

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年9月18日提出
【計算期間】	第5期中(自 2019年12月27日至 2020年6月26日)
【ファンド名】	野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	CEO兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【電話番号】	03-6387-5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1 【ファンドの運用状況】

以下は2020年7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】

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	118,132,824	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	107,710	0.09
合計（純資産総額）		118,240,534	100.00

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	43,955,509	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	40,277	0.09
合計（純資産総額）		43,995,786	100.00

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	31,121,521	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	28,574	0.09
合計（純資産総額）		31,150,095	100.00

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	19,368,574	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	19,661	0.10
合計（純資産総額）		19,388,235	100.00

（参考）国内株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	409,295,959,230	97.52

現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	10,366,971,303	2.47
合計（純資産総額）		419,662,930,533	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	10,355,780,000	2.46

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	462,298,612,228	68.42
	カナダ	22,888,906,174	3.38
	ドイツ	21,071,714,527	3.11
	イタリア	5,078,406,684	0.75
	フランス	23,914,577,714	3.53
	オランダ	9,849,730,969	1.45
	スペイン	5,332,175,304	0.78
	ベルギー	2,173,194,136	0.32
	オーストリア	376,244,981	0.05
	ルクセンブルグ	249,997,820	0.03
	フィンランド	2,250,200,835	0.33
	アイルランド	1,386,592,588	0.20
	ポルトガル	384,952,081	0.05
	イギリス	31,023,481,188	4.59
	スイス	23,451,587,025	3.47
	スウェーデン	7,340,294,962	1.08
	ノルウェー	1,210,958,312	0.17
	デンマーク	5,594,471,003	0.82
	オーストラリア	14,615,070,562	2.16
	ニュージーランド	755,185,800	0.11
	香港	6,484,037,246	0.95
	シンガポール	2,019,780,191	0.29
	イスラエル	684,076,227	0.10
	小計	650,434,248,557	96.26
新株予約権証券	アメリカ	12,996,550	0.00
投資証券	アメリカ	14,010,528,247	2.07
	カナダ	117,180,818	0.01
	フランス	372,900,050	0.05
	イギリス	377,695,771	0.05

	オーストラリア	986,444,067	0.14
	香港	318,635,100	0.04
	シンガポール	380,174,959	0.05
	小計	16,563,559,012	2.45
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	8,632,205,284	1.27
合計（純資産総額）		675,643,009,403	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	6,116,746,497	0.90
	買建	カナダ	288,456,614	0.04
	買建	ドイツ	923,199,491	0.13
	買建	イギリス	399,497,888	0.05
	買建	スイス	302,181,708	0.04
	買建	オーストラリア	192,641,948	0.02

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	6,872,814,031	15.80
	メキシコ	671,279,058	1.54
	ブラジル	2,323,679,195	5.34
	チリ	116,859,945	0.26
	コロンビア	37,410,092	0.08
	ギリシャ	51,735,888	0.11
	イギリス	38,621,184	0.08
	トルコ	161,461,046	0.37
	チェコ	40,556,600	0.09
	ハンガリー	86,911,641	0.19
	ポーランド	293,786,577	0.67
	香港	9,758,471,927	22.44
	マレーシア	731,676,521	1.68
	タイ	835,416,741	1.92
	フィリピン	314,494,635	0.72
	インドネシア	586,120,226	1.34
	韓国	4,841,702,427	11.13
	台湾	5,454,967,989	12.54
	インド	3,393,290,297	7.80
	パキスタン	10,228,502	0.02

	カタール	327,807,484	0.75
	エジプト	43,468,641	0.09
	南アフリカ	1,558,250,500	3.58
	アラブ首長国連邦	200,597,950	0.46
	サウジアラビア	1,042,759,136	2.39
	小計	39,794,368,233	91.51
投資信託受益証券	アメリカ	1,750,484,661	4.02
投資証券	メキシコ	17,614,624	0.04
	南アフリカ	16,497,625	0.03
	小計	34,112,249	0.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,907,363,444	4.38
合計（純資産総額）		43,486,328,587	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	1,599,689,640	3.67
	買建	シンガポール	267,841,375	0.61

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	541,844,415,910	78.76
地方債証券	日本	47,929,725,131	6.96
特殊債券	日本	61,096,092,824	8.88
社債券	日本	30,297,723,900	4.40
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,754,000,817	0.98
合計（純資産総額）		687,921,958,582	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	30,492,825,527	43.77
	カナダ	1,268,132,936	1.82
	メキシコ	548,468,311	0.78
	ドイツ	4,983,862,728	7.15
	イタリア	6,723,718,539	9.65
	フランス	7,041,145,044	10.10
	オランダ	1,516,997,313	2.17

	スペイン	4,508,385,393	6.47
	ベルギー	1,808,839,114	2.59
	オーストリア	970,269,963	1.39
	フィンランド	374,472,673	0.53
	アイルランド	714,518,168	1.02
	イギリス	4,619,888,608	6.63
	スウェーデン	203,880,669	0.29
	ノルウェー	145,386,007	0.20
	デンマーク	310,438,814	0.44
	ポーランド	393,847,900	0.56
	オーストラリア	1,490,355,091	2.13
	シンガポール	657,551,406	0.94
	イスラエル	226,738,667	0.32
	小計	68,999,722,871	99.05
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	659,635,931	0.94
合計（純資産総額）		69,659,358,802	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	258,288,190,998	43.81
	カナダ	10,792,104,982	1.83
	メキシコ	4,378,996,147	0.74
	ドイツ	40,741,052,706	6.91
	イタリア	59,474,640,859	10.09
	フランス	59,254,485,045	10.05
	オランダ	10,085,137,807	1.71
	スペイン	38,985,245,621	6.61
	ベルギー	14,458,907,858	2.45
	オーストリア	8,105,454,952	1.37
	フィンランド	2,684,427,180	0.45
	アイルランド	6,501,827,277	1.10
	イギリス	38,710,351,917	6.56
	スウェーデン	1,763,187,008	0.29
	ノルウェー	1,265,980,688	0.21
	デンマーク	3,098,981,281	0.52
	ポーランド	3,691,681,117	0.62
	オーストラリア	13,026,749,856	2.21
	シンガポール	2,508,516,782	0.42
	マレーシア	2,957,414,997	0.50
	イスラエル	2,186,033,457	0.37

