

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年11月12日提出
【計算期間】	のむラップ・ファンド（保守型） 第12期中 のむラップ・ファンド（やや保守型） 第6期中 のむラップ・ファンド（普通型） 第12期中 のむラップ・ファンド（やや積極型） 第6期中 のむラップ・ファンド（積極型） 第12期中 （自 2021年2月19日至 2021年8月18日）
【ファンド名】	のむラップ・ファンド（保守型） のむラップ・ファンド（やや保守型） のむラップ・ファンド（普通型） のむラップ・ファンド（やや積極型） のむラップ・ファンド（積極型）
【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】	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
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【電話番号】	03-6387-5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

以下は2021年9月30日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

のむラップ・ファンド（保守型）

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	46,149,918,905	98.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	481,441,657	1.03
合計（純資産総額）		46,631,360,562	100.00

のむラップ・ファンド（やや保守型）

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	5,370,869,005	98.87
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	61,048,646	1.12
合計（純資産総額）		5,431,917,651	100.00

のむラップ・ファンド（普通型）

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	138,947,799,324	98.78
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,707,164,484	1.21
合計（純資産総額）		140,654,963,808	100.00

のむラップ・ファンド（やや積極型）

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	6,405,244,302	99.00
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	64,693,876	0.99
合計（純資産総額）		6,469,938,178	100.00

のむラップ・ファンド（積極型）

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	59,356,651,213	98.80

現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	716,015,818	1.19
合計（純資産総額）		60,072,667,031	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	405,693,587,950	96.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	14,141,635,146	3.36
合計（純資産総額）		419,835,223,096	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	10,964,700,000	2.61

（参考）国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	642,679,400,150	80.13
地方債証券	日本	54,135,572,868	6.75
特殊債券	日本	63,739,466,763	7.94
社債券	日本	34,443,276,800	4.29
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,950,901,446	0.86
合計（純資産総額）		801,948,618,027	100.00

（参考）外国株式M S C I - K O K U S A I 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	760,503,071,759	69.88
	カナダ	36,780,835,503	3.38
	ドイツ	30,215,810,906	2.77
	イタリア	8,018,561,587	0.73
	フランス	36,187,452,342	3.32
	オランダ	16,728,657,661	1.53
	スペイン	7,967,250,201	0.73
	ベルギー	2,695,212,095	0.24
	オーストリア	723,179,302	0.06
	ルクセンブルグ	536,825,397	0.04

	フィンランド	3,389,951,214	0.31
	アイルランド	2,372,146,126	0.21
	ポルトガル	621,880,450	0.05
	イギリス	46,953,862,543	4.31
	スイス	31,525,764,038	2.89
	スウェーデン	12,079,321,538	1.11
	ノルウェー	2,163,561,345	0.19
	デンマーク	8,730,602,080	0.80
	オーストラリア	20,887,911,006	1.91
	ニュージーランド	785,546,383	0.07
	香港	8,921,111,723	0.81
	シンガポール	2,946,240,348	0.27
	イスラエル	1,229,657,500	0.11
	小計	1,042,964,413,047	95.84
投資証券	アメリカ	20,774,609,896	1.90
	カナダ	119,662,550	0.01
	フランス	469,106,069	0.04
	イギリス	640,589,005	0.05
	オーストラリア	1,508,437,528	0.13
	香港	398,940,026	0.03
	シンガポール	460,278,163	0.04
	小計	24,371,623,237	2.23
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	20,849,244,819	1.91
合計（純資産総額）		1,088,185,281,103	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	15,334,956,630	1.40
	買建	カナダ	717,783,524	0.06
	買建	ドイツ	2,157,970,623	0.19
	買建	イギリス	936,577,177	0.08
	買建	スイス	613,871,910	0.05
	買建	オーストラリア	447,470,244	0.04

（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	280,842,470,546	45.92
	カナダ	11,968,747,703	1.95

	メキシコ	4,225,864,706	0.69
	ドイツ	40,646,757,614	6.64
	イタリア	61,566,838,135	10.06
	フランス	57,240,008,502	9.36
	オランダ	10,025,666,777	1.63
	スペイン	39,056,835,021	6.38
	ベルギー	14,195,552,341	2.32
	オーストリア	8,664,815,519	1.41
	フィンランド	2,618,808,676	0.42
	アイルランド	8,182,346,219	1.33
	イギリス	36,708,699,037	6.00
	スウェーデン	1,741,174,451	0.28
	ノルウェー	1,464,698,741	0.23
	デンマーク	3,066,854,733	0.50
	ポーランド	3,469,271,799	0.56
	オーストラリア	11,049,260,215	1.80
	シンガポール	2,734,198,530	0.44
	マレーシア	2,904,153,419	0.47
	イスラエル	2,753,338,099	0.45
	小計	605,126,360,783	98.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,348,403,739	1.03
合計（純資産総額）		611,474,764,522	100.00

（参考）世界REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	8,254,126,300	8.80
	アメリカ	64,188,510,699	68.45
	カナダ	1,681,365,508	1.79
	ドイツ	224,991,670	0.23
	イタリア	24,255,957	0.02
	フランス	1,658,486,731	1.76
	オランダ	146,491,041	0.15
	スペイン	361,332,074	0.38
	ベルギー	1,128,622,635	1.20
	アイルランド	89,395,349	0.09
	シンガポール	47,944,312	0.05
	イギリス	4,830,849,687	5.15

	オーストラリア	5,765,182,567	6.14
	ニュージーランド	340,080,525	0.36
	香港	1,223,709,959	1.30
	シンガポール	2,787,197,182	2.97
	韓国	146,096,043	0.15
	イスラエル	56,057,057	0.05
	小計	92,954,695,296	99.13
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	812,624,875	0.86
合計（純資産総額）		93,767,320,171	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	61,920,000	0.06
株価指数先物取引	買建	アメリカ	555,464,556	0.59

