100.79	30,237,000	0.5	2024/9/20	2.22
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 （２０年）第１ ３０回	20,000,000	113.19	22,639,600	112.01	22,403,400	1.8	2031/9/20	1.64

6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 2 回	20,000,000	100.45	20,090,800	100.43	20,086,800	0.1	2026/3/20	1.47
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 4 3 回	20,000,000	100.34	20,068,400	100.31	20,063,000	0.1	2025/3/20	1.47
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 9 回	20,000,000	100.02	20,005,000	100.22	20,045,400	0.1	2027/12/20	1.47
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 2 回	20,000,000	99.79	19,959,200	99.94	19,989,400	0.1	2028/9/20	1.46
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (3 0 年) 第 3 7 回	15,000,000	113.95	17,093,100	115.78	17,367,000	1.9	2042/9/20	1.27
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (3 0 年) 第 5 1 回	20,000,000	79.68	15,936,150	83.52	16,704,400	0.3	2046/6/20	1.22
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 8 9 回	15,000,000	108.02	16,204,200	106.87	16,031,550	2.2	2026/6/20	1.17
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 6 6 回	15,000,000	99.02	14,853,050	98.67	14,801,550	0.2	2032/3/20	1.08
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 5 6 回	15,000,000	96.57	14,485,500	97.04	14,556,750	0.4	2036/3/20	1.06
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 6 9 回	15,000,000	90.56	13,585,300	91.84	13,776,300	0.3	2039/6/20	1.01
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (3 0 年) 第 2 4 回	10,000,000	123.53	12,353,000	123.25	12,325,700	2.5	2036/9/20	0.90
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (4 0 年) 第 3 回	10,000,000	116.40	11,640,200	121.88	12,188,500	2.2	2050/3/20	0.89
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (3 0 年) 第 3 3 回	10,000,000	115.33	11,533,200	117.25	11,725,900	2	2040/9/20	0.86
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 2 5 回	10,000,000	115.82	11,582,900	114.69	11,469,900	2.2	2031/3/20	0.84
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (3 0 年) 第 1 1 回	10,000,000	113.52	11,352,400	112.23	11,223,700	1.7	2033/6/20	0.82
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 4 1 回	10,000,000	113.46	11,346,500	112.11	11,211,700	1.7	2032/12/20	0.82
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 1 0 回	10,000,000	112.28	11,228,700	111.34	11,134,000	2.1	2029/3/20	0.81
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (4 0 年) 第 7 回	10,000,000	103.16	10,316,500	110.74	11,074,600	1.7	2054/3/20	0.81
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 4 4 回	10,000,000	111.49	11,149,800	110.21	11,021,700	1.5	2033/3/20	0.80
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 9 7 回	10,000,000	110.27	11,027,500	109.35	10,935,100	2.2	2027/9/20	0.80
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 9 2 回	10,000,000	108.55	10,855,200	107.55	10,755,700	2.1	2026/12/20	0.78
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (3 0 年) 第 1 0 回	10,000,000	107.44	10,744,500	106.40	10,640,000	1.1	2033/3/20	0.78
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 8 4 回	10,000,000	106.36	10,636,200	105.26	10,526,800	2	2025/12/20	0.77
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 7 2 回	10,000,000	104.00	10,400,500	102.87	10,287,900	2.1	2024/9/20	0.75

30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 9 回	10,000,000	101.16	10,116,400	100.96	10,096,500	0.4	2025/6/20	0.74
----	----	------	-----------------------------------	------------	--------	------------	--------	------------	-----	-----------	------

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	46.04
親投資信託受益証券	49.98
合 計	96.02

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	プラスアルファ・コンサルティング	情報・通信業	68,400	2,341.79	160,178,436	3,135.00	214,434,000	3.20
2	日本	株式	カチタス	不動産業	80,800	2,931.21	236,842,449	2,506.00	202,484,800	3.02
3	日本	株式	オイシックス・ラ・大地	小売業	89,800	1,634.58	146,785,284	2,252.00	202,229,600	3.02
4	日本	株式	メルカリ	情報・通信業	68,200	2,694.76	183,782,632	2,852.00	194,506,400	2.90
5	日本	株式	マネーフォワード	情報・通信業	32,100	4,401.03	141,273,241	5,840.00	187,464,000	2.80
6	日本	株式	M & A総研ホールディングス	サービス業	18,200	7,140.00	129,948,000	10,110.00	184,002,000	2.74
7	日本	株式	ティーケービー	不動産業	71,900	2,899.78	208,494,302	2,539.00	182,554,100	2.72
8	日本	株式	シンプレクス・ホールディングス	情報・通信業	77,200	2,139.59	165,176,928	2,360.00	182,192,000	2.72
9	日本	株式	プレミアグループ	その他金融業	119,000	1,742.57	207,365,830	1,503.00	178,857,000	2.67
10	日本	株式	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	64,400	2,301.74	148,232,518	2,749.00	177,035,600	2.64
11	日本	株式	eWeLL	情報・通信業	35,400	3,861.76	136,706,304	4,920.00	174,168,000	2.60
12	日本	株式	Keeper 技研	サービス業	32,300	3,770.00	121,771,000	5,380.00	173,774,000	2.59
13	日本	株式	ラクスル	情報・通信業	128,000	1,420.92	181,878,144	1,287.00	164,736,000	2.46
14	日本	株式	オービックビジネスコンサルティング	情報・通信業	31,400	4,014.65	126,060,075	5,070.00	159,198,000	2.37
15	日本	株式	オープンワーク	情報・通信業	27,100	4,127.09	111,844,139	5,660.00	153,386,000	2.29
16	日本	株式	大栄環境	サービス業	71,300	1,839.22	131,136,386	2,013.00	143,526,900	2.14
17	日本	株式	テスホールディングス	建設業	138,800	1,031.42	143,162,474	997.00	138,383,600	2.06
18	日本	株式	ミルボン	化学	30,000	6,068.52	182,055,600	4,600.00	138,000,000	2.06
19	日本	株式	イー・ギャランティ	その他金融業	66,700	2,381.02	158,814,034	1,963.00	130,932,100	1.95
20	日本	株式	カナミックネットワーク	情報・通信業	283,100	596.60	168,897,460	445.00	125,979,500	1.88
21	日本	株式	NexTone	サービス業	54,800	4,096.23	224,473,404	2,290.00	125,492,000	1.87
22	日本	株式	トランザクション・メディア・ネットワーク	情報・通信業	74,900	1,275.46	95,532,044	1,615.00	120,963,500	1.80
23	日本	株式	ハーモニック・ドライブ・システムズ	機械	24,500	4,704.52	115,260,953	4,860.00	119,070,000	1.77

24	日本	株式	新日本科学	サービス業	50,900	2,391.38	121,721,515	2,332.00	118,698,800	1.77
25	日本	株式	マクニカホールディングス	卸売業	23,300	3,421.48	79,720,484	5,090.00	118,597,000	1.77
26	日本	株式	FOOD & LIFE COMPANIE	小売業	35,600	2,497.78	88,920,968	3,280.00	116,768,000	1.74
27	日本	株式	ジャパンエレベーターサービスホールディング	サービス業	61,500	1,687.86	103,803,609	1,879.00	115,558,500	1.72
28	日本	株式	サスメド	情報・通信業	85,200	1,145.75	97,618,362	1,340.00	114,168,000	1.70
29	日本	株式	芝浦電子	電気機器	19,100	4,950.54	94,555,362	5,900.00	112,690,000	1.68
30	日本	株式	ネットプロテクションズホールディングス	その他金融業	298,300	482.83	144,030,132	370.00	110,371,000	1.64

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.06
		繊維製品	0.89
		化学	3.22
		機械	1.77
		電気機器	3.25
		その他製品	1.52
		電気・ガス業	0.48
		情報・通信業	36.64
		卸売業	1.77
		小売業	10.38
		証券、商品先物取引業	1.15
		その他金融業	6.27
		不動産業	5.75
		サービス業	20.34
合 計			95.56