	小計	582,959,368,535	98.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,473,355,112	1.09
合計（純資産総額）		589,432,723,647	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	654,865,764	9.74
	ブラジル	635,874,820	9.46
	チリ	156,267,369	2.32
	コロンビア	375,179,621	5.58
	ペルー	230,115,566	3.42
	ウルグアイ	9,490,089	0.14
	ドミニカ共和国	14,131,348	0.21
	トルコ	182,711,970	2.71
	チェコ	341,301,309	5.07
	ハンガリー	247,764,284	3.68
	ポーランド	575,215,113	8.56
	ロシア	533,931,247	7.94
	ルーマニア	198,738,805	2.95
	マレーシア	450,908,378	6.71
	タイ	572,988,829	8.52
	フィリピン	26,940,453	0.40
	インドネシア	617,575,632	9.19
	南アフリカ	474,566,933	7.06
	中国	245,777,633	3.65
	小計	6,544,345,163	97.39
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	175,068,496	2.60
合計（純資産総額）		6,719,413,659	100.00

（２）【運用実績】

①【純資産の推移】

野村ターゲットデットファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型

2020年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544
第2計算期間	(2017年12月26日)	87	87	1.1699	1.1699

第3計算期間	(2018年12月26日)	88	88	1.0553	1.0553
第4計算期間	(2019年12月26日)	114	114	1.1863	1.1863
	2019年 7月末日	105	—	1.1394	—
	8月末日	104	—	1.1234	—
	9月末日	107	—	1.1439	—
	10月末日	110	—	1.1657	—
	11月末日	112	—	1.1751	—
	12月末日	115	—	1.1888	—
	2020年 1月末日	115	—	1.1839	—
	2月末日	112	—	1.1482	—
	3月末日	107	—	1.0880	—
	4月末日	110	—	1.1165	—
	5月末日	114	—	1.1405	—
	6月末日	116	—	1.1532	—
	7月末日	118	—	1.1579	—

野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型

2020年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
第2計算期間	(2017年12月26日)	21	21	1.1664	1.1664
第3計算期間	(2018年12月26日)	27	27	1.0377	1.0377
第4計算期間	(2019年12月26日)	40	40	1.1878	1.1878
	2019年 7月末日	35	—	1.1289	—
	8月末日	35	—	1.1051	—
	9月末日	36	—	1.1319	—
	10月末日	38	—	1.1598	—
	11月末日	39	—	1.1723	—
	12月末日	40	—	1.1903	—
	2020年 1月末日	40	—	1.1813	—
	2月末日	39	—	1.1339	—
	3月末日	37	—	1.0599	—
	4月末日	39	—	1.0958	—
	5月末日	41	—	1.1259	—
	6月末日	42	—	1.1411	—
	7月末日	43	—	1.1452	—

野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型

2020年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
第2計算期間	(2017年12月26日)	15	15	1.1589	1.1589
第3計算期間	(2018年12月26日)	19	19	1.0320	1.0320
第4計算期間	(2019年12月26日)	28	28	1.1848	1.1848
	2019年 7月末日	25	—	1.1214	—
	8月末日	24	—	1.0955	—
	9月末日	25	—	1.1239	—
	10月末日	27	—	1.1540	—
	11月末日	27	—	1.1676	—
	12月末日	28	—	1.1873	—
	2020年 1月末日	29	—	1.1764	—
	2月末日	29	—	1.1237	—
	3月末日	27	—	1.0440	—
	4月末日	28	—	1.0831	—
	5月末日	29	—	1.1158	—
	6月末日	30	—	1.1320	—
	7月末日	31	—	1.1359	—

野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型

2020年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
第2計算期間	(2017年12月26日)	10	10	1.1478	1.1478
第3計算期間	(2018年12月26日)	13	13	1.0248	1.0248
第4計算期間	(2019年12月26日)	18	18	1.1734	1.1734
	2019年 7月末日	16	—	1.1115	—
	8月末日	16	—	1.0864	—
	9月末日	16	—	1.1141	—
	10月末日	17	—	1.1436	—
	11月末日	18	—	1.1567	—
	12月末日	18	—	1.1760	—
	2020年 1月末日	19	—	1.1656	—
	2月末日	18	—	1.1145	—
	3月末日	17	—	1.0354	—
	4月末日	17	—	1.0740	—
	5月末日	18	—	1.1072	—

6月末日	19	—	1.1239	—
7月末日	19	—	1.1277	—

②【分配の推移】

野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型

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

野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型

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

野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型

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

野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型

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

③【収益率の推移】

野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.4%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	11.0%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△9.8%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	12.4%
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	△2.6%

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

野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.9%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	△3.7%

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

野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.7%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.7%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.8%
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	△4.2%

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

野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.3%

第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△10.7%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26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。

2【設定及び解約の実績】

野村ターゲットデートファンド2016 2026－2028年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	55,225,894	2,600,834	52,625,060
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	24,780,288	2,633,235	74,772,113
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	18,821,572	10,010,450	83,583,235
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	16,232,168	3,027,760	96,787,643
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	6,268,305	1,904,759	101,151,189