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

2021年9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2計算期間	(2012年 2月20日)	6,058	6,058	0.9918	0.9918
第3計算期間	(2013年 2月18日)	5,672	5,677	1.1314	1.1324
第4計算期間	(2014年 2月18日)	9,827	9,835	1.2452	1.2462
第5計算期間	(2015年 2月18日)	14,449	14,460	1.3886	1.3896
第6計算期間	(2016年 2月18日)	21,912	21,929	1.3443	1.3453
第7計算期間	(2017年 2月20日)	30,711	30,733	1.3697	1.3707
第8計算期間	(2018年 2月19日)	35,454	35,480	1.4018	1.4028
第9計算期間	(2019年 2月18日)	40,084	40,112	1.4138	1.4148
第10計算期間	(2020年 2月18日)	42,494	42,523	1.4787	1.4797
第11計算期間	(2021年 2月18日)	41,691	41,719	1.5157	1.5167
	2020年 9月末日	41,750	—	1.4611	—
	10月末日	41,160	—	1.4409	—

11月末日	41,683	—	1.4855	—
12月末日	41,691	—	1.4978	—
2021年 1月末日	41,500	—	1.4997	—
2月末日	41,212	—	1.5022	—
3月末日	42,629	—	1.5399	—
4月末日	42,810	—	1.5450	—
5月末日	43,750	—	1.5570	—
6月末日	44,550	—	1.5635	—
7月末日	45,320	—	1.5695	—
8月末日	46,196	—	1.5774	—
9月末日	46,631	—	1.5722	—

のむラップ・ファンド（やや保守型）

2021年9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 (2017年 2月20日)	1,754	1,756	1.0428	1.0438
第2計算期間 (2018年 2月19日)	2,561	2,564	1.0771	1.0781
第3計算期間 (2019年 2月18日)	3,292	3,295	1.0905	1.0915
第4計算期間 (2020年 2月18日)	4,330	4,334	1.1619	1.1629
第5計算期間 (2021年 2月18日)	4,097	4,101	1.2108	1.2118
2020年 9月末日	4,201	—	1.1384	—
10月末日	4,165	—	1.1184	—
11月末日	4,360	—	1.1703	—
12月末日	4,331	—	1.1842	—
2021年 1月末日	4,046	—	1.1893	—
2月末日	4,058	—	1.1986	—
3月末日	4,311	—	1.2381	—
4月末日	4,427	—	1.2469	—
5月末日	4,765	—	1.2589	—
6月末日	4,943	—	1.2681	—
7月末日	5,113	—	1.2735	—
8月末日	5,309	—	1.2844	—
9月末日	5,431	—	1.2792	—

のむラップ・ファンド（普通型）

2021年9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2計算期間	(2012年 2月20日)	6,615	6,615	0.9925	0.9925
第3計算期間	(2013年 2月18日)	6,993	6,999	1.2232	1.2242
第4計算期間	(2014年 2月18日)	11,197	11,205	1.4361	1.4371
第5計算期間	(2015年 2月18日)	21,005	21,017	1.7185	1.7195
第6計算期間	(2016年 2月18日)	37,150	37,173	1.5776	1.5786
第7計算期間	(2017年 2月20日)	45,690	45,717	1.6899	1.6909
第8計算期間	(2018年 2月19日)	58,457	58,490	1.7636	1.7646
第9計算期間	(2019年 2月18日)	75,805	75,847	1.7954	1.7964
第10計算期間	(2020年 2月18日)	92,176	92,223	1.9561	1.9571
第11計算期間	(2021年 2月18日)	103,707	103,757	2.0652	2.0662
	2020年 9月末日	96,736	—	1.8874	—
	10月末日	94,765	—	1.8461	—
	11月末日	99,072	—	1.9648	—
	12月末日	99,882	—	1.9959	—
	2021年 1月末日	100,921	—	2.0108	—
	2月末日	102,681	—	2.0422	—
	3月末日	109,787	—	2.1286	—
	4月末日	112,827	—	2.1559	—
	5月末日	118,079	—	2.1816	—
	6月末日	124,575	—	2.2058	—
	7月末日	130,354	—	2.2174	—
	8月末日	136,338	—	2.2448	—
	9月末日	140,654	—	2.2317	—

のむラップ・ファンド（やや積極型）

2021年9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	(2017年 2月20日)	448	448	1.0761	1.0771
第2計算期間	(2018年 2月19日)	1,565	1,566	1.1287	1.1297
第3計算期間	(2019年 2月18日)	2,229	2,231	1.1485	1.1495
第4計算期間	(2020年 2月18日)	3,070	3,072	1.2717	1.2727
第5計算期間	(2021年 2月18日)	4,445	4,448	1.3517	1.3527
	2020年 9月末日	3,960	—	1.2104	—
	10月末日	3,982	—	1.1815	—
	11月末日	4,270	—	1.2721	—
	12月末日	4,385	—	1.2955	—
	2021年 1月末日	4,316	—	1.3090	—
	2月末日	4,387	—	1.3355	—
	3月末日	4,829	—	1.3998	—

4月末日	4,999	—	1.4266	—
5月末日	5,331	—	1.4447	—
6月末日	5,670	—	1.4654	—
7月末日	6,019	—	1.4752	—
8月末日	6,371	—	1.4976	—
9月末日	6,469	—	1.4840	—

のむラップ・ファンド（積極型）

2021年9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2計算期間 (2012年 2月20日)	5,471	5,471	0.9929	0.9929
第3計算期間 (2013年 2月18日)	5,173	5,177	1.2607	1.2617
第4計算期間 (2014年 2月18日)	7,914	7,919	1.5322	1.5332
第5計算期間 (2015年 2月18日)	12,370	12,377	1.8855	1.8865
第6計算期間 (2016年 2月18日)	15,939	15,949	1.6702	1.6712
第7計算期間 (2017年 2月20日)	19,026	19,036	1.8662	1.8672
第8計算期間 (2018年 2月19日)	22,241	22,253	1.9744	1.9754
第9計算期間 (2019年 2月18日)	26,325	26,338	2.0233	2.0243
第10計算期間 (2020年 2月18日)	32,358	32,372	2.2782	2.2792
第11計算期間 (2021年 2月18日)	39,717	39,733	2.4423	2.4433
2020年 9月末日	36,180	—	2.1458	—
10月末日	35,616	—	2.0902	—
11月末日	37,436	—	2.2747	—
12月末日	37,709	—	2.3221	—
2021年 1月末日	38,310	—	2.3524	—
2月末日	39,264	—	2.4112	—
3月末日	42,906	—	2.5405	—
4月末日	45,068	—	2.6063	—
5月末日	47,572	—	2.6409	—
6月末日	51,581	—	2.6865	—
7月末日	55,278	—	2.7091	—
8月末日	58,516	—	2.7567	—
9月末日	60,072	—	2.7216	—