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	日本	社債券	四国電力 第281回	40,000,000	100.34	40,137,935	100.34	40,137,935	1.111	2023/9/25	6.58
2	日本	社債券	中部電力 第499回	40,000,000	100.07	40,030,530	100.07	40,030,530	1.194	2023/6/23	6.56
3	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	40,000,000	100.07	40,029,952	100.07	40,029,952	0.882	2023/6/30	6.56
4	日本	地方債証券	埼玉県 公募平成25年度第3回	40,000,000	100.06	40,024,400	100.06	40,024,400	0.892	2023/6/26	6.56
5	日本	地方債証券	神奈川県 公募第198回	40,000,000	100.05	40,022,372	100.05	40,022,372	0.921	2023/6/20	6.56
6	日本	特殊債券	住宅金融支援機構債券 財投機関債第136回	40,000,000	100.04	40,019,269	100.04	40,019,269	0.849	2023/6/20	6.56

7	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	40,000,000	100.04	40,019,255	100.04	40,019,255	0.935	2023/6/20	6.56
8	日本	社債券	北海道電力 第333回	40,000,000	100.01	40,007,504	100.01	40,007,504	0.25	2023/6/23	6.56
9	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	20,000,000	100.41	20,083,812	100.41	20,083,812	0.693	2023/12/28	3.29

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	13.12
特殊債券	22.98
社債券	19.71
合 計	55.82

（参考）ミリオン・インデックスマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	351,000	27,805.94	9,759,884,940	32,680.00	11,470,680,000	10.54
2	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	351,000	13,307.44	4,670,911,440	19,315.00	6,779,565,000	6.23
3	日本	株式	アドバンテスト	電気機器	234,000	8,012.28	1,874,873,520	17,910.00	4,190,940,000	3.85
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	702,000	6,476.32	4,546,376,640	5,475.00	3,843,450,000	3.53
5	日本	株式	ダイキン工業	機械	117,000	22,657.20	2,650,892,400	26,560.00	3,107,520,000	2.85
6	日本	株式	KDDI	情報・通信業	702,000	4,224.09	2,965,311,180	4,291.00	3,012,282,000	2.76
7	日本	株式	ファナック	電気機器	585,000	4,015.04	2,348,798,400	4,798.00	2,806,830,000	2.58
8	日本	株式	信越化学工業	化学	585,000	3,203.80	1,874,223,000	4,297.00	2,513,745,000	2.31
9	日本	株式	テルモ	精密機器	468,000	4,251.87	1,989,875,160	4,246.00	1,987,128,000	1.82
10	日本	株式	TDK	電気機器	351,000	4,798.65	1,684,326,150	5,340.00	1,874,340,000	1.72
11	日本	株式	京セラ	電気機器	234,000	6,721.95	1,572,936,300	7,926.00	1,854,684,000	1.70
12	日本	株式	第一三共	医薬品	351,000	4,590.18	1,611,153,180	4,540.00	1,593,540,000	1.46
13	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	117,000	10,838.08	1,268,055,360	13,160.00	1,539,720,000	1.41
14	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	351,000	4,478.56	1,571,974,560	4,290.00	1,505,790,000	1.38
15	日本	株式	中外製薬	医薬品	351,000	3,375.78	1,184,898,780	3,755.00	1,318,005,000	1.21
16	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	585,000	2,050.89	1,199,770,650	2,207.50	1,291,387,500	1.18
17	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	585,000	2,062.32	1,206,457,200	1,997.00	1,168,245,000	1.07
18	日本	株式	日東電工	化学	117,000	8,003.09	936,361,530	9,930.00	1,161,810,000	1.06
19	日本	株式	パナダイナムコホールディングス	その他製品	351,000	3,179.23	1,115,909,730	3,271.00	1,148,121,000	1.05
20	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	585,000	1,973.50	1,154,497,500	1,908.50	1,116,472,500	1.02
21	日本	株式	セコム	サービス業	117,000	8,213.11	960,933,870	9,136.00	1,068,912,000	0.98
22	日本	株式	エーザイ	医薬品	117,000	8,668.08	1,014,165,360	8,868.00	1,037,556,000	0.95
23	日本	株式	H O Y A	精密機器	58,500	13,454.52	787,089,420	17,565.00	1,027,552,500	0.94

24	日本	株式	デンソー	輸送用機器	117,000	7,344.55	859,312,350	8,611.00	1,007,487,000	0.92
25	日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	117,000	6,873.26	804,171,420	8,533.00	998,361,000	0.91
26	日本	株式	オリンパス	精密機器	468,000	2,979.77	1,394,532,360	2,117.50	990,990,000	0.91
27	日本	株式	オムロン	電気機器	117,000	6,794.48	794,954,160	8,425.00	985,725,000	0.90
28	日本	株式	キッコーマン	食料品	117,000	7,611.85	890,586,450	8,230.00	962,910,000	0.88
29	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	234,000	3,373.09	789,303,060	4,005.00	937,170,000	0.86
30	日本	株式	S M C	機械	11,700	61,015.89	713,885,913	75,080.00	878,436,000	0.80

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.06
		鉱業	0.06
		建設業	1.60
		食料品	3.47
		繊維製品	0.10
		パルプ・紙	0.07
		化学	6.82
		医薬品	6.88
		石油・石炭製品	0.16
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.79
		鉄鋼	0.07
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.02
		機械	5.51
		電気機器	25.18
		輸送用機器	4.21
		精密機器	3.94
		その他製品	2.66
		電気・ガス業	0.15
		陸運業	1.36
		海運業	0.29
		空運業	0.32
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.90
		卸売業	2.77
		小売業	12.05
		銀行業	0.58
		証券、商品先物取引業	0.20
		保険業	0.85
		その他金融業	0.70
		不動産業	0.99

		サービス業	4.52
合	計		98.04

投資不動産物件

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

該当事項はありません。

ミリオン（バランスポートフォリオ）

該当事項はありません。

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

該当事項はありません。

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

該当事項はありません。

（参考）ミリオン・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

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

該当事項はありません。

ミリオン（バランスポートフォリオ）

該当事項はありません。

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

該当事項はありません。

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

該当事項はありません。

（参考）ミリオン・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 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	日経平均株価先物(2023年06月 限)	買建	68	日本円	2,093,413,660	2,097,800,000	1.92

（３）運用実績

純資産の推移

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

2023年5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26計算期間	(2013年11月 7日)	21,163	21,185	0.4939	0.4944
第27計算期間	(2014年11月 7日)	22,447	22,466	0.5850	0.5855
第28計算期間	(2015年11月 9日)	22,319	22,335	0.6798	0.6803
第29計算期間	(2016年11月 7日)	19,036	19,052	0.5954	0.5959
第30計算期間	(2017年11月 7日)	22,092	22,106	0.7961	0.7966
第31計算期間	(2018年11月 7日)	19,844	19,856	0.7684	0.7689
第32計算期間	(2019年11月 7日)	20,126	20,138	0.8156	0.8161
第33計算期間	(2020年11月 9日)	19,752	19,763	0.8706	0.8711
第34計算期間	(2021年11月 8日)	20,564	20,574	1.0312	1.0317
第35計算期間	(2022年11月 7日)	18,881	18,890	0.9746	0.9751
	2022年 5月末日	18,873	—	0.9588	—
	6月末日	18,259	—	0.9287	—
	7月末日	19,205	—	0.9778	—
	8月末日	19,337	—	0.9880	—
	9月末日	17,875	—	0.9195	—
	10月末日	18,944	—	0.9773	—
	11月末日	19,153	—	0.9902	—
	12月末日	17,872	—	0.9250	—
	2023年 1月末日	18,618	—	0.9682	—
	2月末日	18,661	—	0.9727	—
	3月末日	19,183	—	1.0027	—
	4月末日	19,663	—	1.0316	—
	5月末日	20,757	—	1.1042	—

