

野村インデックスファンド・ 外国債券・為替ヘッジ型

愛称：Funds-i 外国債券・為替ヘッジ型

運用報告書(全体版)

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016年9月6日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	2013年9月12日以降、無期限とします。	
運用方針	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。為替ヘッジはマザーファンドにおいて行うため、当ファンドにおいては原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	野村インデックス ファンド・外国債券・ 為替ヘッジ型 マザーファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
主な投資制限	野村インデックス ファンド・外国債券・ 為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。 株式への直接投資は行いません。 株式への投資は転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104
〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2013年9月12日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	300
1期(2014年9月8日)	10,696	0	7.0	107.83	7.8	98.0	—	472
2期(2015年9月7日)	10,958	0	2.4	111.34	3.3	96.0	—	639
3期(2016年9月6日)	11,505	0	5.0	117.74	5.7	99.2	—	832

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行なう円ベースの指数)です。なお、設定時を100として再指数化しています。

*シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

(出所) Citigroup Index LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	騰 落	率		
(期首)	円	%		%	%	%
2015年9月7日	10,958	—	111.34	—	96.0	—
9月末	11,010	0.5	111.91	0.5	97.4	—
10月末	11,011	0.5	112.00	0.6	98.2	—
11月末	11,027	0.6	112.20	0.8	97.5	—
12月末	10,926	△0.3	111.26	△0.1	97.0	—
2016年1月末	11,111	1.4	113.19	1.7	97.9	—
2月末	11,228	2.5	114.42	2.8	92.6	—
3月末	11,253	2.7	114.74	3.1	100.3	—
4月末	11,170	1.9	113.94	2.3	96.6	—
5月末	11,234	2.5	114.79	3.1	100.8	—
6月末	11,487	4.8	117.32	5.4	91.4	—
7月末	11,528	5.2	117.84	5.8	99.9	—
8月末	11,547	5.4	118.09	6.1	99.4	—
(期末)						
2016年9月6日	11,505	5.0	117.74	5.7	99.2	—

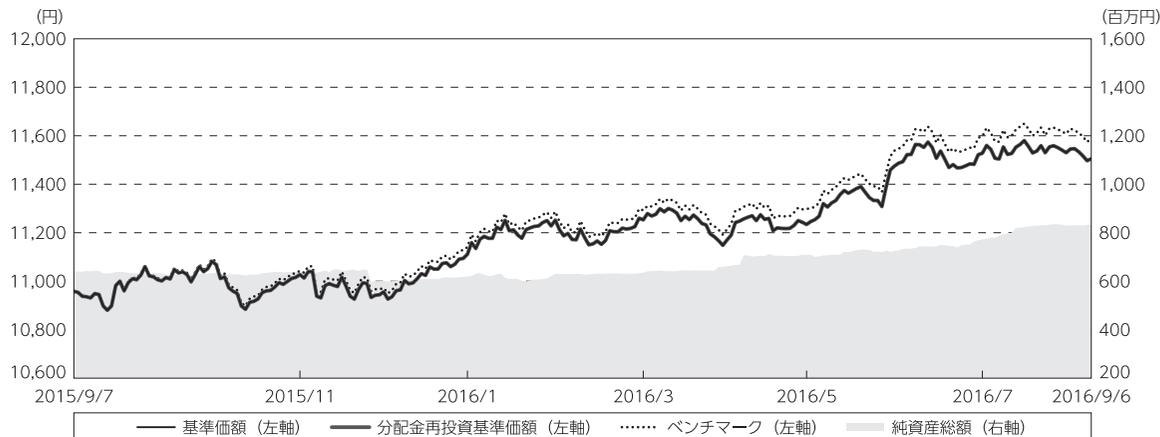
*騰落率は期首比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：10,958円

期末：11,505円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 5.0% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首(2015年9月7日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)です。ベンチマークは、作成年首(2015年9月7日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,958円から期末11,505円へと上昇し、値上がり額は547円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下(価格は上昇)したことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

○投資環境

2015年12月における米国の政策金利引上げに伴い、米国の短期債利回りが上昇（価格は下落）する局面もありましたが、2016年1月以降は、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和や、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの観測などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。6月には、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が多数を占めたことにより投資家のリスク回避的な姿勢が強まったことも、外国債券利回りの低下要因となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型]