【分配の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	1口当たりの分配金
--	------	-----------

第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.0000円
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	0.0010円
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.0000円
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	0.0010円
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円

第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.0000円
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

【収益率の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	収益率
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.4%
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	14.2%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	10.1%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	11.6%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	3.1%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	2.0%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	2.4%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.9%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	4.7%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	2.6%
第12期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	3.5%

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。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	4.4%

第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	3.4%
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.3%
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	6.6%
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	4.3%
第6期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	5.2%

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。

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	収益率
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	3.4%
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	23.3%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	17.5%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	19.7%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	8.1%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	7.2%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	4.4%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.9%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	9.0%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	5.6%
第12期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	7.5%

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。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	7.7%
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	5.0%
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.8%
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	10.8%
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	6.4%
第6期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	9.4%

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

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	収益率
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	4.8%
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	27.1%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	21.6%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	23.1%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	11.4%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	11.8%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	5.9%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.5%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	12.6%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	7.2%
第12期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	11.2%

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

2【設定及び解約の実績】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	4,101,497,146	851,012,801	6,108,585,471
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	1,608,337,173	2,703,541,712	5,013,380,932
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	3,849,180,143	970,300,281	7,892,260,794
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	5,232,995,552	2,719,491,723	10,405,764,623
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	8,647,464,358	2,752,459,905	16,300,769,076
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	10,074,422,211	3,953,141,382	22,422,049,905
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	8,245,634,392	5,375,777,007	25,291,907,290
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	6,683,674,568	3,622,632,363	28,352,949,495
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	7,256,673,085	6,871,185,722	28,738,436,858
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	5,853,220,978	7,084,358,604	27,507,299,232
第12期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	4,324,529,440	2,662,383,287	29,169,445,385

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	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11月11日～2017年 2月20日	1,683,928,835	1,075,577	1,682,853,258
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	1,216,556,735	520,704,097	2,378,705,896
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	827,317,233	187,003,223	3,019,019,906
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	1,362,550,967	654,402,581	3,727,168,292
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	1,382,305,912	1,725,139,133	3,384,335,071
第6期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	1,060,002,566	386,565,847	4,057,771,790

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	4,035,238,777	777,144,309	6,665,994,789
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	1,357,750,676	2,306,257,102	5,717,488,363
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	3,301,811,164	1,221,662,831	7,797,636,696
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	6,938,730,583	2,513,534,586	12,222,832,693
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	14,624,481,293	3,298,164,142	23,549,149,844
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	8,370,562,015	4,882,793,242	27,036,918,617
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	13,898,310,644	7,788,778,406	33,146,450,855
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	14,762,704,987	5,687,029,247	42,222,126,595

第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	17,015,753,904	12,114,213,571	47,123,666,928
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	17,367,085,936	14,274,396,250	50,216,356,614
第12期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	16,075,762,292	6,410,067,456	59,882,051,450

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	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11月11日～2017年 2月20日	418,434,475	2,119,224	416,315,251
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	1,136,667,950	165,912,216	1,387,070,985
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	748,002,975	193,991,442	1,941,082,518
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	1,250,105,711	776,826,920	2,414,361,309
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	1,873,074,115	998,933,831	3,288,501,593
第6期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	1,387,287,048	509,800,678	4,165,987,963

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	3,679,870,851	878,370,640	5,510,802,927
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	959,956,709	2,366,840,325	4,103,919,311
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	2,155,523,440	1,094,037,100	5,165,405,651
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	3,164,392,511	1,768,791,397	6,561,006,765
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	4,833,876,039	1,851,238,866	9,543,643,938
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	2,890,629,040	2,239,285,849	10,194,987,129
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	4,305,044,963	3,234,715,551	11,265,316,541
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	4,187,189,703	2,441,328,586	13,011,177,658
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	5,773,245,162	4,580,921,634	14,203,501,186
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	7,849,562,545	5,791,022,042	16,262,041,689
第12期（中間期）	2021年 2月19日～2021年 8月18日	7,209,179,961	2,527,615,338	20,943,606,312

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】

のむラップ・ファンド（保守型）

のむラップ・ファンド（普通型）

のむラップ・ファンド（積極型）

(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12期中間計算期間(2021年2月19日から2021年8月18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。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

のむラップ・ファンド（やや積極型）

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2021年2月19日から2021年8月18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。

【のむラップ・ファンド（保守型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 (2021年 2月18日現在)	第12期中間計算期間末 (2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	695,231,242	855,200,112
親投資信託受益証券	41,302,918,441	45,193,941,343
未収入金	52,479,000	-
流動資産合計	42,050,628,683	46,049,141,455
資産合計	42,050,628,683	46,049,141,455
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	27,507,299	-
未払解約金	81,625,855	42,498,192
未払受託者報酬	6,912,662	7,124,154
未払委託者報酬	241,943,039	249,345,128
未払利息	638	734
その他未払費用	691,207	712,356
流動負債合計	358,680,700	299,680,564
負債合計	358,680,700	299,680,564
純資産の部		
元本等		
元本	27,507,299,232	29,169,445,385
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	14,184,648,751	16,580,015,506
（分配準備積立金）	3,349,267,699	3,054,159,715
元本等合計	41,691,947,983	45,749,460,891
純資産合計	41,691,947,983	45,749,460,891
負債純資産合計	42,050,628,683	46,049,141,455