ミリオン（バランスポートフォリオ）

2023年5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26計算期間	(2013年11月 7日)	1,623	1,624	0.9989	0.9994
第27計算期間	(2014年11月 7日)	1,631	1,632	1.0913	1.0918
第28計算期間	(2015年11月 9日)	1,576	1,576	1.1786	1.1791
第29計算期間	(2016年11月 7日)	1,450	1,450	1.1312	1.1317
第30計算期間	(2017年11月 7日)	1,563	1,563	1.2870	1.2875
第31計算期間	(2018年11月 7日)	1,462	1,463	1.2561	1.2566
第32計算期間	(2019年11月 7日)	1,462	1,463	1.3051	1.3056
第33計算期間	(2020年11月 9日)	1,467	1,468	1.3456	1.3461
第34計算期間	(2021年11月 8日)	1,417	1,417	1.4560	1.4565
第35計算期間	(2022年11月 7日)	1,296	1,296	1.3860	1.3865
	2022年 5月末日	1,349	—	1.3899	—
	6月末日	1,299	—	1.3624	—
	7月末日	1,335	—	1.4015	—
	8月末日	1,337	—	1.4073	—
	9月末日	1,274	—	1.3512	—
	10月末日	1,303	—	1.3919	—
	11月末日	1,303	—	1.3978	—
	12月末日	1,251	—	1.3430	—
	2023年 1月末日	1,275	—	1.3716	—
	2月末日	1,281	—	1.3817	—
	3月末日	1,307	—	1.4120	—
	4月末日	1,328	—	1.4344	—
	5月末日	1,361	—	1.4848	—

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

2023年5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23計算期間	(2013年11月 7日)	3,836	3,837	3.3513	3.3518
第24計算期間	(2014年11月 7日)	3,711	3,712	3.9654	3.9659
第25計算期間	(2015年11月 9日)	4,645	4,646	5.1717	5.1722
第26計算期間	(2016年11月 7日)	4,718	4,718	5.4772	5.4777
第27計算期間	(2017年11月 7日)	6,654	6,654	8.1138	8.1143
第28計算期間	(2018年11月 7日)	7,445	7,446	9.3778	9.3783
第29計算期間	(2019年11月 7日)	7,195	7,195	9.2811	9.2816
第30計算期間	(2020年11月 9日)	9,333	9,333	13.0400	13.0405
第31計算期間	(2021年11月 8日)	8,547	8,547	12.5531	12.5536
第32計算期間	(2022年11月 7日)	6,599	6,599	9.6188	9.6193
	2022年 5月末日	6,112	—	8.9153	—
	6月末日	6,010	—	8.7737	—

7月末日	6,433	—	9.3359	—
8月末日	6,658	—	9.6532	—
9月末日	6,259	—	9.0743	—
10月末日	6,744	—	9.7713	—
11月末日	7,041	—	10.2587	—
12月末日	6,697	—	9.7134	—
2023年 1月末日	6,978	—	10.1538	—
2月末日	6,835	—	9.9887	—
3月末日	6,920	—	10.0531	—
4月末日	6,719	—	9.8912	—
5月末日	6,693	—	9.7868	—

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

2023年5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19計算期間	(2013年11月 7日)	336	337	1.0006	1.0012
第20計算期間	(2014年11月 7日)	444	445	1.0006	1.0012
第21計算期間	(2015年11月 9日)	411	412	1.0006	1.0011
第22計算期間	(2016年11月 7日)	374	374	1.0007	1.0007
第23計算期間	(2017年11月 7日)	603	603	1.0003	1.0003
第24計算期間	(2018年11月 7日)	548	548	1.0000	1.0000
第25計算期間	(2019年11月 7日)	559	559	0.9997	0.9997
第26計算期間	(2020年11月 9日)	645	645	0.9994	0.9994
第27計算期間	(2021年11月 8日)	731	731	0.9992	0.9992
第28計算期間	(2022年11月 7日)	633	633	0.9991	0.9991
2022年 5月末日		603	—	0.9991	—
6月末日		625	—	0.9991	—
7月末日		600	—	0.9991	—
8月末日		615	—	0.9991	—
9月末日		593	—	0.9991	—
10月末日		590	—	0.9991	—
11月末日		633	—	0.9990	—
12月末日		577	—	0.9990	—
2023年 1月末日		632	—	0.9990	—
2月末日		652	—	0.9990	—
3月末日		612	—	0.9990	—
4月末日		663	—	0.9990	—
5月末日		609	—	0.9990	—

分配の推移

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第26計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005円
第27計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005円
第28計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005円
第29計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005円
第30計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005円
第31計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005円
第32計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005円
第33計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005円
第34計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005円
第35計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0005円

ミリオン（バランスポートフォリオ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第26計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005円
第27計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005円
第28計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005円
第29計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005円
第30計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005円
第31計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005円
第32計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005円
第33計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005円
第34計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005円
第35計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0005円

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第23計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005円
第24計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005円
第25計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005円
第26計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005円
第27計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005円
第28計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005円

第29計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005円
第30計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005円
第31計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005円
第32計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0005円

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第19計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0006円
第20計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0006円
第21計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005円
第22計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0000円
第23計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0000円
第24計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0000円
第25計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0000円
第26計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0000円
第27計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0000円
第28計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0000円

収益率の推移

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

	計算期間	収益率
第26計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	58.7%
第27計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	18.5%
第28計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	16.3%
第29計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	12.3%
第30計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	33.8%
第31計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	3.4%
第32計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	6.2%
第33計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	6.8%
第34計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	18.5%
第35計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	5.4%
第36期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	6.9%

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。

ミリオン（バランスポートフォリオ）

	計算期間	収益率
第26計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.8%
第27計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	9.3%
第28計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	8.0%
第29計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	4.0%
第30計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	13.8%
第31計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	2.4%
第32計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	3.9%
第33計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	3.1%
第34計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	8.2%
第35計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	4.8%
第36期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	3.9%

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。

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

	計算期間	収益率
第23計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	80.3%
第24計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	18.3%
第25計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	30.4%
第26計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	5.9%
第27計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	48.1%
第28計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	15.6%
第29計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	1.0%
第30計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	40.5%
第31計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	3.7%
第32計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	23.4%
第33期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	3.3%

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。

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

	計算期間	収益率
第19計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.1%
第20計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.1%
第21計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0%
第22計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0%
第23計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0%

第24計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0%
第25計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0%
第26計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0%
第27計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0%
第28計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0%
第29期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	0.0%

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

（４）設定及び解約の実績

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第26計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	1,311,380,202	5,028,074,456	42,847,801,499
第27計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	1,337,781,592	5,810,438,808	38,375,144,283
第28計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	786,398,513	6,327,859,219	32,833,683,577
第29計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	783,724,012	1,646,023,459	31,971,384,130
第30計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	488,651,336	4,709,230,607	27,750,804,859
第31計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	357,880,182	2,284,488,880	25,824,196,161
第32計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	338,921,873	1,487,555,005	24,675,563,029
第33計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	312,173,831	2,298,655,007	22,689,081,853
第34計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	222,575,432	2,969,291,160	19,942,366,125
第35計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	229,440,364	799,382,412	19,372,424,077
第36期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	109,767,372	428,321,282	19,053,870,167

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

ミリオン（バランスポートフォリオ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第26計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	39,362,157	270,448,134	1,625,000,530
第27計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	34,724,633	164,358,254	1,495,366,909
第28計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	32,607,951	190,727,281	1,337,247,579
第29計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	26,036,372	81,386,039	1,281,897,912
第30計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	67,462,556	134,630,701	1,214,729,767
第31計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	35,931,197	86,067,042	1,164,593,922
第32計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	18,029,383	61,876,063	1,120,747,242
第33計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	36,543,179	66,653,261	1,090,637,160
第34計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	12,622,230	129,989,558	973,269,832
第35計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	11,929,352	50,109,581	935,089,603
第36期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	5,758,046	16,882,532	923,965,117