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、外国債券為替ヘッジ型マザーファンドへ投資しました。期を通じてマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

[外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+5.0%となり、ベンチマークの+5.7%を0.7ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

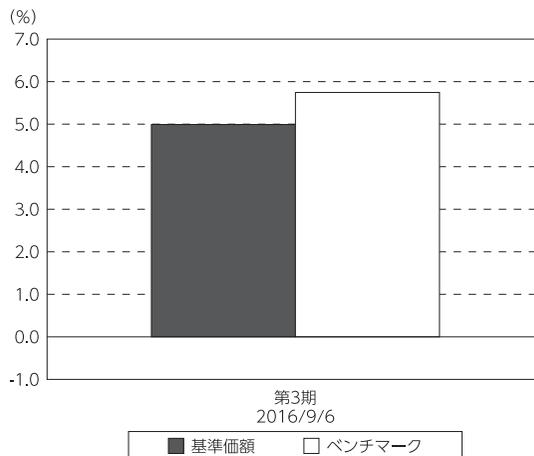
(マイナス要因)

コスト負担（当ファンドの信託報酬や、債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案し見送らせていただきました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第3期
	2015年9月8日～ 2016年9月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,505

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

[野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型]

引き続き、主要投資対象である [外国債券為替ヘッジ型マザーファンド] を高位に組入れ、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

○1万口当たりの費用明細

(2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 66	% 0.592	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(31)	(0.280)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(31)	(0.280)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(4)	(0.032)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	5	0.047	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0.044)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	71	0.639	
期中の平均基準価額は、11,211円です。			

*期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2015年9月8日～2016年9月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 336,052	千円 384,771	千口 202,270	千円 228,396

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年9月8日～2016年9月6日)

利害関係人との取引状況

<野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
預金	百万円 68	百万円 68	% 100.0	百万円 68	百万円 68	% 100.0

<外国債券為替ヘッジ型マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 33,285	百万円 512	% 1.5	百万円 36,739	百万円 566	% 1.5
為替直物取引	4,010	60	1.5	729	—	—
預金	2,603	2,603	100.0	2,603	2,603	100.0

平均保有割合 23.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千口 576,997	千口 710,779	千円 832,393

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	千円 832,393	% 99.6
コール・ローン等、その他	3,019	0.4
投資信託財産総額	835,412	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,358,844千円）の投資信託財産総額（4,405,735千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=103.60円、1カナダドル=80.12円、1英ポンド=137.85円、1スイスフラン=105.66円、1スウェーデンクローナ=12.09円、1ノルウェークローネ=12.50円、1デンマーククローネ=15.51円、1ユーロ=115.43円、1ズロチ=26.60円、1シンガポールドル=76.33円、1豪ドル=78.78円、1メキシコペソ=5.58円、1ランド=7.20円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	835,412,922
コール・ローン等	3,019,579
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	832,393,343
(B) 負債	2,935,322
未払解約金	804,894
未払信託報酬	2,122,768
未払利息	4
その他未払費用	7,656
(C) 純資産総額(A-B)	832,477,600
元本	723,553,134
次期繰越損益金	108,924,466
(D) 受益権総口数	723,553,134口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,505円

(注) 期首元本額は583,884,523円、期中追加設定元本額は561,236,144円、期中一部解約元本額は421,567,533円、1口当たり純資産額は1.1505円です。

○損益の状況 (2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	110
受取利息	749
支払利息	△ 639
(B) 有価証券売買損益	29,256,252
売買益	37,095,605
売買損	△ 7,839,353
(C) 信託報酬等	△ 3,985,520
(D) 当期損益金(A+B+C)	25,270,842
(E) 前期繰越損益金	253,115
(F) 追加信託差損益金	83,400,509
(配当等相当額)	(39,702,587)
(売買損益相当額)	(43,697,922)
(G) 計(D+E+F)	108,924,466
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	108,924,466
追加信託差損益金	83,400,509
(配当等相当額)	(40,929,927)
(売買損益相当額)	(42,470,582)
分配準備積立金	25,523,957