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2020年 2月19日 至 2020年 8月18日	第12期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	173,862,635	1,714,659,902
営業収益合計	173,862,635	1,714,659,902
営業費用		
支払利息	102,962	82,667
受託者報酬	6,741,891	7,124,154
委託者報酬	235,966,043	249,345,128
その他費用	674,131	712,356
営業費用合計	243,485,027	257,264,305
営業利益又は営業損失（ ）	417,347,662	1,457,395,597
経常利益又は経常損失（ ）	417,347,662	1,457,395,597
中間純利益又は中間純損失（ ）	417,347,662	1,457,395,597
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（ ）	113,762,818	73,699,358
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,755,967,743	14,184,648,751
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,077,609,893	2,378,878,510
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,077,609,893	2,378,878,510
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,291,625,938	1,367,207,994
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,291,625,938	1,367,207,994
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,238,366,854	16,580,015,506

（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、2021年 2月19日から2021年 8月18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11期 2021年 2月18日現在	第12期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 27,507,299,232口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 29,169,445,385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 1.5157円 (10,000口当たり純資産額) (15,157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 1.5684円 (10,000口当たり純資産額) (15,684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11期 2021年 2月18日現在	第12期中間計算期間末 2021年 8月18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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日		第12期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	
期首元本額	28,738,436,858円	期首元本額	27,507,299,232円
期中追加設定元本額	5,853,220,978円	期中追加設定元本額	4,324,529,440円
期中一部解約元本額	7,084,358,604円	期中一部解約元本額	2,662,383,287円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（やや保守型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2021年 2月18日現在)	第6期中間計算期間末 (2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,887,189	95,039,181
親投資信託受益証券	4,060,315,947	5,111,726,613
未収入金	5,930,000	216,000
流動資産合計	4,144,133,136	5,206,981,794
資産合計	4,144,133,136	5,206,981,794
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,384,335	-
未払解約金	15,921,969	9,507,781
未払受託者報酬	698,316	755,144
未払委託者報酬	26,187,142	28,317,837
未払利息	71	81
その他未払費用	69,768	75,454
流動負債合計	46,261,601	38,656,297
負債合計	46,261,601	38,656,297
純資産の部		
元本等		
元本	3,384,335,071	4,057,771,790
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	713,536,464	1,110,553,707
（分配準備積立金）	374,002,336	337,107,638
元本等合計	4,097,871,535	5,168,325,497
純資産合計	4,097,871,535	5,168,325,497
負債純資産合計	4,144,133,136	5,206,981,794

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2020年 2月19日 至 2020年 8月18日	第6期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	120,002,743	253,098,666
営業収益合計	120,002,743	253,098,666
営業費用		
支払利息	10,157	9,470
受託者報酬	614,312	755,144
委託者報酬	23,036,615	28,317,837
その他費用	61,367	75,454
営業費用合計	23,722,451	29,157,905
営業利益又は営業損失（ ）	143,725,194	223,940,761
経常利益又は経常損失（ ）	143,725,194	223,940,761
中間純利益又は中間純損失（ ）	143,725,194	223,940,761
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（ ）	110,468,030	11,966,283
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	603,454,489	713,536,464
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,466,905	266,814,891
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	75,466,905	266,814,891
剰余金減少額又は欠損金増加額	145,068,371	81,772,126
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	145,068,371	81,772,126
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	500,595,859	1,110,553,707

（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、2021年 2月19日から2021年 8月18日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第5期 2021年 2月18日現在	第6期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,384,335,071口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 4,057,771,790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 1.2108円 (10,000口当たり純資産額) (12,108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 1.2737円 (10,000口当たり純資産額) (12,737円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 2月18日現在	第6期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

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

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日		第6期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	
期首元本額	3,727,168,292円	期首元本額	3,384,335,071円
期中追加設定元本額	1,382,305,912円	期中追加設定元本額	1,060,002,566円
期中一部解約元本額	1,725,139,133円	期中一部解約元本額	386,565,847円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（普通型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 (2021年 2月18日現在)	第12期中間計算期間末 (2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,030,659,824	2,543,731,917
親投資信託受益証券	102,722,787,166	131,305,161,933
未収入金	79,884,000	-
流動資産合計	104,833,330,990	133,848,893,850
資産合計	104,833,330,990	133,848,893,850
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	50,216,356	-
未払解約金	403,174,411	137,068,735
未払受託者報酬	16,359,807	19,139,516
未払委託者報酬	654,392,349	765,580,444
未払利息	1,863	2,183
その他未払費用	1,635,924	1,913,893
流動負債合計	1,125,780,710	923,704,771
負債合計	1,125,780,710	923,704,771
純資産の部		
元本等		
元本	50,216,356,614	59,882,051,450
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	53,491,193,666	73,043,137,629
（分配準備積立金）	13,560,150,154	12,054,928,194
元本等合計	103,707,550,280	132,925,189,079
純資産合計	103,707,550,280	132,925,189,079
負債純資産合計	104,833,330,990	133,848,893,850

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2020年 2月19日 至 2020年 8月18日	第12期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,610,137,662	8,896,126,767
営業収益合計	1,610,137,662	8,896,126,767
営業費用		
支払利息	234,485	249,840
受託者報酬	14,591,075	19,139,516
委託者報酬	583,643,181	765,580,444
その他費用	1,459,048	1,913,893
営業費用合計	599,927,789	786,883,693
営業利益又は営業損失（ ）	2,210,065,451	8,109,243,074
経常利益又は経常損失（ ）	2,210,065,451	8,109,243,074
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,210,065,451	8,109,243,074
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（ ）	467,814,476	516,603,461
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	45,052,813,650	53,491,193,666
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,305,032,525	18,810,913,840
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,305,032,525	18,810,913,840
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,047,147,122	6,851,609,490
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,047,147,122	6,851,609,490
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	45,568,448,078	73,043,137,629