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第23計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	66,374,886	248,507,709	1,144,800,692
第24計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	66,167,185	274,970,520	935,997,357
第25計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	27,904,934	65,551,489	898,350,802
第26計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	21,400,228	58,305,301	861,445,729
第27計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	25,881,459	67,208,916	820,118,272
第28計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	25,694,123	51,842,866	793,969,529
第29計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	20,705,540	39,399,800	775,275,269
第30計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	23,093,383	82,637,909	715,730,743
第31計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	19,189,497	54,046,355	680,873,885
第32計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	39,526,454	34,280,565	686,119,774
第33期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	28,761,449	29,215,751	685,665,472

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第19計算期間	2012年11月 8日～2013年11月 7日	280,259,624	136,388,798	336,598,371
第20計算期間	2013年11月 8日～2014年11月 7日	588,844,569	480,899,094	444,543,846
第21計算期間	2014年11月 8日～2015年11月 9日	169,163,421	202,037,817	411,669,450
第22計算期間	2015年11月10日～2016年11月 7日	142,598,138	179,590,159	374,677,429
第23計算期間	2016年11月 8日～2017年11月 7日	292,603,988	63,932,106	603,349,311
第24計算期間	2017年11月 8日～2018年11月 7日	71,907,919	126,711,441	548,545,789
第25計算期間	2018年11月 8日～2019年11月 7日	70,907,202	59,334,177	560,118,814
第26計算期間	2019年11月 8日～2020年11月 9日	202,246,675	116,012,987	646,352,502
第27計算期間	2020年11月10日～2021年11月 8日	161,032,828	75,129,881	732,255,449
第28計算期間	2021年11月 9日～2022年11月 7日	230,284,042	328,572,899	633,966,592
第29期（中間期）	2022年11月 8日～2023年 5月 7日	201,679,969	232,630,676	603,015,885

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 >

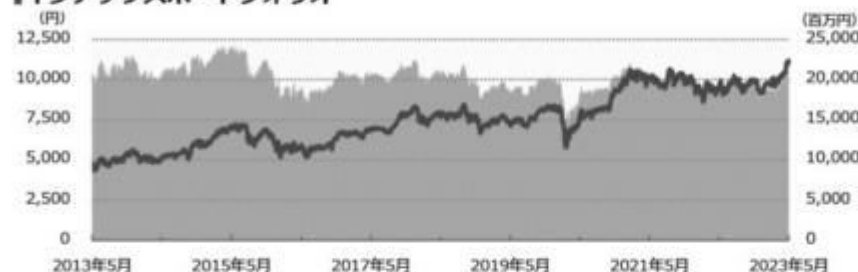


運用実績（2023年5月31日現在）

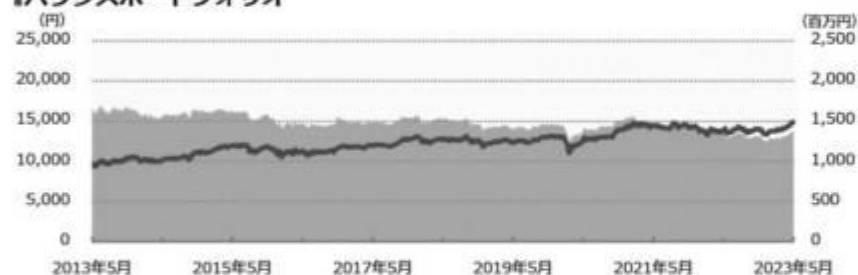
■ 基準価額・純資産の推移（日次）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） ■ 純資産総額（右軸）

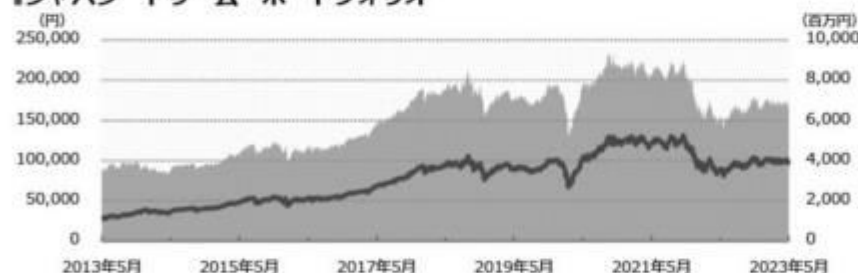
Ⅰ インデックスポートフォリオ



Ⅱ バランスポートフォリオ



Ⅲ ジャパン ドリーム ポートフォリオ



Ⅳ リザーブ ポートフォリオ



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

Ⅰ インデックスポートフォリオ

2022年11月	5 円
2021年11月	5 円
2020年11月	5 円
2019年11月	5 円
2018年11月	5 円
設定来累計	175 円

Ⅱ バランスポートフォリオ

2022年11月	5 円
2021年11月	5 円
2020年11月	5 円
2019年11月	5 円
2018年11月	5 円
設定来累計	175 円

Ⅲ ジャパン ドリーム ポートフォリオ

2022年11月	5 円
2021年11月	5 円
2020年11月	5 円
2019年11月	5 円
2018年11月	5 円
設定来累計	307 円

Ⅳ リザーブ ポートフォリオ

2022年11月	0 円
2021年11月	0 円
2020年11月	0 円
2019年11月	0 円
2018年11月	0 円
設定来累計	258 円

■ 主要な資産の状況

I インデックスポートフォリオ

実質的な銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
1	ファーストリテイリング	小売業	10.5
2	東京エレクトロン	電気機器	6.2
3	アドバンテスト	電気機器	3.8
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.5
5	ダイキン工業	機械	2.8
6	KDDI	情報・通信業	2.8
7	ファナック	電気機器	2.6
8	信越化学工業	化学	2.3
9	テルモ	精密機器	1.8
10	TDK	電気機器	1.7

実質的な業種別投資比率（上位）

順位	業種	投資比率（％）
1	電気機器	25.2
2	小売業	12.0
3	情報・通信業	9.9
4	医薬品	6.9
5	化学	6.8

II バランスポートフォリオ

銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	種類	投資比率（％）
1	ミリオン・インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	50.0
2	国庫債券 利付（10年）第358回	国債証券	2.6
3	国庫債券 利付（30年）第13回	国債証券	2.5
4	国庫債券 利付（10年）第335回	国債証券	2.2
5	国庫債券 利付（20年）第130回	国債証券	1.6
6	国庫債券 利付（10年）第342回	国債証券	1.5
7	国庫債券 利付（5年）第143回	国債証券	1.5
8	国庫債券 利付（10年）第349回	国債証券	1.5
9	国庫債券 利付（10年）第352回	国債証券	1.5
10	国庫債券 利付（30年）第37回	国債証券	1.3

III ジャパン ドリーム ポートフォリオ

銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
1	プラスアルファ・コンサルティング	情報・通信業	3.2
2	カチタス	不動産業	3.0
3	オイシックス・ラ・大地	小売業	3.0
4	メルカリ	情報・通信業	2.9
5	マネーフォワード	情報・通信業	2.8
6	M&A総研ホールディングス	サービス業	2.7
7	ティーケーピー	不動産業	2.7
8	シンプレクス・ホールディングス	情報・通信業	2.7
9	プレミアグループ	その他金融業	2.7
10	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	2.6

業種別投資比率（上位）

順位	業種	投資比率（％）
1	情報・通信業	36.6
2	サービス業	20.3
3	小売業	10.4
4	その他金融業	6.3
5	不動産業	5.8

リザーブ ポートフォリオ

銘柄別投資比率（上位）

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	四国電力 第281回	社債券	6.6
2	中部電力 第499回	社債券	6.6
3	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	特殊債券	6.6
4	埼玉県 公募平成25年度第3回	地方債証券	6.6
5	神奈川県 公募第198回	地方債証券	6.6
6	住宅金融支援機構債券 財投機関債第136回	特殊債券	6.6
7	日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	特殊債券	6.6
8	北海道電力 第333回	社債券	6.6
9	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	特殊債券	3.3