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程 (2015年9月8日～2016年9月6日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年9月8日～ 2016年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	13,742,639円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	4,930,709円
c. 信託約款に定める収益調整金	83,400,509円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	6,850,609円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	108,924,466円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,505円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万円当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016年9月6日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日) 2013年9月12日	円 10,000	% —	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) 100.00	% —	% —	% —	百万円 299
1期(2014年9月8日)	10,758	7.6	107.83	7.8	98.1	—	543
2期(2015年9月7日)	11,088	3.1	111.34	3.3	96.0	—	1,354
3期(2016年9月6日)	11,711	5.6	117.74	5.7	99.2	—	4,324

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行なう円ベースの指数）です。なお、設定時を100として再指数化しています。

*シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

(出所) Citigroup Index LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

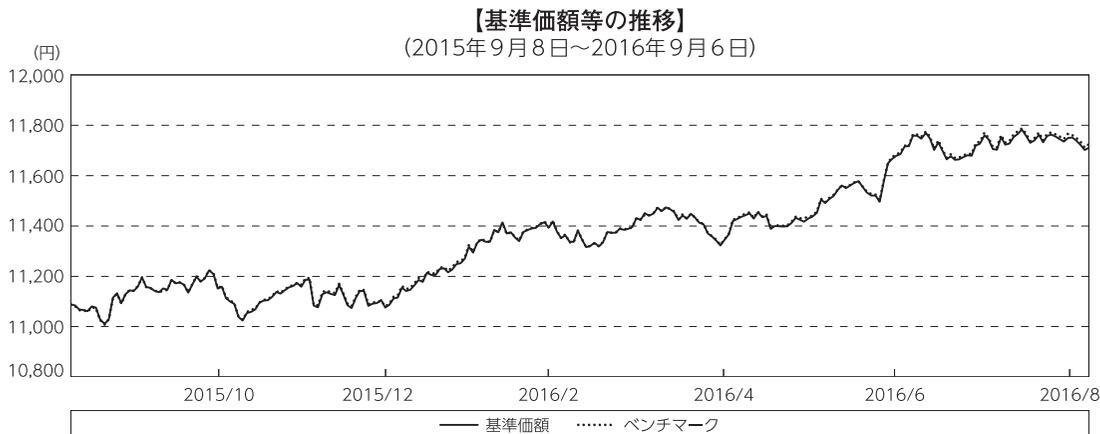
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2015年9月7日	円 11,088	% —	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) 111.34	% —	% 96.0	% —
9月末	11,144	0.5	111.91	0.5	97.4	—
10月末	11,151	0.6	112.00	0.6	98.2	—
11月末	11,173	0.8	112.20	0.8	97.5	—
12月末	11,076	△0.1	111.26	△0.1	97.0	—
2016年1月末	11,269	1.6	113.19	1.7	97.9	—
2月末	11,393	2.8	114.42	2.8	92.6	—
3月末	11,424	3.0	114.74	3.1	100.3	—
4月末	11,345	2.3	113.94	2.3	96.6	—
5月末	11,417	3.0	114.79	3.1	100.8	—
6月末	11,679	5.3	117.32	5.4	91.4	—
7月末	11,727	5.8	117.84	5.8	99.9	—
8月末	11,752	6.0	118.09	6.1	99.4	—
(期末) 2016年9月6日	円 11,711	% 5.6	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) 117.74	% 5.7	% 99.2	% —

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の変動要因

基準価額は、期首11,088円から期末11,711円へと上昇し、値上がり額は623円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下（価格は上昇）したことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

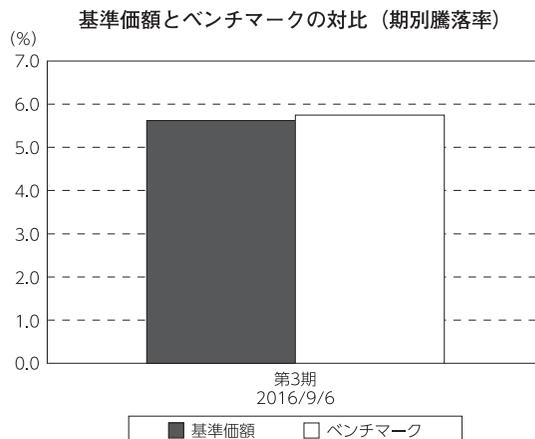
今期の基準価額の騰落率は+5.6%となり、ベンチマークの+5.7%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること