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029－2031年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	9,846,136	172	9,845,964
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	8,525,619	19,110	18,352,473
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	8,382,826	156,480	26,578,819
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	7,806,968	403,555	33,982,232
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	4,224,592	942,706	37,264,118

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032－2034年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,747,567	22	6,747,545
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	6,892,208	7,296	13,632,457
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	5,291,632	64,250	18,859,839
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	5,443,331	88,292	24,214,878
第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	3,410,980	539,348	27,086,510

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,671,960	59,305	6,612,655
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	2,418,017	29,744	9,000,928
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	4,410,696	625,991	12,785,633
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	3,370,205	55,192	16,100,646

第5期（中間期）	2019年12月27日～2020年 6月26日	1,745,496	892,611	16,953,531
----------	-------------------------	-----------	---------	------------

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

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

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間(2019年12月27日から2020年6月26日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年 6月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	655,248	694,171
親投資信託受益証券	114,701,262	116,764,859
未収入金	27,748	-
流動資産合計	115,384,258	117,459,030
資産合計	115,384,258	117,459,030
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,594	31,024
未払委託者報酬	532,604	558,368
その他未払費用	1,724	1,799
流動負債合計	563,922	591,191
負債合計	563,922	591,191
純資産の部		
元本等		
元本	96,787,643	101,151,189
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	18,032,693	15,716,650
（分配準備積立金）	11,895,922	11,674,065
元本等合計	114,820,336	116,867,839
純資産合計	114,820,336	116,867,839
負債純資産合計	115,384,258	117,459,030

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 2018年12月27日 至 2019年 6月26日	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	6,482,923	△2,314,700
営業収益合計	6,482,923	△2,314,700
営業費用		
支払利息	32	16
受託者報酬	26,393	31,024
委託者報酬	475,015	558,368
その他費用	1,522	1,799
営業費用合計	502,962	591,207
営業利益又は営業損失（△）	5,979,961	△2,905,907
経常利益又は経常損失（△）	5,979,961	△2,905,907
中間純利益又は中間純損失（△）	5,979,961	△2,905,907
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（△）	25,542	△64,606
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,622,437	18,032,693
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,120,444	872,482
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,120,444	872,482
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,448	347,224
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,448	347,224
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	11,677,852	15,716,650

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの中間計算期間は、2019年12月27日から2020年 6月26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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 96,787,643口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 101,151,189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 1.1863円 (10,000口当たり純資産額) (11,863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 1.1554円 (10,000口当たり純資産額) (11,554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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
---	---

（その他の注記）

1 元本の移動

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日		第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	
期首元本額	83,583,235円	期首元本額	96,787,643円
期中追加設定元本額	16,232,168円	期中追加設定元本額	6,268,305円
期中一部解約元本額	3,027,760円	期中一部解約元本額	1,904,759円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年 6月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	224,672	253,563
親投資信託受益証券	40,321,608	42,588,208
未収入金	9,770	-
流動資産合計	40,556,050	42,841,771
資産合計	40,556,050	42,841,771
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	10,139	11,018
未払委託者報酬	182,255	198,299
その他未払費用	563	590
流動負債合計	192,957	209,907
負債合計	192,957	209,907
純資産の部		
元本等		
元本	33,982,232	37,264,118
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,380,861	5,367,746
（分配準備積立金）	3,802,025	3,702,599
元本等合計	40,363,093	42,631,864
純資産合計	40,363,093	42,631,864
負債純資産合計	40,556,050	42,841,771

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 2018年12月27日 至 2019年 6月26日	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,199,807	△1,192,283
営業収益合計	2,199,807	△1,192,283
営業費用		
支払利息	2	2
受託者報酬	8,655	11,018
委託者報酬	155,730	198,299
その他費用	452	590
営業費用合計	164,839	209,909
営業利益又は営業損失（△）	2,034,968	△1,402,192
経常利益又は経常損失（△）	2,034,968	△1,402,192
中間純利益又は中間純損失（△）	2,034,968	△1,402,192
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（△）	2,684	7,464
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,002,476	6,380,861
剰余金増加額又は欠損金減少額	470,855	570,692
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	470,855	570,692
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,401	174,151
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,401	174,151
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,504,214	5,367,746

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの中間計算期間は、2019年12月27日から2020年 6月26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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 33,982,232口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 37,264,118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 1.1878円 (10,000口当たり純資産額) (11,878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 1.1440円 (10,000口当たり純資産額) (11,440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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
---	---

（その他の注記）

1 元本の移動

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日		第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	
期首元本額	26,578,819円	期首元本額	33,982,232円
期中追加設定元本額	7,806,968円	期中追加設定元本額	4,224,592円
期中一部解約元本額	403,555円	期中一部解約元本額	942,706円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【野村ターゲットデットファンド2016 2032－2034年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年 6月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	158,625	183,255
親投資信託受益証券	28,659,353	30,720,673
未収入金	6,958	-
流動資産合計	28,824,936	30,903,928
資産合計	28,824,936	30,903,928
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	7,155	7,960
未払委託者報酬	128,700	143,287
その他未払費用	380	408
流動負債合計	136,235	151,655
負債合計	136,235	151,655
純資産の部		
元本等		
元本	24,214,878	27,086,510
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,473,823	3,665,763
（分配準備積立金）	2,683,561	2,630,665
元本等合計	28,688,701	30,752,273
純資産合計	28,688,701	30,752,273
負債純資産合計	28,824,936	30,903,928