年間収益率の推移（暦年ベース）

インデックスポートフォリオ



バランスポートフォリオ



ジャパン ドリーム ポートフォリオ



リザーブ ポートフォリオ



- ・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。
- ・「バランスポートフォリオ」「ジャパン ドリーム ポートフォリオ」「リザーブ ポートフォリオ」にはベンチマークがありません。
- ・2023年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

ミリオン（バランスポートフォリオ）

（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36期中間計算期間（2022年11月8日から2023年5月7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。

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

（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33期中間計算期間（2022年11月8日から2023年5月7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。

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

（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29期中間計算期間（2022年11月8日から2023年5月7日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

（１）中間貸借対照表

（単位：円）		
	第35期 (2022年11月 7日現在)	第36期中間計算期間末 (2023年 5月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,345,090	42,670,514
親投資信託受益証券	18,879,314,051	19,857,425,979
未収入金	18,836,679	9,470,090
流動資産合計	18,940,495,820	19,909,566,583
資産合計	18,940,495,820	19,909,566,583
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,686,212	-
未払解約金	8,080,922	10,011,754
未払受託者報酬	3,093,302	2,988,614

	第35期 (2022年11月 7日現在)	第36期中間計算期間末 (2023年 5月 7日現在)
未払委託者報酬	38,150,683	36,859,549
未払利息	56	82
その他未払費用	309,271	298,804
流動負債合計	59,320,446	50,158,803
負債合計	59,320,446	50,158,803
純資産の部		
元本等		
元本	19,372,424,077	19,053,870,167
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	491,248,703	805,537,613
（分配準備積立金）	8,749,618,958	8,556,854,309
元本等合計	18,881,175,374	19,859,407,780
純資産合計	18,881,175,374	19,859,407,780
負債純資産合計	18,940,495,820	19,909,566,583

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第35期中間計算期間 自 2021年11月 9日 至 2022年 5月 8日	第36期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
営業収益		
受取利息	-	14
有価証券売買等損益	1,540,018,123	1,332,489,330
営業収益合計	1,540,018,123	1,332,489,344
営業費用		
支払利息	4,054	2,574
受託者報酬	4,064,279	2,988,614
委託者報酬	91,061,890	36,859,549
その他費用	310,428	298,804
営業費用合計	95,440,651	40,149,541
営業利益又は営業損失（ ）	1,635,458,774	1,292,339,803
経常利益又は経常損失（ ）	1,635,458,774	1,292,339,803
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,635,458,774	1,292,339,803
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（ ）	22,829,136	2,360,606
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	622,121,120	491,248,703
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	10,888,647
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	10,888,647
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,352,580	4,081,528
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,896,861	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,455,719	4,081,528
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,004,861,098	805,537,613

(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、2022年11月 8日から2023年 5月 7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35期 2022年11月 7日現在	第36期中間計算期間末 2023年 5月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 19,372,424,077口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 19,053,870,167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 491,248,703円	
3. 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 0.9746円 (10,000口当たり純資産額) (9,746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 1.0423円 (10,000口当たり純資産額) (10,423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35期 2022年11月 7日現在	第36期中間計算期間末 2023年 5月 7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 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。	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。

（その他の注記）

1 元本の移動

第35期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日		第36期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日	
期首元本額	19,942,366,125円	期首元本額	19,372,424,077円
期中追加設定元本額	229,440,364円	期中追加設定元本額	109,767,372円
期中一部解約元本額	799,382,412円	期中一部解約元本額	428,321,282円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

ミリオン（バランスポートフォリオ）

（ 1 ）中間貸借対照表

（単位：円）

	第35期 (2022年11月 7日現在)	第36期中間計算期間末 (2023年 5月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,515,378	43,683,680
国債証券	600,136,000	597,108,400
親投資信託受益証券	658,399,090	695,149,424
未収利息	1,186,784	1,108,275
前払費用	3,616	4,136
流動資産合計	1,301,240,868	1,337,053,915
資産合計	1,301,240,868	1,337,053,915
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	467,544	-
未払解約金	1,804,664	3,474,725
未払受託者報酬	216,953	204,960
未払委託者報酬	2,675,707	2,527,813
未払利息	55	84
その他未払費用	21,631	20,439
流動負債合計	5,186,554	6,228,021
負債合計	5,186,554	6,228,021
純資産の部		
元本等		
元本	935,089,603	923,965,117
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	360,964,711	406,860,777
（ 分配準備積立金 ）	441,870,284	433,918,517
元本等合計	1,296,054,314	1,330,825,894
純資産合計	1,296,054,314	1,330,825,894
負債純資産合計	1,301,240,868	1,337,053,915

（ 2 ）中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第35期中間計算期間 自 2021年11月 9日 至 2022年 5月 8日	第36期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
営業収益		

	第35期中間計算期間 自 2021年11月 9日 至 2022年 5月 8日	第36期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
受取利息	2,722,010	2,494,138
有価証券売買等損益	67,675,662	50,538,534
営業収益合計	64,953,652	53,032,672
営業費用		
支払利息	2,992	6,667
受託者報酬	287,551	204,960
委託者報酬	6,408,163	2,527,813
その他費用	21,990	20,439
営業費用合計	6,720,696	2,759,879
営業利益又は営業損失（ ）	71,674,348	50,272,793
経常利益又は経常損失（ ）	71,674,348	50,272,793
中間純利益又は中間純損失（ ）	71,674,348	50,272,793
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（ ）	295,675	91,038
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	443,812,255	360,964,711
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,505,327	2,231,244
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,505,327	2,231,244
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,752,887	6,516,933
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,752,887	6,516,933
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	371,186,022	406,860,777

（ 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	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。 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、2022年11月 8日から2023年 5月 7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35期 2022年11月 7日現在	第36期中間計算期間末 2023年 5月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 935,089,603口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 923,965,117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 1.3860円 (10,000口当たり純資産額) (13,860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 1.4403円 (10,000口当たり純資産額) (14,403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35期 2022年11月 7日現在	第36期中間計算期間末 2023年 5月 7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。 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。	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 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。 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35期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日	第36期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
期首元本額 973,269,832円	期首元本額 935,089,603円
期中追加設定元本額 11,929,352円	期中追加設定元本額 5,758,046円
期中一部解約元本額 50,109,581円	期中一部解約元本額 16,882,532円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

（1）中間貸借対照表

	第32期 (2022年11月 7日現在)	第33期中間計算期間末 (2023年 5月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	307,660,720	324,033,892
株式	6,302,810,800	6,506,101,300
未収入金	24,238,058	13,447,722
未収配当金	16,671,225	31,741,354
流動資産合計	6,651,380,803	6,875,324,268
資産合計	6,651,380,803	6,875,324,268
負債の部		
流動負債		
未払金	24,638,253	31,406,932
未払収益分配金	343,059	-
未払解約金	107,800	299,997
未払受託者報酬	1,034,714	1,089,810
未払委託者報酬	25,522,911	26,881,731
未払利息	413	624
その他未払費用	103,407	108,918
流動負債合計	51,750,557	59,788,012
負債合計	51,750,557	59,788,012
純資産の部		
元本等		
元本	686,119,774	685,665,472
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,913,510,472	6,129,870,784
（分配準備積立金）	6,581,167,221	6,306,738,126
元本等合計	6,599,630,246	6,815,536,256
純資産合計	6,599,630,246	6,815,536,256
負債純資産合計	6,651,380,803	6,875,324,268

（２）中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第32期中間計算期間 自 2021年11月 9日 至 2022年 5月 8日	第33期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
営業収益		
受取配当金	43,515,726	38,814,054
受取利息	-	127
有価証券売買等損益	2,445,651,225	211,812,164
その他収益	483	392
営業収益合計	2,402,135,016	250,626,737
営業費用		
支払利息	26,666	46,345
受託者報酬	1,528,678	1,089,810
委託者報酬	42,223,685	26,881,731
その他費用	114,640	108,918
営業費用合計	43,893,669	28,126,804
営業利益又は営業損失（ ）	2,446,028,685	222,499,933
経常利益又は経常損失（ ）	2,446,028,685	222,499,933
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,446,028,685	222,499,933
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（ ）	21,407,702	10,630,587
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,866,172,559	5,913,510,472
剰余金増加額又は欠損金減少額	161,710,441	256,500,255
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	161,710,441	256,500,255
剰余金減少額又は欠損金増加額	137,161,988	252,009,289