(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

○今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

○1万口当たりの費用明細

(2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 6	% 0.050	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(5)	(0.048)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	6	0.050	
期中の平均基準価額は、11,379円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2015年9月8日～2016年9月6日)

公社債

		買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券 千米ドル 16,947	千米ドル 3,887	
	カナダ	国債証券 千カナダドル 761	千カナダドル 31	
	イギリス	国債証券 千英ポンド 2,053	千英ポンド 513	
	スイス	国債証券 千スイスフラン 91	千スイスフラン -	
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ 1,068	千スウェーデンクローナ -	
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 543	千ノルウェークローネ -	
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 1,205	千デンマーククローネ 112	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券 2,087	507	
	イタリア	国債証券 4,697	1,262	
	フランス	国債証券 2,767	407	
	オランダ	国債証券 533	47	
	スペイン	国債証券 2,554	535	
	ベルギー	国債証券 693	105	
	オーストリア	国債証券 312	112	
	フィンランド	国債証券 75	-	
	アイルランド	国債証券 184	-	
	国	ポーランド	国債証券 千ズロチ 596	千ズロチ -
		シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 189	千シンガポールドル -
オーストラリア		国債証券 千豪ドル 823	千豪ドル 22	
メキシコ		国債証券 千メキシコペソ 3,844	千メキシコペソ -	
南アフリカ		国債証券 千ランド 2,722	千ランド 717	

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年9月8日～2016年9月6日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
		百万円	%		百万円	百万円
為替先物取引	33,285	512	1.5	36,739	566	1.5
為替直物取引	4,010	60	1.5	729	—	—
預金	2,603	2,603	100.0	2,603	2,603	100.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月6日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	16,950	18,065	1,871,546	43.3	—	16.9	17.6	8.8
カナダ	千カナダドル 890	千カナダドル 1,035	82,943	1.9	—	0.9	0.8	0.2
イギリス	千英ポンド 1,880	千英ポンド 2,553	351,970	8.1	—	6.0	1.8	0.3
スイス	千スイスフラン 80	千スイスフラン 90	9,592	0.2	—	—	0.2	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 900	千スウェーデンクローナ 1,120	13,541	0.3	—	0.3	—	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 500	千ノルウェークローネ 544	6,809	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,040	千デンマーククローネ 1,463	22,703	0.5	—	0.5	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
	1,540	2,025	233,825	5.4	—	4.6	0.9	—
イタリア	3,930	4,660	537,990	12.4	—	5.8	4.7	1.9
フランス	2,590	3,239	373,914	8.6	—	6.7	1.9	—
オランダ	590	742	85,754	2.0	—	1.3	0.7	—
スペイン	2,270	2,739	316,186	7.3	—	3.7	2.1	1.6
ベルギー	560	807	93,223	2.2	—	1.8	0.3	—
オーストリア	260	360	41,621	1.0	—	0.8	0.2	—
フィンランド	130	147	17,065	0.4	—	0.3	0.1	—
アイルランド	220	275	31,811	0.7	—	0.5	0.2	—
ポーランド	千ズロチ 760	千ズロチ 805	21,427	0.5	—	0.2	0.3	—
シンガポール	千シンガポールドル 380	千シンガポールドル 404	30,863	0.7	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル 910	千豪ドル 1,020	80,375	1.9	—	1.2	0.6	—
メキシコ	千メキシコペソ 6,400	千メキシコペソ 7,132	39,801	0.9	—	0.5	0.3	0.2
南アフリカ	千ランド 4,150	千ランド 3,637	26,190	0.6	—	0.4	0.1	0.1
合 計	—	—	4,289,160	99.2	—	52.9	33.1	13.2