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 2018年12月27日 至 2019年 6月26日	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,522,645	△1,044,666
営業収益合計	1,522,645	△1,044,666
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	6,121	7,960
委託者報酬	110,046	143,287
その他費用	329	408
営業費用合計	116,497	151,655
営業利益又は営業損失（△）	1,406,148	△1,196,321
経常利益又は経常損失（△）	1,406,148	△1,196,321
中間純利益又は中間純損失（△）	1,406,148	△1,196,321
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	-	△51,993
期首剰余金又は期首欠損金（△）	602,981	4,473,823
剰余金増加額又は欠損金減少額	307,866	432,158
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	307,866	432,158
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	95,890
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	95,890
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,316,995	3,665,763

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの中間計算期間は、2019年12月27日から2020年 6月26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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 24,214,878口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 27,086,510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 1.1848円 (10,000口当たり純資産額) (11,848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 1.1353円 (10,000口当たり純資産額) (11,353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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
---	---

（その他の注記）

1 元本の移動

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日		第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	
期首元本額	18,859,839円	期首元本額	24,214,878円
期中追加設定元本額	5,443,331円	期中追加設定元本額	3,410,980円
期中一部解約元本額	88,292円	期中一部解約元本額	539,348円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【野村ターゲットデットファンド2016 2035－2037年目標型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2019年12月26日現在)	第5期中間計算期間末 (2020年 6月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,681	115,779
親投資信託受益証券	18,873,776	19,089,827
未収入金	14,657	-
流動資産合計	18,992,114	19,205,606
資産合計	18,992,114	19,205,606
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,970	-
未払受託者報酬	4,679	5,047
未払委託者報酬	84,113	90,815
その他未払費用	216	230
流動負債合計	99,978	96,092
負債合計	99,978	96,092
純資産の部		
元本等		
元本	16,100,646	16,953,531
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,791,490	2,155,983
（分配準備積立金）	1,821,641	1,728,875
元本等合計	18,892,136	19,109,514
純資産合計	18,892,136	19,109,514
負債純資産合計	18,992,114	19,205,606

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 2018年12月27日 至 2019年 6月26日	第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	993,610	△686,052
営業収益合計	993,610	△686,052
営業費用		
支払利息	1	1
受託者報酬	3,990	5,047
委託者報酬	71,718	90,815
その他費用	199	230
営業費用合計	75,908	96,093
営業利益又は営業損失（△）	917,702	△782,145
経常利益又は経常損失（△）	917,702	△782,145
中間純利益又は中間純損失（△）	917,702	△782,145
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	-	△120,155
期首剰余金又は期首欠損金（△）	316,530	2,791,490
剰余金増加額又は欠損金減少額	138,544	176,415
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	138,544	176,415
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	149,932
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	149,932
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,372,776	2,155,983

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの中間計算期間は、2019年12月27日から2020年 6月26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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 16,100,646口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 16,953,531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 1.1734円 (10,000口当たり純資産額) (11,734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 1.1272円 (10,000口当たり純資産額) (11,272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4期 2019年12月26日現在	第5期中間計算期間末 2020年 6月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評 価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
---	---

（その他の注記）

1 元本の移動

第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日		第5期中間計算期間 自 2019年12月27日 至 2020年 6月26日	
期首元本額	12,785,633円	期首元本額	16,100,646円
期中追加設定元本額	3,370,205円	期中追加設定元本額	1,745,496円
期中一部解約元本額	55,192円	期中一部解約元本額	892,611円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（参考）

「野村ターゲットデートファンド2016」の各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOK USA Iマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	21,891,692,838
株式	430,539,086,490
派生商品評価勘定	3,626,250
未収入金	8,518,800
未収配当金	1,364,882,455
未収利息	1,465,545
その他未収収益	21,438,845
差入委託証拠金	543,300,000
流動資産合計	454,374,011,223
資産合計	454,374,011,223
負債の部	

(2020年 6月26日現在)

流動負債	
派生商品評価勘定	110,043,155
未払金	440,990
未払解約金	389,685,591
未払利息	22,233
有価証券貸借取引受入金	15,156,051,820
流動負債合計	15,656,243,789
負債合計	15,656,243,789
純資産の部	
元本等	
元本	271,852,039,350
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	166,865,728,084
元本等合計	438,717,767,434
純資産合計	438,717,767,434
負債純資産合計	454,374,011,223

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月26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	1.6138円
(10,000口当たり純資産額)	(16,138円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	14,335,755,540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

2020年 6月26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

2020年 6月26日現在	
期首	2019年12月27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	262,681,989,592円
同期中における追加設定元本額	35,079,104,720円
同期中における一部解約元本額	25,909,054,962円
期末元本額	271,852,039,350円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	163,615,021円
バランスセレクト50	370,477,246円
バランスセレクト70	475,887,271円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,674,971,616円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,507,493,670円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,741,165,048円
野村資産設計ファンド2015	47,988,278円
野村資産設計ファンド2020	48,943,490円
野村資産設計ファンド2025	89,861,919円
野村資産設計ファンド2030	110,901,557円
野村資産設計ファンド2035	86,144,687円
野村資産設計ファンド2040	178,589,959円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	92,503,412,796円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,825,501,687円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,875,761,120円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,435,585,576円
野村資産設計ファンド2045	27,180,575円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,882,985,664円
マイ・ロード	3,759,248,559円

ネクストコア	14,802,055円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,463,411,368円
野村T O P I Xインデックス（野村SMA・EW向け）	3,185,681,065円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	544,295,342円
野村資産設計ファンド2050	44,352,099円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	14,687,417円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,884,813円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,449,794円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,455,180円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	309,561,400円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	330,691,036円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	4,846,068円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	4,900,929円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	20,095,260円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	6,331,189円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	22,025,091円
野村6資産均等バランス	1,290,446,858円
世界6資産分散ファンド	114,106,502円
野村資産設計ファンド2060	16,486,056円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	495,620,340円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	421,664,521円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	296,828,702円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	650,770,959円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	745,639,764円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	4,099,181円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	9,397,259円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	1,389,813円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,840,573,301円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	12,682,696円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	108,104,054円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	92,175,344円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	32,668,755円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	103,916,500円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	263,093,259円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	4,514,985,551円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	77,186,924円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	181,654,434円
ノムラFOFs用インデックスファンド・T O P I X（適格機関投資家専用）	3,250,257,233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）	185,719,927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）	522,980,450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）	299,898円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	7,366,863円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	29,864,830円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	36,673,259円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	128,327,475円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	10,064,293,924円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	25,560,752,670円