	第32期中間計算期間 自 2021年11月 9日 至 2022年 5月 8日	第33期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	137,161,988	252,009,289
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,466,100,029	6,129,870,784

（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	株式 原則として時価で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	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。 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。
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、2022年11月 8日から2023年 5月 7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32期 2022年11月 7日現在	第33期中間計算期間末 2023年 5月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 686,119,774口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 685,665,472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 9.6188円 (10,000口当たり純資産額) (96,188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 9.9400円 (10,000口当たり純資産額) (99,400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32期 2022年11月 7日現在	第33期中間計算期間末 2023年 5月 7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 中間貸借対照表計上額、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。 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。	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 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。 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32期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日		第33期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日	
期首元本額	680,873,885円	期首元本額	686,119,774円
期中追加設定元本額	39,526,454円	期中追加設定元本額	28,761,449円
期中一部解約元本額	34,280,565円	期中一部解約元本額	29,215,751円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

（ 1 ）中間貸借対照表

（単位：円）

	第28期 (2022年11月 7日現在)	第29期中間計算期間末 (2023年 5月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	300,421,526	304,399,383
地方債証券	202,203,007	40,049,545
特殊債券	170,105,158	240,183,761
社債券	-	80,078,750
未収利息	343,697	309,763
前払費用	348,728	419,339
流動資産合計	673,422,116	665,440,541
資産合計	673,422,116	665,440,541
負債の部		
流動負債		
未払金	40,038,800	-
未払解約金	-	63,037,779
未払受託者報酬	348	346
未払委託者報酬	3,259	3,221
未払利息	403	586

	第28期 (2022年11月 7日現在)	第29期中間計算期間末 (2023年 5月 7日現在)
流動負債合計	40,042,810	63,041,932
負債合計	40,042,810	63,041,932
純資産の部		
元本等		
元本	633,966,592	603,015,885
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	587,286	617,276
（分配準備積立金）	8,145,401	5,603,004
元本等合計	633,379,306	602,398,609
純資産合計	633,379,306	602,398,609
負債純資産合計	673,422,116	665,440,541

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第28期中間計算期間 自 2021年11月 9日 至 2022年 5月 8日	第29期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
営業収益		
受取利息	825,856	1,228,514
有価証券売買等損益	859,899	1,242,509
営業収益合計	34,043	13,995
営業費用		
支払利息	20,681	40,206
受託者報酬	358	346
委託者報酬	3,527	3,221
営業費用合計	24,566	43,773
営業利益又は営業損失（ ）	58,609	57,768
経常利益又は経常損失（ ）	58,609	57,768
中間純利益又は中間純損失（ ）	58,609	57,768
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（ ）	7,119	11,369
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	561,511	587,286
剰余金増加額又は欠損金減少額	124,256	218,045
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	124,256	218,045
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,280	201,636
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,280	201,636
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	530,025	617,276

(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	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、2022年11月 8日から2023年 5月 7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28期 2022年11月 7日現在	第29期中間計算期間末 2023年 5月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 633,966,592口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 603,015,885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 587,286円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 617,276円
3. 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 0.9991円 (10,000口当たり純資産額) (9,991円)	3. 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 0.9990円 (10,000口当たり純資産額) (9,990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28期 2022年11月 7日現在	第29期中間計算期間末 2023年 5月 7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 地方債証券、特殊債券 （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。	2. 時価の算定方法 地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

1 元本の移動

第28期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日	第29期中間計算期間 自 2022年11月 8日 至 2023年 5月 7日
期首元本額 732,255,449円	期首元本額 633,966,592円
期中追加設定元本額 230,284,042円	期中追加設定元本額 201,679,969円
期中一部解約元本額 328,572,899円	期中一部解約元本額 232,630,676円

２ デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（参考）

「ミリオン（インデックスポートフォリオ）」および「ミリオン（バランスポートフォリオ）」は「ミリオン・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。

ミリオン・インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2023年 5月 7日現在)	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	685,484
コール・ローン	1,332,011,079
株式	105,830,687,070
派生商品評価勘定	29,661,985
未収入金	1,728,780,991
未収配当金	1,061,209,384
差入委託証拠金	104,710,000
流動資産合計	110,087,745,993
資産合計	110,087,745,993
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,414,829,906
未払利息	2,567
流動負債合計	1,414,832,473
負債合計	1,414,832,473
純資産の部	
元本等	
元本	56,311,350,781
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	52,361,562,739
元本等合計	108,672,913,520
純資産合計	108,672,913,520
負債純資産合計	110,087,745,993

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。
--------------------	---

2.費用・収益の計上基準	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。 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）

2023年 5月 7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	1.9299円
(10,000口当たり純資産額)	(19,299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

2023年 5月 7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

2023年 5月 7日現在	
期首	2022年11月 8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	58,870,561,339円
同期中における追加設定元本額	13,967,369,537円
同期中における一部解約元本額	16,526,580,095円

期末元本額	56,311,350,781円
期末元本額の内訳＊	
ミリオン（インデックスポートフォリオ）	10,289,354,878円
ミリオン（バランスポートフォリオ）	360,199,712円
野村インデックスファンド・日経２２５	31,135,844,066円
野村つみたて日本株投信	7,026,921,414円
野村日経２２５インデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	1,231,334,235円
日経２２５インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	679,321,393円
野村ＦｏＦｓ用・日経２２５インデックスファンド（適格機関投資家専用）	66,582,149円
野村日経２２５インデックスファンド（確定拠出年金向け）	5,521,792,934円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

２ ファンドの現況

純資産額計算書

ミリオン（インデックスポートフォリオ）

2023年5月31日現在

資産総額	20,783,709,478円
負債総額	26,681,067円
純資産総額（ - ）	20,757,028,411円
発行済口数	18,798,166,628口
１口当たり純資産額（ / ）	1.1042円

ミリオン（バランスポートフォリオ）

2023年5月31日現在

資産総額	1,389,418,920円
負債総額	27,578,839円
純資産総額（ - ）	1,361,840,081円
発行済口数	917,200,447口
１口当たり純資産額（ / ）	1.4848円

ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）

2023年5月31日現在

資産総額	6,745,823,204円
負債総額	52,339,361円
純資産総額（ - ）	6,693,483,843円
発行済口数	683,926,889口

1口当たり純資産額（ / ）	9.7868円
----------------	---------

ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）

2023年5月31日現在

資産総額	649,711,966円
負債総額	40,025,490円
純資産総額（ - ）	609,686,476円
発行済口数	610,322,191口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9990円

（参考）ミリオン・インデックスマザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	110,993,434,676円
負債総額	2,230,499,354円
純資産総額（ - ）	108,762,935,322円
発行済口数	53,177,420,838口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0453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