（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、2021年 2月19日から2021年 8月18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11期 2021年 2月18日現在	第12期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 50,216,356,614口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 59,882,051,450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 2.0652円 (10,000口当たり純資産額) (20,652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 2.2198円 (10,000口当たり純資産額) (22,198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11期 2021年 2月18日現在	第12期中間計算期間末 2021年 8月18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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日		第12期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	
期首元本額	47,123,666,928円	期首元本額	50,216,356,614円
期中追加設定元本額	17,367,085,936円	期中追加設定元本額	16,075,762,292円
期中一部解約元本額	14,274,396,250円	期中一部解約元本額	6,410,067,456円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（やや積極型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2021年 2月18日現在)	第6期中間計算期間末 (2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	89,955,504	127,605,193
親投資信託受益証券	4,403,953,354	6,076,650,640
未収入金	11,511,000	-
流動資産合計	4,505,419,858	6,204,255,833
資産合計	4,505,419,858	6,204,255,833
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,288,501	-
未払解約金	26,882,017	9,156,374
未払受託者報酬	692,985	859,042
未払委託者報酬	29,451,691	36,509,251
未払利息	82	109
その他未払費用	69,238	85,839
流動負債合計	60,384,514	46,610,615
負債合計	60,384,514	46,610,615
純資産の部		
元本等		
元本	3,288,501,593	4,165,987,963
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,156,533,751	1,991,657,255
（分配準備積立金）	539,992,157	469,830,290
元本等合計	4,445,035,344	6,157,645,218
純資産合計	4,445,035,344	6,157,645,218
負債純資産合計	4,505,419,858	6,204,255,833

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2020年 2月19日 至 2020年 8月18日	第6期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	38,761,844	485,875,286
営業収益合計	38,761,844	485,875,286
営業費用		
支払利息	9,763	11,797
受託者報酬	547,824	859,042
委託者報酬	23,282,394	36,509,251
その他費用	54,724	85,839
営業費用合計	23,894,705	37,465,929
営業利益又は営業損失（ ）	62,656,549	448,409,357
経常利益又は経常損失（ ）	62,656,549	448,409,357
中間純利益又は中間純損失（ ）	62,656,549	448,409,357
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（ ）	15,269,646	31,447,593
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	656,031,671	1,156,533,751
剰余金増加額又は欠損金減少額	149,404,706	599,950,583
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	149,404,706	599,950,583
剰余金減少額又は欠損金増加額	51,403,604	181,788,843
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	51,403,604	181,788,843
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	706,645,870	1,991,657,255

（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、2021年 2月19日から2021年 8月18日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第5期 2021年 2月18日現在	第6期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,288,501,593口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 4,165,987,963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 1.3517円 (10,000口当たり純資産額) (13,517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 1.4781円 (10,000口当たり純資産額) (14,781円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 2月18日現在	第6期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	2. 時価の算定方法

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

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日		第6期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	
期首元本額	2,414,361,309円	期首元本額	3,288,501,593円
期中追加設定元本額	1,873,074,115円	期中追加設定元本額	1,387,287,048円
期中一部解約元本額	998,933,831円	期中一部解約元本額	509,800,678円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（積極型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 (2021年 2月18日現在)	第12期中間計算期間末 (2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	839,856,149	1,220,797,036
親投資信託受益証券	39,337,762,128	56,112,440,915
未収入金	114,494,000	-
流動資産合計	40,292,112,277	57,333,237,951
資産合計	40,292,112,277	57,333,237,951
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	16,262,041	-
未払解約金	274,444,665	85,971,969
未払受託者報酬	6,167,413	7,729,483
未払委託者報酬	277,533,464	347,826,660
未払利息	770	1,047
その他未払費用	616,680	772,886
流動負債合計	575,025,033	442,302,045
負債合計	575,025,033	442,302,045
純資産の部		
元本等		
元本	16,262,041,689	20,943,606,312
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	23,455,045,555	35,947,329,594
（分配準備積立金）	6,782,965,780	5,891,468,414
元本等合計	39,717,087,244	56,890,935,906
純資産合計	39,717,087,244	56,890,935,906
負債純資産合計	40,292,112,277	57,333,237,951

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2020年 2月19日 至 2020年 8月18日	第12期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	886,403,157	5,143,713,787
営業収益合計	886,403,157	5,143,713,787
営業費用		
支払利息	92,856	109,002
受託者報酬	5,144,735	7,729,483
委託者報酬	231,513,041	347,826,660
その他費用	514,413	772,886
営業費用合計	237,265,045	356,438,031
営業利益又は営業損失（ ）	1,123,668,202	4,787,275,756
経常利益又は経常損失（ ）	1,123,668,202	4,787,275,756
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,123,668,202	4,787,275,756
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（ ）	282,138,948	326,302,272
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	18,154,753,422	23,455,045,555
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,851,930,667	11,706,563,701
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,851,930,667	11,706,563,701
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,006,336,335	3,675,253,146
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,006,336,335	3,675,253,146
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	19,158,818,500	35,947,329,594

（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、2021年 2月19日から2021年 8月18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11期 2021年 2月18日現在	第12期中間計算期間末 2021年 8月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 16,262,041,689口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 20,943,606,312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 2.4423円 (10,000口当たり純資産額) (24,423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 2.7164円 (10,000口当たり純資産額) (27,164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11期 2021年 2月18日現在	第12期中間計算期間末 2021年 8月18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11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日		第12期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	
期首元本額	14,203,501,186円	期首元本額	16,262,041,689円
期中追加設定元本額	7,849,562,545円	期中追加設定元本額	7,209,179,961円
期中一部解約元本額	5,791,022,042円	期中一部解約元本額	2,527,615,338円

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（参考）

「のむラップ・ファンド」の各ファンドは「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド」、「外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「世界REITインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 8月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,373,812,114
株式	388,142,156,190
派生商品評価勘定	37,276,120
未収配当金	435,702,332
未収利息	391,404
その他未収収益	16,111,464
差入委託証拠金	341,785,400
流動資産合計	404,347,235,024
資産合計	404,347,235,024
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,240,260

未払金	15,246,000
未払解約金	83,571,236
未払利息	13,196
有価証券貸借取引受入金	7,773,074,256
流動負債合計	7,881,144,948
負債合計	7,881,144,948
純資産の部	
元本等	
元本	196,843,532,907
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	199,622,557,169
元本等合計	396,466,090,076
純資産合計	396,466,090,076
負債純資産合計	404,347,235,024