マイバランス70（確定拠出年金向け）	27,437,746,907円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX（確定拠出年金向け）	31,837,006,440円
マイバランスDC30	3,330,078,843円
マイバランスDC50	5,191,337,144円
マイバランスDC70	4,898,984,649円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,022,631,489円
野村DC運用戦略ファンド	219,548,236円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	17,483,123円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	934,971,683円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	724,200,769円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	579,075,669円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	7,218,362円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,568,759円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	46,430,913円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	11,001,512円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	8,111,248円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	7,699,733円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	281,485,818円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	213,084,387円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	105,998,125円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	123,640,790円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	3,521,604円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	3,804,193,027
コール・ローン	378,874,247
株式	630,882,649,210
投資証券	16,131,573,464
派生商品評価勘定	25,322,952
未収入金	9,075,873
未収配当金	619,229,523
差入委託証拠金	3,474,518,875
流動資産合計	655,325,437,171
資産合計	655,325,437,171
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,101,007
未払解約金	355,054,502
未払利息	384
その他未払費用	3,510,800
流動負債合計	368,666,693
負債合計	368,666,693
純資産の部	

(2020年 6月26日現在)

元本等	
元本	232,557,037,175
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	422,399,733,303
元本等合計	654,956,770,478
純資産合計	654,956,770,478
負債純資産合計	655,325,437,171

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月26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	2.8163円

(10,000口当たり純資産額)

(28,163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

2020年 6月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
先物取引	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
為替予約取引	
1）計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。	
①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当	
該為替予約は当該仲値で評価しております。	
②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の	
仲値をもとに計算したレートを用いております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物	
相場の仲値を用いております。	
2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しており	
ます。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月26日現在	
期首	2019年12月27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	216,536,356,000円
同期中における追加設定元本額	34,609,598,612円
同期中における一部解約元本額	18,588,917,437円
期末元本額	232,557,037,175円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	47,177,554円
バランスセレクト50	140,644,298円
バランスセレクト70	152,228,214円
野村外国株式インデックスファンド	518,222,492円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	4,653,009,872円

野村世界6資産分散投信（分配コース）	6,101,149,881円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,488,485,734円
野村資産設計ファンド2015	16,138,465円
野村資産設計ファンド2020	15,964,155円
野村資産設計ファンド2025	30,285,637円
野村資産設計ファンド2030	37,327,921円
野村資産設計ファンド2035	29,100,794円
野村資産設計ファンド2040	60,139,628円
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	35,938,073,656円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,037,611,878円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,157,050,880円
のむラップ・ファンド（積極型）	5,886,571,570円
野村資産設計ファンド2045	9,145,904円
野村インデックスファンド・外国株式	5,403,532,348円
マイ・ロード	1,355,195,966円
ネクストコア	11,707,262円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	129,203,677円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,314,246,801円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	244,312,661円
野村資産設計ファンド2050	14,962,366円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,967,845円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,322,367円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,836,938円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,168,100円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	198,270,024円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	474,506,001円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,746,458円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,431,126円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	22,208,634円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	8,423,895円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	30,375,897円
野村6資産均等バランス	748,227,484円
野村つみたて外国株投信	5,037,603,868円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	3,682,052,951円
世界6資産分散ファンド	66,163,541円
野村資産設計ファンド2060	5,544,194円
野村スリーゼロ先進国株式投信	14,615,357円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	507,324,253円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,170,680,373円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	244,498,030円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	172,107,396円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,128,299,901円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,154,637,403円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,375,920円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	6,658,552円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	1,772,579円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	2,941,025円

野村ワールド・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	41,780,856円
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	13,770,785円
野村世界インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	14,207,472円
野村グローバル・インデックス・バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	40,169,972円
野村グローバル・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	152,519,086円
野村グローバル・インデックス・バランス７５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,991,864,127円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	44,948,890円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	117,504,104円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	685,417,976円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	16,006,463,833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）	173,891円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	2,123,889円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	11,404,205円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	11,812,192円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI（確定拠出年金向け）	70,217,433,269円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	2,887,720,453円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	9,848,451,430円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	8,750,088,071円
マイバランスDC３０	954,054,559円
マイバランスDC５０	1,993,489,882円
マイバランスDC７０	1,563,932,491円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	23,444,039,374円
野村DC運用戦略ファンド	173,609,662円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	13,140,801円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	310,146,582円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	259,124,403円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	209,378,378円
野村世界６資産分散投信（DC）安定コース	12,556,060円
野村世界６資産分散投信（DC）インカムコース	6,207,879円
野村世界６資産分散投信（DC）成長コース	26,921,593円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０３０	3,702,876円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０４０	2,731,398円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０５０	2,597,506円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	107,455,848円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	73,685,754円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	34,144,382円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	39,827,473円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０６０	1,186,047円

※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 6月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,038,051,227
コール・ローン	168,738,059
株式	37,024,561,511
投資信託受益証券	1,518,776,282
投資証券	35,794,242
派生商品評価勘定	6,898,066
未収入金	21,952,129
未収配当金	114,839,196
差入委託証拠金	503,105,681
流動資産合計	40,432,716,393
資産合計	40,432,716,393
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	338,558
未払解約金	9,569,678
未払利息	171
その他未払費用	1,821,500
流動負債合計	11,729,907
負債合計	11,729,907
純資産の部	
元本等	
元本	33,829,993,731
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,590,992,755
元本等合計	40,420,986,486
純資産合計	40,420,986,486
負債純資産合計	40,432,716,393