2023年6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。

< 更新後 >

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

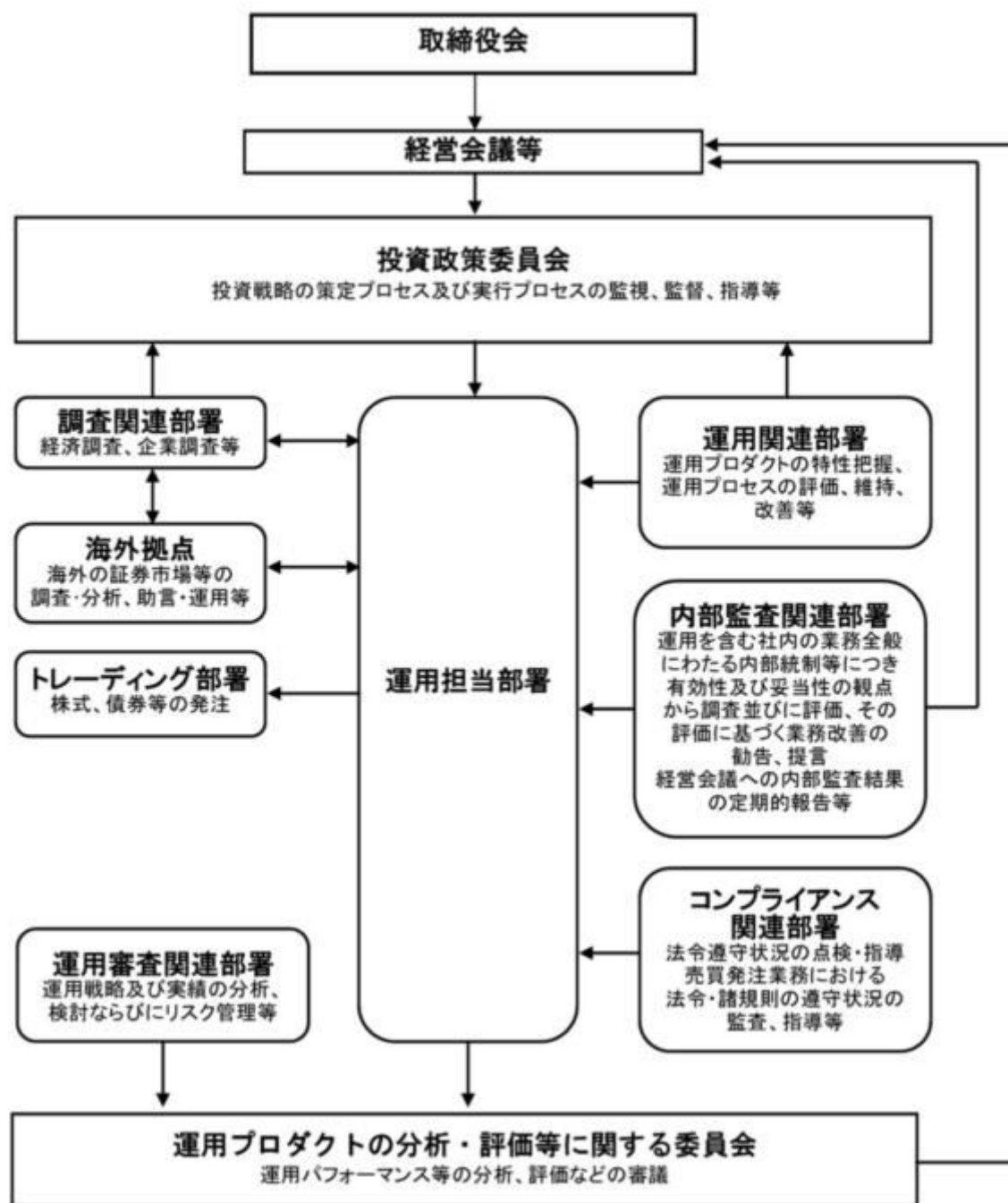
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

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

委託者の運用する証券投資信託は2023年5月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	998	42,317,159
単位型株式投資信託	191	818,734
追加型公社債投資信託	14	6,467,645
単位型公社債投資信託	475	1,049,011
合計	1,678	50,652,550

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(2022年4月1日から2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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		2,006	1,865
金銭の信託		35,894	42,108
有価証券		29,300	21,900
前払金		11	11
前払費用		454	775
未収入金		694	1,775
未収委託者報酬		27,176	26,116
未収運用受託報酬		4,002	3,780
短期貸付金		1,835	1,001
未収還付法人税等		-	2,083
その他		57	84
貸倒引当金		15	15
流動資産計		101,417	101,486
固定資産			
有形固定資産		1,744	1,335
建物	2	1,219	906

器具備品	2	525		428	
無形固定資産			5,210		5,563
ソフトウェア		5,209		5,562	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,067		16,336
投資有価証券		2,201		1,793	
関係会社株式		9,214		10,025	
長期差入保証金		443		520	
長期前払費用		13		10	
前払年金費用		1,297		1,553	
繰延税金資産		2,784		2,340	
その他		112		92	
固定資産計			23,023		23,235
資産合計			124,440		124,722

		前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023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	1					
預り金			120		124	
未払金			17,615		17,879	
未払収益分配金		0		0		
未払償還金		17		57		
未払手数料		8,357		8,409		
関係会社未払金		8,149		8,911		
その他未払金		1,089		500		
未払費用			9,512		9,682	
未払法人税等			1,319		1,024	
前受収益			22		22	
賞与引当金			4,416		3,635	
その他			121		46	
流動負債計			33,127		32,414	
固定負債						
退職給付引当金				3,194		2,940
時効後支払損引当金				588		595
資産除去債務				1,123		1,123
固定負債計				4,905		4,659
負債合計			38,033		37,074	
(純資産の部)						
株主資本			86,232		87,419	
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			55,322		56,509	
利益準備金		685		685		
その他利益剰余金		54,637		55,823		
別途積立金		24,606		24,606		
繰越利益剰余金		30,030		31,217		

評価・換算差額等			174		229
其他有価証券評価差額金			174		229
純資産合計			86,407		87,648
負債・純資産合計			124,440		124,722

(2) 損益計算書

		前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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			115,733		113,491
運用受託報酬			17,671		18,198
その他営業収益			530		331
営業収益計			133,935		132,021
営業費用					
支払手数料			39,087		38,684
広告宣伝費			804		1,187
公告費			0		0
調査費			26,650		29,050
調査費		4,867		6,045	
委託調査費		21,783		23,004	
委託計算費			1,384		1,363
営業雑経費			3,094		3,302
通信費		72		89	
印刷費		918		903	
協会費		79		83	
諸経費		2,023		2,225	
営業費用計			71,021		73,587
一般管理費					
給料			12,033		11,316
役員報酬		229		226	
給料・手当		7,375		7,752	
賞与		4,427		3,337	
交際費			47		78
寄付金			73		115
旅費交通費			65		283
租税公課			1,049		963
不動産賃借料			1,432		1,232
退職給付費用			1,212		829
固定資産減価償却費			2,525		2,409
諸経費			11,116		12,439
一般管理費計			29,556		29,669
営業利益			33,357		28,763

		前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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	3,530		7,645	
受取利息		10		45	
為替差益		-		49	
その他		1,268		637	
営業外収益計			4,809		8,377
営業外費用					
金銭の信託運用損		1,387		1,736	
時効後支払損引当金繰入額		12		10	
為替差損		23		-	
その他		266		8	
営業外費用計			1,689		1,755
経常利益			36,477		35,385
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		10	
株式報酬受入益		53		46	
固定資産売却益		9		-	
資産除去債務履行差額		141		-	
特別利益計			230		57
特別損失					
投資有価証券等売却損		0		16	
関係会社株式評価損		727		-	
固定資産除却損	2	374		52	
資産除去債務履行差額		0		-	
事務所移転費用		54		-	
特別損失計			1,158		69
税引前当期純利益			35,549		35,374
法人税、住民税及び事業税			10,474		8,890
法人税等調整額			171		419
当期純利益			24,904		26,064

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2021年4月 1 日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(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	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	116	116	116
当期変動額合計	116	116	1,247
当期末残高	174	174	86,407

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232
当期変動額									
剰余金の配当							24,877	24,877	24,877
当期純利益							26,064	26,064	26,064
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,186	1,186	1,186
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,217	56,509	87,419

(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	174	174	86,407
当期変動額			
剰余金の配当			24,877
当期純利益			26,064
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	54	54	54
当期変動額合計	54	54	1,240
当期末残高	229	229	87,648

[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 市場価格のない ... 時価法 株式等以外のもの (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) 市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．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。
6．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。

7. 収益及び費用の計上基準	(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。 (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。 当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。
-----------------------	---

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[会計方針の変更]

（時価の算定に関する会計基準の適用）

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。

これにより、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

[未適用の会計基準等]