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月18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	2,0141円
(10,000口当たり純資産額)	(20,141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	
	7,379,283,090円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月18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、新株予約権証券 （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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月18日現在	
期首	2021年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	205,717,845,140円
同期中における追加設定元本額	18,345,751,782円
同期中における一部解約元本額	27,220,064,015円
期末元本額	196,843,532,907円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	141,186,870円
バランスセレクト50	320,055,574円
バランスセレクト70	457,023,319円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,352,021,050円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,037,198,844円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,802,077,688円
野村資産設計ファンド2015	39,452,446円
野村資産設計ファンド2020	39,618,037円
野村資産設計ファンド2025	69,872,871円
野村資産設計ファンド2030	97,955,772円
野村資産設計ファンド2035	84,394,767円
野村資産設計ファンド2040	161,414,808円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	14,648,679,075円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,376,514,892円
のむラップ・ファンド（普通型）	10,244,849,842円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,240,007,947円
野村資産設計ファンド2045	26,898,324円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,847,954,368円
マイ・ロード	3,329,532,344円
ネクストコア	35,212,100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	1,423,621,653円

野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,320,301,148円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,384,065,803円
野村資産設計ファンド２０５０	39,461,677円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	13,126,212円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	6,641,735円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	5,225,234円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	4,350,216円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	346,130,134円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	428,407,216円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,987,367円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,646,597円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	22,929,481円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,032,279円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	25,028,589円
野村６資産均等バランス	2,233,685,133円
世界６資産分散ファンド	79,554,339円
野村資産設計ファンド２０６０	19,938,068円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	1,125,289,588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）	316,603,483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）	152,261,475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）	497,924,410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）	481,880,433円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ安定型（適格機関投資家専用）	3,390,891円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡバランス型（適格機関投資家専用）	7,587,915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）	1,031,060円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,452,723,303円
野村ワールド・インデックス・バランス３５ＶＡ（適格機関投資家専用）	6,992,740円
野村ワールド・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	67,011,550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）	65,836,116円
野村世界インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	23,402,410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）	96,414,835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）	208,900,745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）	4,324,051,161円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	57,941,674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）	375,974,196円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ（適格機関投資家専用）	1,627,662,502円
野村国内外マルチアセット（６資産）ファンド（適格機関投資家専用）	176,424,985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）	89,716,407円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	2,491,759円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	5,946,142円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	27,777,285円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	32,529,030円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	120,368,978円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	9,084,946,286円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	24,842,333,803円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	28,245,128,600円
野村国内株式インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ（確定拠出年金向け）	33,446,655,525円

マイバランスDC30	3,262,773,231円
マイバランスDC50	5,504,624,950円
マイバランスDC70	5,543,476,590円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,205,652,417円
野村DC運用戦略ファンド	832,334,712円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	70,855,905円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,244,285,645円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	967,871,415円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	863,663,383円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	10,339,973円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,717,170円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	75,127,784円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	20,637,985円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	18,995,781円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	15,141,540円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	438,434,669円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	367,373,266円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	226,603,520円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	300,774,009円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	10,155,147円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	53,161,946円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	122,278,763円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 8月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,001,196,582
国債証券	629,453,379,400
地方債証券	52,858,739,217
特殊債証券	64,762,644,082
社債証券	33,654,270,700
未収利息	1,644,899,339
前払費用	23,315,055
流動資産合計	788,398,444,375
資産合計	788,398,444,375
負債の部	
流動負債	
未払金	5,101,672,200
未払解約金	309,853,231
未払利息	5,151
流動負債合計	5,411,530,582
負債合計	5,411,530,582
純資産の部	
元本等	
元本	586,543,090,606

(2021年 8月18日現在)

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	196,443,823,187
元本等合計	782,986,913,793
純資産合計	782,986,913,793
負債純資産合計	788,398,444,375

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月18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	1.3349円
(10,000口当たり純資産額)	(13,349円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月18日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月18日現在		
期首		2021年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		548,901,914,574円
同期中における追加設定元本額		72,259,849,426円
同期中における一部解約元本額		34,618,673,394円
期末元本額		586,543,090,606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		409,467,933円
野村世界 6 資産分散投信（安定コース）		42,066,679,664円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）		18,107,105,245円
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）		3,322,449,208円
野村資産設計ファンド 2 0 1 5		352,810,201円
野村資産設計ファンド 2 0 2 0		354,291,772円
野村資産設計ファンド 2 0 2 5		357,052,587円
野村資産設計ファンド 2 0 3 0		284,313,264円
野村資産設計ファンド 2 0 3 5		154,373,340円
野村資産設計ファンド 2 0 4 0		206,211,262円
野村日本債券インデックスファンド		840,899,048円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）		161,531,858,993円
のむラップ・ファンド（保守型）		14,019,296,067円
のむラップ・ファンド（普通型）		13,503,262,852円
のむラップ・ファンド（積極型）		1,950,746,545円
野村日本債券インデックス（野村 S M A 向け）		10,239,905,385円
野村資産設計ファンド 2 0 4 5		22,118,871円
野村円債投資インデックスファンド		838,221,173円
野村インデックスファンド・国内債券		2,162,964,436円
マイ・ロード		34,010,452,240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		1,414,552,384円
野村日本債券インデックス（野村 S M A ・ E W 向け）		19,032,112,069円
野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）		1,923,584,346円
野村資産設計ファンド 2 0 5 0		23,893,770円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 2 6 - 2 0 2 8 年目標型		27,715,467円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 2 9 - 2 0 3 1 年目標型		7,414,679円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 3 2 - 2 0 3 4 年目標型		4,033,314円
野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 3 5 - 2 0 3 7 年目標型		2,580,778円
のむラップ・ファンド（やや保守型）		1,080,869,854円
のむラップ・ファンド（やや積極型）		373,665,337円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		55,216,071円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		30,032,225円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		110,359,214円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		13,854,780円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		10,201,826円
野村 6 資産均等バランス		3,329,182,497円
世界 6 資産分散ファンド		118,571,268円