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資信託受益証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。 投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
-------------------	--

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月26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	1.1948円
(10,000口当たり純資産額)	(11,948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

2020年 6月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

先物取引

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月26日現在		
期首		2019年12月27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		32,739,805,679円
同期中における追加設定元本額		4,232,617,579円
同期中における一部解約元本額		3,142,429,527円
期末元本額		33,829,993,731円
期末元本額の内訳※		
野村資産設計ファンド2015		29,311,940円
野村資産設計ファンド2020		28,707,810円
野村資産設計ファンド2025		54,756,510円
野村資産設計ファンド2030		67,701,995円
野村資産設計ファンド2035		52,317,639円
野村資産設計ファンド2040		108,947,820円
野村資産設計ファンド2045		16,593,786円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,667,616,838円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		324,123,370円
野村資産設計ファンド2050		26,988,431円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		9,003,956円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		4,188,704円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		3,319,110円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		2,112,648円

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,781,634円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,942,814円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	10,835,404円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	3,339,055円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	10,884,789円
野村つみたて外国株投信	1,814,690,830円
野村外国株（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	572,155,913円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	1,325,491,848円
世界6資産分散ファンド	165,960,709円
野村資産設計ファンド2060	10,071,489円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・マーケット・インデックス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	507,006,561円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	100,278,216円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	11,865,740円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式（適格機関投資家専用）	444,279,975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）	109,101円
野村新興国株式インデックスファンド（確定拠出年金向け）	24,435,119,317円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	6,713,123円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,946,167円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	4,683,478円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	2,147,011円

※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2020年 6月26日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,399,961,360
国債証券	542,270,840,160
地方債証券	48,222,914,856
特殊債券	63,007,720,619
社債券	28,545,053,900
未収入金	545,687,500
未収利息	974,145,888
前払費用	23,115,324
流動資産合計	687,989,439,607
資産合計	687,989,439,607
負債の部	
流動負債	
未払解約金	401,369,110
未払利息	4,468
流動負債合計	401,373,578
負債合計	401,373,578
純資産の部	
元本等	
元本	517,163,179,408
剰余金	

(2020年 6月26日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（△）	170,424,886,621
元本等合計	687,588,066,029
純資産合計	687,588,066,029
負債純資産合計	687,989,439,607

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月26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	1.3295円
(10,000口当たり純資産額)	(13,295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

2020年 6月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月26日現在	
期首	2019年12月27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	528,330,983,939円
同期中における追加設定元本額	40,818,992,641円
同期中における一部解約元本額	51,986,797,172円
期末元本額	517,163,179,408円
期末元本額の内訳※	
野村国内債券インデックスファンド	464,889,075円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	38,524,805,345円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	16,838,249,046円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,654,472,536円
野村資産設計ファンド2015	345,552,140円
野村資産設計ファンド2020	356,689,500円
野村資産設計ファンド2025	289,834,795円
野村資産設計ファンド2030	214,241,836円
野村資産設計ファンド2035	107,880,899円
野村資産設計ファンド2040	156,623,134円
野村日本債券インデックスファンド	905,951,553円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	154,118,786,462円
のむラップ・ファンド（保守型）	12,667,502,760円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,010,629,020円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,158,950,511円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,843,100,833円
野村資産設計ファンド2045	15,508,361円
野村円債投資インデックスファンド	1,039,504,107円
野村インデックスファンド・国内債券	3,132,948,980円
マイ・ロード	34,298,779,864円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,170,887,189円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	14,666,887,628円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	3,843,196,593円
野村資産設計ファンド2050	19,355,435円
野村ターゲットデートファンド2016 2026－2028年目標型	19,183,066円
野村ターゲットデートファンド2016 2029－2031年目標型	5,089,295円
野村ターゲットデートファンド2016 2032－2034年目標型	3,077,708円
野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型	1,714,804円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	765,736,349円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	228,123,713円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	57,867,127円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	29,103,574円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	73,320,565円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	13,725,547円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	13,394,659円
野村6資産均等バランス	1,548,745,724円
世界6資産分散ファンド	136,947,054円

2020年 6月26日現在	
野村資産設計ファンド2060	5,653,127円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA－BP I 総合連動型上場投信	1,451,675,639円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	16,623,876,245円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	607,282,053円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	142,497,201円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,952,577,109円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,342,333,212円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	18,039,499円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	10,024,225円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	667,038円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,409,168,345円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	12,175,927円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	86,486,881円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	78,426,591円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	332,579,323円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	315,745,495円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	774,102,407円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	185,899,437円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	288,590,995円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	3,083,035,784円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2％コース向け）（適格機関投資家専用）	1,439,606円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	33,485,706,899円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	41,121,775,009円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	14,724,651,529円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA－BP I 総合（確定拠出年金向け）	49,098,811,909円
マイバランスDC30	11,123,892,682円
マイバランスDC50	8,408,532,248円
マイバランスDC70	2,643,496,382円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA－BP I 総合	12,516,377,931円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	626,051,603円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	1,447,520,318円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	636,418,698円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	103,958,454円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	17,132,414円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	15,921,325円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	21,254,576円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	7,113,901円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	3,360,339円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	389,237,440円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	184,734,609円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	56,540,007円

2020年 6月26日現在	
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	65,950,639円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,207,570円