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY BOND	6.25	70	92	9,576	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	240	255	26,431	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	210	291	30,251	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	80	117	12,121	2026/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	80	112	11,693	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	27	2,880	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	40	55	5,781	2029/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	330	371	38,512	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	100	131	13,640	2043/11/15
	US TREASURY N/B	0.625	150	149	15,533	2017/8/31
	US TREASURY N/B	0.625	410	409	42,446	2017/9/30
	US TREASURY N/B	0.75	700	700	72,553	2017/10/31
	US TREASURY N/B	4.25	80	83	8,633	2017/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	100	102	10,631	2017/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	300	307	31,889	2018/1/31
	US TREASURY N/B	0.75	340	339	35,218	2018/2/28
	US TREASURY N/B	0.75	280	279	29,004	2018/3/31
	US TREASURY N/B	0.75	300	299	31,070	2018/4/15
	US TREASURY N/B	1.0	200	200	20,797	2018/5/31
	US TREASURY N/B	0.875	360	360	37,352	2018/7/15
	US TREASURY N/B	4.0	170	180	18,721	2018/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	250	252	26,194	2018/9/30
	US TREASURY N/B	1.25	100	100	10,452	2018/11/30
	US TREASURY N/B	1.375	200	202	20,968	2018/12/31
	US TREASURY N/B	1.125	250	251	26,058	2019/1/15
	US TREASURY N/B	1.25	190	191	19,867	2019/1/31
	US TREASURY N/B	1.375	250	253	26,226	2019/2/28
	US TREASURY N/B	0.875	300	299	31,076	2019/4/15
	US TREASURY N/B	1.5	230	233	24,219	2019/5/31
	US TREASURY N/B	1.625	200	204	21,136	2019/6/30
	US TREASURY N/B	0.875	200	199	20,703	2019/7/31
	US TREASURY N/B	3.625	70	75	7,819	2019/8/15
	US TREASURY N/B	1.75	100	102	10,612	2019/9/30
	US TREASURY N/B	1.25	150	151	15,680	2019/10/31
	US TREASURY N/B	1.5	100	101	10,533	2019/10/31
	US TREASURY N/B	3.375	330	354	36,765	2019/11/15
	US TREASURY N/B	1.0	20	20	2,073	2019/11/30
	US TREASURY N/B	3.625	140	152	15,778	2020/2/15
	US TREASURY N/B	1.375	100	101	10,483	2020/2/29
	US TREASURY N/B	1.125	130	130	13,507	2020/4/30
	US TREASURY N/B	1.375	100	101	10,482	2020/4/30
	US TREASURY N/B	3.5	80	87	9,016	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	150	152	15,787	2020/5/31
	US TREASURY N/B	1.625	150	153	15,856	2020/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	140	148	15,350	2020/8/15

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	2.625	440	466	48,333	2020/11/15
	US TREASURY N/B	2.375	500	525	54,454	2020/12/31
	US TREASURY N/B	2.125	300	312	32,347	2021/1/31
	US TREASURY N/B	3.625	200	221	22,911	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	180	186	19,318	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	350	366	37,973	2021/3/31
	US TREASURY N/B	3.125	350	380	39,432	2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	130	134	13,962	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	350	365	37,818	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.125	350	364	37,809	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	100	103	10,745	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.75	100	102	10,602	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	120	122	12,717	2022/5/15
	US TREASURY N/B	1.875	100	102	10,659	2022/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	50	50	5,250	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	260	271	28,095	2022/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	250	255	26,428	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	210	217	22,544	2023/2/15
	US TREASURY N/B	1.5	350	351	36,427	2023/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	120	120	12,481	2023/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	230	234	24,300	2023/5/15
	US TREASURY N/B	2.5	150	160	16,621	2023/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	100	108	11,272	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	100	108	11,286	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	150	160	16,663	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	150	158	16,377	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	230	240	24,889	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	180	186	19,274	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	140	147	15,300	2025/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	120	120	12,444	2026/2/15
	US TREASURY N/B	5.0	200	302	31,384	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	60	86	8,918	2038/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	100	145	15,111	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	60	79	8,200	2040/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	60	66	6,852	2042/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	120	132	13,688	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	70	82	8,548	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	90	115	12,007	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	180	231	24,018	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.375	30	37	3,836	2044/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	60	70	7,338	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	80	92	9,562	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	190	198	20,595	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	140	161	16,733	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	410	461	47,861	2045/8/15
	US TREASURY NOTE	2.875	250	258	26,746	2018/3/31
小	計				1,871,546	