2021年 8月18日現在	
野村資産設計ファンド2060	8,490,454円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	16,064,548,254円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	21,336,092,738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）	566,255,930円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	90,791,309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）	1,855,322,119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）	1,077,327,271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）	18,531,625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）	10,053,054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）	614,708円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,655,752,428円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	8,338,620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）	66,578,700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）	69,761,975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）	383,246,887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）	311,359,485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）	920,677,957円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	173,508,940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）	764,254,897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）	307,295,498円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	14,853,312円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	37,860,484,719円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	49,983,358,673円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	18,928,391,971円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合（確定拠出年金向け）	50,674,035,993円
マイバランスDC30	13,524,356,220円
マイバランスDC50	11,076,308,559円
マイバランスDC70	3,705,738,975円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	13,119,300,540円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,148,909,098円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	2,826,476,306円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,294,769,803円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	184,940,722円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	28,122,726円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	31,992,511円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	59,900,588円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	24,267,551円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	9,168,097円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	853,370,164円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	435,418,290円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	159,340,139円

2021年 8月18日現在	
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	199,238,549円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	4,324,479円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	35,214,375円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	379,685,432円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 8月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	10,635,641,684
コール・ローン	1,398,503,613
株式	1,032,392,443,415
投資証券	24,325,931,158
派生商品評価勘定	444,290,236
未収入金	1,523,183
未収配当金	1,133,426,514
差入委託証拠金	7,155,668,768
流動資産合計	1,077,487,428,571
資産合計	1,077,487,428,571
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,038,993
未払金	707,540,595
未払解約金	346,019,429
未払利息	1,200
その他未払費用	2,423,100
流動負債合計	1,060,023,317
負債合計	1,060,023,317
純資産の部	
元本等	
元本	256,502,981,789
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	819,924,423,465
元本等合計	1,076,427,405,254
純資産合計	1,076,427,405,254
負債純資産合計	1,077,487,428,571

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 投資証券
--------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4,1965円
(10,000口当たり純資産額)	(41,965円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月18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。

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

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

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

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

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

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月18日現在	
期首	2021年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	245,379,120,410円
同期中における追加設定元本額	26,447,166,056円
同期中における一部解約元本額	15,323,304,677円
期末元本額	256,502,981,789円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	34,058,388円
バランスセレクト５０	102,568,693円
バランスセレクト７０	122,307,917円
野村外国株式インデックスファンド	490,217,759円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,364,705,909円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	4,344,893,481円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	3,720,449,365円
野村資産設計ファンド２０１５	10,723,423円
野村資産設計ファンド２０２０	10,768,497円
野村資産設計ファンド２０２５	19,039,546円
野村資産設計ファンド２０３０	26,797,326円
野村資産設計ファンド２０３５	23,048,785円
野村資産設計ファンド２０４０	44,297,694円
野村外国株インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	48,098,289,971円
のむラップ・ファンド（保守型）	794,612,530円

のむラップ・ファンド（普通型）	7,918,638,178円
のむラップ・ファンド（積極型）	6,948,929,245円
野村資産設計ファンド2045	7,386,325円
野村インデックスファンド・外国株式	5,895,542,051円
マイ・ロード	991,808,564円
ネクストコア	21,122,173円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	130,462,548円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,851,958,038円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	549,515,484円
野村資産設計ファンド2050	10,820,020円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	3,581,694円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,824,769円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,432,775円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,194,203円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	186,902,751円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	557,935,639円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,707,371円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,149,433円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	30,709,382円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,880,019円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	34,116,447円
野村6資産均等バランス	1,065,139,768円
野村つみたて外国株投信	8,310,891,856円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	4,738,773,948円
世界6資産分散ファンド	37,935,845円
野村資産設計ファンド2060	5,460,038円
野村スリーゼロ先進国株式投信	323,607,533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	3,292,621,733円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	3,036,981,945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）	150,973,367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）	72,617,573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）	711,777,612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）	1,148,071,678円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	1,617,025円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	4,422,217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）	1,081,706円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	1,333,715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）	21,301,400円
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	8,390,721円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	8,369,985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）	30,648,449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）	99,619,153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）	2,356,524,278円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	27,730,006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）	177,151,079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）	11,962,229,963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）	1,188,168円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	1,417,956円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	8,829,874円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	8,603,462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）	79,614,585,507円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	2,200,463,287円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	8,032,150,090円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,651,769,025円
マイバランスDC30	782,630,613円
マイバランスDC50	1,769,835,121円
マイバランスDC70	1,488,064,167円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	29,021,129,111円
野村DC運用戦略ファンド	500,467,931円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	39,682,018円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	344,427,517円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	270,165,383円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	262,518,277円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	14,792,555円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	6,748,192円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	35,824,921円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	5,645,793円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	5,213,086円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	4,151,668円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	136,857,635円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	106,228,050円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	60,492,185円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	79,680,572円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	2,780,988円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	14,083,397円
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	72,886,254円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

外国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2021年 8月18日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	351,904,806
コール・ローン	1,828,013,410
国債証券	597,515,407,178
派生商品評価勘定	1,244,075
未収入金	744,147,595
未収利息	4,571,683,120
前払費用	329,093,539

その他未収収益	7,346,058
流動資産合計	605,348,839,781
資産合計	605,348,839,781
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,472,712
未払金	1,271,381,797
未払解約金	255,409,753
未払利息	1,569
その他未払費用	3,508,463
流動負債合計	1,532,774,294
負債合計	1,532,774,294
純資産の部	
元本等	
元本	237,308,826,026
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	366,507,239,461
元本等合計	603,816,065,487
純資産合計	603,816,065,487
負債純資産合計	605,348,839,781

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月18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	2.5444円
(10,000口当たり純資産額)	(25,444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	
	205,028,060,732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