※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	151,240,683
コール・ローン	141,332,288
国債証券	67,274,453,006
派生商品評価勘定	153,533,530
未収入金	163,440
未収利息	379,917,134
前払費用	30,152,075
差入委託証拠金	3,753,666
流動資産合計	68,134,545,822
資産合計	68,134,545,822
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	273,730,437
未払金	302,120
未払解約金	65,852,093
未払利息	143
その他未払費用	748,100
流動負債合計	340,632,893
負債合計	340,632,893
純資産の部	
元本等	
元本	54,341,398,237
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,452,514,692
元本等合計	67,793,912,929
純資産合計	67,793,912,929
負債純資産合計	68,134,545,822

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月26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	1,2476円
(10,000口当たり純資産額)	(12,476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

2020年 6月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 為替予約取引 1）計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。 ①計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。 ②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。 ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。 2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月26日現在

期首	2019年12月27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	52,581,841,715円
同期中における追加設定元本額	10,491,842,641円
同期中における一部解約元本額	8,732,286,119円
期末元本額	54,341,398,237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	1,259,165,127円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	811,319,445円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	20,622,515円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	5,472,466円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	3,309,428円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,843,912円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	5,986,977,854円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	12,607,088円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	6,000,511円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	14,376,152円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,864,025円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	2,865,114円
野村外国債券インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	28,404,353,944円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	7,951,687,468円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	3,642,902,470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）	35,551,865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）	131,720,238円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	6,047,758,615円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	51,759,329
コール・ローン	343,972,781
国債証券	577,724,430,831
派生商品評価勘定	429,908
未収入金	539,549,736
未収利息	4,638,210,425
前払費用	372,517,061
その他未収収益	10,935,156
流動資産合計	583,681,805,227
資産合計	583,681,805,227
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	304,244
未払解約金	777,869,215
未払利息	349
その他未払費用	7,999,743
流動負債合計	786,173,551

(2020年 6月26日現在)

負債合計	786,173,551
純資産の部	
元本等	
元本	240,693,318,139
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	342,202,313,537
元本等合計	582,895,631,676
純資産合計	582,895,631,676
負債純資産合計	583,681,805,227

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 6月26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	2.4217円
(10,000口当たり純資産額)	(24,217円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	152,217,916,741円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	160,131,012,046円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月26日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月26日現在	
期首	2019年12月27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	260,083,815,731円
同期中における追加設定元本額	17,358,836,143円
同期中における一部解約元本額	36,749,333,735円
期末元本額	240,693,318,139円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	81,788,029円
バランスセレクト50	81,936,743円
バランスセレクト70	68,244,143円
野村外国債券インデックスファンド	289,718,022円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,566,500,794円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,382,452,301円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,474,454,506円
野村資産設計ファンド2015	26,224,333円
野村資産設計ファンド2020	21,403,374円
野村資産設計ファンド2025	45,677,631円
野村資産設計ファンド2030	43,996,772円
野村資産設計ファンド2035	30,461,988円
野村資産設計ファンド2040	55,863,425円
野村外国債券インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	102,696,898,184円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,676,597,974円
のむラップ・ファンド（普通型）	12,101,601,516円

のむラップ・ファンド（積極型）	2,504,634,992円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	588,303,432円
野村資産設計ファンド2045	7,010,276円
野村インデックスファンド・外国債券	807,104,949円
マイ・ロード	8,673,912,808円
ネクストコア	224,617,607円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	148,550,555円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	6,161,431,223円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,084,522,295円
野村資産設計ファンド2050	8,780,326円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,758,221円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,128,988円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,533,624円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,054,046円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	498,286,850円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	370,542,273円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,067,279円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,352,839円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	5,388,512円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,475,937円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,445,122円
野村6資産均等バランス	860,266,975円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	7,387,890,547円
世界6資産分散ファンド	76,074,277円
野村資産設計ファンド2060	2,574,873円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	2,025,358,241円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	1,529,339,077円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	9,010,354円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,349,384,378円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	316,606,137円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,518,411,044円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,242,688,304円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,731,221円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,351,785円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	370,483円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,156,328,850円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	15,216,778円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	72,057,667円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	16,333,969円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	161,654,807円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	175,387,885円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	1,719,932,928円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	103,355,272円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	670,989,064円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	1,604,031,769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）	599,754円

バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	3,706,775円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	6,375,974円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	5,201,938円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	581,678,174円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	5,031,958,356円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	5,668,600,767円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	4,058,591,467円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	16,523,400,936円
マイバランスDC３０	1,669,220,251円
マイバランスDC５０	1,149,151,925円
マイバランスDC７０	728,664,956円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,097,344,985円
野村DC運用戦略ファンド	3,434,053,260円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	328,337,110円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	145,876,873円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	209,983,736円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	104,099,752円
野村世界６資産分散投信（DC）安定コース	9,624,136円
野村世界６資産分散投信（DC）インカムコース	23,792,413円
野村世界６資産分散投信（DC）成長コース	8,843,666円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０３０	4,364,671円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０４０	2,537,274円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０５０	1,524,338円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	55,362,721円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	35,786,661円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	15,702,867円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	18,316,489円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０６０	547,340円

※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2020年 6月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	94,701,803
コール・ローン	14,291,363
国債証券	6,319,981,752
派生商品評価勘定	16,033
未収利息	77,393,805
前払費用	9,171,014
流動資産合計	6,515,555,770
資産合計	6,515,555,770
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	724
未払解約金	3,526,520

(2020年 6月26日現在)

未払利息	14
その他未払費用	475,800
流動負債合計	4,003,058
負債合計	4,003,058
純資産の部	
元本等	
元本	4,957,007,967
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,554,544,745
元本等合計	6,511,552,712
純資産合計	6,511,552,712
負債純資産合計	6,515,555,770

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月26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	1.3136円
(10,000口当たり純資産額)	(13,136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