該当事項はありません。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2022年3月31日)	当事業年度末 (2023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 1,223百万円	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 1,350百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 901百万円 器具備品 657 合計 1,559

損益計算書関係

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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 3,525百万円	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 7,634百万円
2. 固定資産除却損 建物 346百万円 器具備品 28 ソフトウェア - 合計 374	2. 固定資産除却損 建物 0百万円 器具備品 0 ソフトウェア 52 合計 52

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

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

（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

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022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

2023年5月23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	55,782百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	10,830円
基準日	2023年3月31日

効力発生日

2023年6月30日

金融商品関係

前事業年度（自 2021年4月 1 日 至 2022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

2022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。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2)その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

（注1） 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2） 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	前事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（ ）1.2	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

（ ）1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

2 非上場株式等について、前事業年度において727百万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	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

区分	貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他） （ ）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

（ ）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

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。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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

2023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。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	42,108	42,108	-
資産計	42,108	42,108	-
(2) その他（デリバティブ取引）	46	46	-
負債計	46	46	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（ ）	10,261
組合出資金等	1,557
合計	11,819

() 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,865	-	-	-
金銭の信託	42,108	-	-	-
未収委託者報酬	26,116	-	-	-
未収運用受託報酬	3,780	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	21,900	-	-	-
短期貸付金	1,001			
合計	96,772	-	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

区分	貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）	-	42,108	-	42,108
資産計	-	42,108	-	42,108
デリバティブ取引（通貨関連）	-	46	-	46
負債計	-	46	-	46

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

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。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。構成物のレベルに基づき、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

有価証券関係

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．売買目的有価証券(2022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(2022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(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2022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	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載しておりません。

５．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月 1 日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年4月 1 日 至 2023年3月31日）

１．売買目的有価証券(2023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(2023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(2023年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,919
関連会社株式	106

４．その他有価証券(2023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	21,900	21,900	-
小計	21,900	21,900	-
合計	21,900	21,900	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額235百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,557百

万円）は、記載しておりません。

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	66	-	16
合計	66	-	16

デリバティブ取引関係

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	121	121

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	952	-	46	46

退職給付関係

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	1,521
退職給付の支払額	904
その他	14
退職給付債務の期末残高	21,967

(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	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	672
年金資産の期末残高	19,687

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

積立型制度の退職給付債務	18,807 百万円
年金資産	19,687
	879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	45
確定給付制度に係る退職給付費用	959

(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	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.35%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	21,967 百万円
勤務費用	853
利息費用	188
数理計算上の差異の発生額	1,476
退職給付の支払額	1,133
その他	83
退職給付債務の期末残高	20,314

(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	19,687 百万円
期待運用収益	462
数理計算上の差異の発生額	716
事業主からの拠出額	819
退職給付の支払額	874
年金資産の期末残高	19,378

(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	17,386 百万円
年金資産	19,378
	1,991
非積立型制度の退職給付債務	2,927
未積立退職給付債務	935
未認識数理計算上の差異	398
未認識過去勤務費用	53
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387
退職給付引当金	2,940
前払年金費用	1,553
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	853 百万円
利息費用	188
期待運用収益	462
数理計算上の差異の費用処理額	127
過去勤務費用の費用処理額	52
確定給付制度に係る退職給付費用	653

(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	34%
株式	27%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	21%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企业年金制度の割引率	1.4%
退職一時金制度の割引率	1.1%
長期期待運用収益率	2.35%
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。	

税効果会計関係

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

前事業年度末 (2022年3月31日)		当事業年度末 (2023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	1,381	賞与引当金	1,138
退職給付引当金	990	退職給付引当金	911
関係会社株式評価減	1,010	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	285	未払事業税	227
投資有価証券評価減	110	投資有価証券評価減	11
減価償却超過額	272	減価償却超過額	331
時効後支払損引当金	182	時効後支払損引当金	184
関係会社株式売却損	505	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	92	ゴルフ会員権評価減	78
資産除去債務	348	資産除去債務	348
未払社会保険料	114	未払社会保険料	85
その他	84	その他	44
繰延税金資産小計	5,376	繰延税金資産小計	4,878
評価性引当額	1,795	評価性引当額	1,696
繰延税金資産合計	3,581	繰延税金資産合計	3,181
繰延税金負債		繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	233	資産除去債務に対応する除去費用	171
関係会社株式評価益	81	関係会社株式評価益	84
その他有価証券評価差額金	78	その他有価証券評価差額金	102
前払年金費用	402	前払年金費用	481
繰延税金負債合計	796	繰延税金負債合計	840
繰延税金資産の純額	2,784	繰延税金資産の純額	2,340
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	0.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.4%
タックスヘイブン税制	1.8%	タックスヘイブン税制	2.1%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.6%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
その他	0.1%	その他	0.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.3%

2. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
期首残高		1,371	1,123
有形固定資産の取得に伴う増加		48	-
資産除去債務の履行による減少		296	-
期末残高		1,123	1,123

収益認識に関する注記

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

前事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

区分	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)
委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

当事業年度（自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）

区分	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	113,491百万円
運用受託報酬	17,245百万円
成功報酬（注）	952百万円
その他営業収益	331百万円
合計	132,021百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

セグメント情報等

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2023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 2021年4月1日 至 2022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

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)
子会社	ノムラ・エー ム・ファイ ナンス・イン ク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息	9	未収利息	4

（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）	29,119	未払手数料	6,013

（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．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 2022年4月1日 至 2023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

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)
子会社	ノムラ・エー ム・ファイ ナンス・イン ク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	5,736	短期貸付金	1,001
							資金の返済	6,489		
							貸付金利息	44	未収利息	11

（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）	27,180	未払手数料	5,773

（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．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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,775円81銭	1株当たり純資産額	17,016円74銭
1株当たり当期純利益	4,835円10銭	1株当たり当期純利益	5,060円34銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	24,904百万円	損益計算書上の当期純利益	26,064百万円
普通株式に係る当期純利益	24,904百万円	普通株式に係る当期純利益	26,064百万円
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

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
株式会社りそな銀行 (再信託受託者：株式会社日本カ ストディ銀行)	279,928百万円	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。

* 2023年5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。
アイザワ証券株式会社	3,000百万円	
安藤証券株式会社	2,280百万円	
いちよし証券株式会社	14,577百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
極東証券株式会社	5,251百万円	
第四北越証券株式会社	600百万円	
丸三証券株式会社	10,000百万円	

丸八証券株式会社	3,751百万円
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円

* 2023年5月末現在

2 関係業務の概要

< 更新後 >

(1) 受託者

ファンドの受託会社（受託者）として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。なお、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

< 再信託受託者の概要 >

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金：51,000百万円

事業の内容：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に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

3 資本関係

< 訂正前 >

（持株比率5.0%以上を記載します。）

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

—
—

< 訂正後 >

（2023年3月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。）

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月4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

湯 原 尚

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」に掲げられているミリオン（インデックスポートフォリオ）の2022年11月8日から2023年5月7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、ミリオン（インデックスポートフォリオ）の2023年5月7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（2022年11月8日から2023年5月7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. 上記の中間監査報告書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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月4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

湯 原 尚

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」に掲げられているミリオン（バランスポートフォリオ）の2022年11月8日から2023年5月7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、ミリオン（バランスポートフォリオ）の2023年5月7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（2022年11月8日から2023年5月7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. 上記の中間監査報告書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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月4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

湯 原 尚

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」に掲げられているミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）の2022年11月8日から2023年5月7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、ミリオン（ジャパン ドリーム ポートフォリオ）の2023年5月7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（2022年11月8日から2023年5月7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. 上記の中間監査報告書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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月4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

湯 原 尚

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」に掲げられているミリオン（リザーブ ポートフォリオ）の2022年11月8日から2023年5月7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、ミリオン（リザーブ ポートフォリオ）の2023年5月7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（2022年11月8日から2023年5月7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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年6月9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 湯 原 尚
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水 永 真太郎
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、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64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2023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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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．上記の監査報告書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。