214,986,461,802円

なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月18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。	
計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当	
該為替予約は当該仲値で評価しております。	
計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の	
仲値をもとに計算したレートを用いております。	
・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物	
相場の仲値を用いております。	
2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しており	
ます。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月18日現在	
期首	2021年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	230,944,321,776円
同期中における追加設定元本額	21,254,549,748円
同期中における一部解約元本額	14,890,045,498円
期末元本額	237,308,826,026円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	83,362,616円
バランスセレクト50	83,756,563円
バランスセレクト70	79,143,172円
野村外国債券インデックスファンド	276,303,578円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,658,808,224円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,623,359,199円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,733,847,195円
野村資産設計ファンド2015	19,639,129円

野村資産設計ファンド2020	19,721,534円
野村資産設計ファンド2025	34,938,780円
野村資産設計ファンド2030	38,897,157円
野村資産設計ファンド2035	28,942,303円
野村資産設計ファンド2040	49,706,987円
野村外国債券インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	74,246,571,435円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,916,458,877円
のむラップ・ファンド（普通型）	16,202,880,965円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,910,982,149円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	519,667,799円
野村資産設計ファンド2045	6,997,896円
野村インデックスファンド・外国債券	896,298,648円
マイ・ロード	9,044,790,185円
ネクストコア	225,052,712円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	212,799,063円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	8,453,893,591円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,314,722,841円
野村資産設計ファンド2050	8,056,999円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,764,459円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,062,354円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,408,107円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,079,651円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	655,439,476円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	587,163,570円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,099,639円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,539,705円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	9,000,039円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,448,711円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,972,934円
野村6資産均等バランス	1,737,362,760円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	6,313,002,789円
世界6資産分散ファンド	61,879,303円
野村資産設計ファンド2060	2,835,720円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	6,888,936,239円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	3,658,277,629円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	6,365,650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）	1,182,021,362円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	189,532,062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）	1,355,500,938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）	937,015,337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）	2,637,475円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	7,869,291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）	320,788円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,179,527,304円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	9,790,184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）	52,114,412円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	13,652,001円

野村グローバル・インデックス・バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	174,997,984円
野村グローバル・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	162,485,446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）	1,922,088,733円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	90,485,800円
ノムラ外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,337,598,695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）	693,861,284円
野村ＦＯＦｓ用・ターゲット・リターン・８資産バランス（２％コース向け）（適格機関投資家専用）	5,814,745円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	3,469,998円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	7,202,769円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	5,695,243円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	567,037,211円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	5,393,885,069円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	6,501,215,131円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	4,945,180,098円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	18,921,345,443円
マイバランスＤＣ３０	1,926,287,363円
マイバランスＤＣ５０	1,442,042,836円
マイバランスＤＣ７０	965,788,271円
野村ＤＣ外国債券インデックスファンド	7,498,536,995円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	5,338,239,200円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	621,213,943円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	231,329,390円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	391,706,699円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	188,563,720円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	16,085,087円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	36,690,182円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	16,695,561円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	8,195,096円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	5,849,672円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	3,091,492円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	112,175,980円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	73,715,684円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	39,786,086円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	51,987,198円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,444,333円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	9,189,427円
多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け）	39,628,676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

世界ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2021年 8月18日現在)

資産の部

(2021年 8月18日現在)

流動資産	
預金	378,026,634
コール・ローン	109,625,464
投資証券	91,599,594,394
派生商品評価勘定	10,252,010
未収入金	3,828,468
未収配当金	204,482,630
差入委託証拠金	196,942,533
流動資産合計	92,502,752,133
資産合計	92,502,752,133
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,440
未払金	170,558,515
未払解約金	1,908,174
未払利息	94
その他未払費用	248,300
流動負債合計	172,763,523
負債合計	172,763,523
純資産の部	
元本等	
元本	41,297,666,803
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	51,032,321,807
元本等合計	92,329,988,610
純資産合計	92,329,988,610
負債純資産合計	92,502,752,133

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	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 国内先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 外国先物の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 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。 配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月18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	2,2357円
(10,000口当たり純資産額)	(22,357円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
派生商品評価勘定 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。 計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。 計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。 ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。 2）計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 8月18日現在	
期首	2021年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	41,352,191,880円
同期中における追加設定元本額	3,254,569,780円
同期中における一部解約元本額	3,309,094,857円
期末元本額	41,297,666,803円
期末元本額の内訳*	
野村世界REITインデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	9,362,491,083円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,478,111,971円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,135,406,739円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,520,331,347円
マイ・ロード	888,425,070円
野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）	1,884,439,055円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	232,452,989円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	393,448,993円
野村世界REITインデックスファンド（確定拠出年金向け）	15,402,559,556円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

2021年9月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去５年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2021年8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	991	38,257,481
単位型株式投資信託	196	822,500
追加型公社債投資信託	14	6,278,884
単位型公社債投資信託	503	1,622,437
合計	1,704	46,981,302

（３）【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

5【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

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

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

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

(2) 【損益計算書】

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

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

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株 主 資 本 合 計
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

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

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 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。

5．消費税等の会計処理方法 6．連結納税制度の適用	(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。 連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。
---	---

[会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

（２）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

効力発生日

2021年6月30日

金融商品関係

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

し、その内容を経営に報告しております。

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

有価証券関係

前事業年度（自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月 1 日 至 2021年3月31日）

1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2021年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

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

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

及び前払年金費用の調整表

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

税効果会計関係

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

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

ております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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

セグメント情報等

前事業年度(自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

１．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

（イ）子会社等
該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売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㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場）

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2020年4月 1 日 至 2021年3月31日)

１．関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

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

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

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

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

１株当たり情報

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

独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月8日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているのむらップ・ファンド（保守型）の2021年2月19日から2021年8月18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、のむらップ・ファンド（保守型）の2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月8日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているのむラップ・ファンド（やや保守型）の2021年2月19日から2021年8月18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、のむラップ・ファンド（やや保守型）の2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月8日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているのむらップ・ファンド（普通型）の2021年2月19日から2021年8月18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、のむらップ・ファンド（普通型）の2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月8日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているのむラップ・ファンド（やや積極型）の2021年2月19日から2021年8月18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、のむラップ・ファンド（やや積極型）の2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月8日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 志保

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているのむらップ・ファンド（積極型）の2021年2月19日から2021年8月18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、のむらップ・ファンド（積極型）の2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。