2020年 6月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	

2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月26日現在		
期首		2019年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		5,692,464,158円
同期中における追加設定元本額		1,102,447,530円
同期中における一部解約元本額		1,837,903,721円
期末元本額		4,957,007,967円
期末元本額の内訳※		
野村資産設計ファンド2015		10,617,717円
野村資産設計ファンド2020		21,173,177円
野村資産設計ファンド2025		19,342,767円
野村資産設計ファンド2030		18,632,049円
野村資産設計ファンド2035		12,898,360円
野村資産設計ファンド2040		23,656,444円
野村資産設計ファンド2045		2,958,692円
野村インデックスファンド・新興国債券		913,948,697円
ネクストコア		16,786,771円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		273,969,260円
野村資産設計ファンド2050		3,636,813円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		2,387,501円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		900,516円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		648,695円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		431,691円
世界6資産分散ファンド		140,218,858円
野村資産設計ファンド2060		1,042,421円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）		2,669,840,540円

野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2％コース向け）（適格機関投資家専用）	92,221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）	144,599,668円
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	397,318,278円
野村DC運用戦略ファンド	257,774,628円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	20,352,024円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2030	1,847,473円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2040	1,073,974円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2050	631,112円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2060	227,620円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

2020年7月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年6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	1,011	30,063,056
単位型株式投資信託	182	833,280
追加型公社債投資信託	14	5,668,377
単位型公社債投資信託	461	1,626,797
合計	1,668	38,191,510

（３）【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2019年4月1日から2020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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020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			1,562		2,626
金銭の信託			45,493		41,524
有価証券			19,900		24,399
前払費用			27		106
未収入金			500		522
未収委託者報酬			25,246		23,936
未収運用受託報酬			5,933		4,336
その他			269		71
貸倒引当金			△15		△14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産			714		645
建物	※ 2	320		295	
器具備品	※ 2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	
投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		△0	

投資損失引当金		△707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

		前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	※ 1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本			86,924		85,270
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			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 【損益計算書】

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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			119,196		115,736
運用受託報酬			21,440		17,170
その他営業収益			355		340
営業収益計			140,992		133,247
営業費用					
支払手数料			42,675		39,435
広告宣伝費			1,210		1,006
公告費			0		-
調査費			30,082		26,833
調査費		5,998		5,696	
委託調査費		24,083		21,136	
委託計算費			1,311		1,342
営業雑経費			5,435		5,823
通信費		92		75	
印刷費		970		958	
協会費		86		92	
諸経費		4,286		4,696	
営業費用計			80,715		74,440
一般管理費					
給料			11,113		11,418
役員報酬		379		109	
給料・手当		7,067		7,173	
賞与		3,666		4,134	
交際費			107		86
旅費交通費			514		391
租税公課			1,048		1,029
不動産賃借料			1,223		1,227
退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348
諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	※ 1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	

為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	※ 3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	※ 2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		△34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利 益 剰余金 合 計	
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							△24,826	△24,826	△24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

当事業年度(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	30,723	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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの … 移動平均法による原価法								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table> <tr> <td>建物</td><td>38～50年</td></tr> <tr> <td>附属設備</td><td>8～15年</td></tr> <tr> <td>構築物</td><td>20年</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>4～15年</td></tr> </table> (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。	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。								

5. 消費税等の会計処理方法 6. 連結納税制度の適用	(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。 連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。
---	--

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

◇ 貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020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 1,434百万円	※ 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 1,296百万円

※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 736百万円	建物 761百万円
器具備品 3,106	器具備品 2,347
合計 3,842	合計 3,109

◇ 損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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 6,531百万円 支払利息 1	※ 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
※ 2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソ フ ト ウ エ 307 ア 合計 310	※ 2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソ フ ト ウ エ 59 ア 合計 67
※ 3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。	

◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 24,826百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,820円

基準日 2018年3月31日

効力発生日 2018年6月25日

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 25,650百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,980円

基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

当事業年度(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

◇ 金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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、株式につきましても、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

◇ 有価証券関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2019年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

◇ 退職給付関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

① 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

② 長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企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。

◇ 税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020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	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	△1,295	評価性引当額	△1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

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 (調整)	法定実効税率 (調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
外国税額控除	外国税額控除
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
その他	その他
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
31.0%	31.0%
0.1%	0.0%
△5.6%	△4.4%
2.6%	2.6%
△0.6%	△0.7%
0.3%	0.2%
1.3%	0.4%
29.1%	29.1%

◇ セグメント情報等

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

◇ 関連当事者情報

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

１．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有)直接 100%	資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息の支払	1	未払費用	-

（イ）子会社等
該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	—	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	34,646	未払手数料	6,410

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

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

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(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

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)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入 (*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

野村ホールディングス(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、

ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ 1株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88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	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

独立監査人の監査報告書

2020年6月10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	櫻井 雄一郎
--------------------	-------	--------

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

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の財務諸表、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2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2020年8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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀 井 純 子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊 藤 志 保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型の2019年12月27日から2020年6月26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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の2020年6月26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（2019年12月27日から2020年6月26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。

利害関係

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

以 上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2020年8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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀 井 純 子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊 藤 志 保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型の2019年12月27日から2020年6月26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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の2020年6月26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（2019年12月27日から2020年6月26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。

利害関係

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

以 上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2020年8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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀 井 純 子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊 藤 志 保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型の2019年12月27日から2020年6月26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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の2020年6月26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（2019年12月27日から2020年6月26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。

利害関係

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

以 上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2020年8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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀 井 純 子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊 藤 志 保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016-2037年目標型の2019年12月27日から2020年6月26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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の2020年6月26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（2019年12月27日から2020年6月26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。

利害関係

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

以 上

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