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT		0.25	70	69	5,577	2018/5/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.25	60	60	4,871	2018/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.75	150	154	12,370	2019/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5	110	113	9,089	2020/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		0.75	120	120	9,652	2021/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT		0.75	30	30	2,410	2021/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.5	40	44	3,590	2024/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		2.25	70	77	6,206	2025/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		8.0	40	67	5,415	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		5.75	30	48	3,899	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		5.0	20	31	2,545	2037/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		4.0	50	73	5,891	2041/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT		3.5	100	142	11,423	2045/12/1
小 計						82,943	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY		1.0	90	90	12,515	2017/9/7
	UK TREASURY		4.5	100	111	15,317	2019/3/7
	UK TREASURY		3.75	140	155	21,427	2019/9/7
	UK TREASURY		3.75	210	240	33,108	2020/9/7
	UK TREASURY		8.0	50	68	9,426	2021/6/7
	UK TREASURY		4.0	100	120	16,597	2022/3/7
	UK TREASURY		1.75	60	65	8,971	2022/9/7
	UK TREASURY		2.25	100	112	15,532	2023/9/7
	UK TREASURY		2.0	120	134	18,560	2025/9/7
	UK TREASURY		6.0	90	143	19,813	2028/12/7
	UK TREASURY		4.75	50	75	10,381	2030/12/7
	UK TREASURY		4.25	30	43	6,055	2032/6/7
	UK TREASURY		4.5	40	61	8,523	2034/9/7
	UK TREASURY		4.25	20	30	4,220	2036/3/7
	UK TREASURY		4.75	100	167	23,139	2038/12/7
	UK TREASURY		3.5	160	242	33,467	2045/1/22
	UK TREASURY		4.25	30	52	7,174	2046/12/7
UK TREASURY		4.0	80	157	21,735	2060/1/22	
UK TSY 3 1/4% 2044		3.25	250	360	49,756	2044/1/22	
UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)		4.25	60	117	16,244	2055/12/7	
小 計						351,970	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT		2.0	80	90	9,592	2021/4/28
小 計						9,592	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT		1.5	400	449	5,438	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT		2.5	300	366	4,434	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5	200	303	3,668	2039/3/30
小 計						13,541	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.75	200	227	2,843	2021/5/25

銘柄	当期末						
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
ノルウェー	%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円			
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	300	317	3,966	2025/3/13	
小計					6,809		
デンマーク		千デンマーククロネ	千デンマーククロネ				
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5	350	393	6,096	2023/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	1.75	300	346	5,378	2025/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5	390	723	11,228	2039/11/15	
小計					22,703		
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ				
ドイツ	国債証券	BUNDESBLIGATION	—	200	204	23,618	2020/4/17
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	100	114	13,163	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	250	284	32,782	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	80	90	10,446	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	100	117	13,514	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	10	11	1,338	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	190	210	24,249	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	90	95	11,001	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	130	203	23,514	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	60	106	12,235	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	50	89	10,341	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	50	86	9,955	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	100	198	22,929	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	100	167	19,379	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	30	46	5,355	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.75	200	202	23,365	2018/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	240	255	29,498	2018/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.25	140	140	16,253	2018/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	100	108	12,542	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	150	161	18,691	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	550	606	70,012	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	160	178	20,550	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	100	104	12,043	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	170	194	22,480	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	90	103	12,001	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	30	34	4,014	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	110	127	14,751	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	210	256	29,597	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	230	241	27,900	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	102	11,801	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	100	125	14,477	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	50	63	7,382	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	80	126	14,561	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	120	152	17,572	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	50	56	6,493	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	90	119	13,806	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	30	31	3,611	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	50	65	7,541	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	210	289	33,432	2028/9/1

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	90	131	15,162	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	60	75	8,692	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	50	51	5,886	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	110	165	19,114	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	40	54	6,313	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	30	46	5,389	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	110	171	19,824	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	50	77	8,940	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	30	37	4,282	2046/9/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	200	208	24,069	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	150	155	17,897	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	160	163	18,818	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	50	56	6,548	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	160	189	21,887	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	150	156	18,026	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	110	140	16,173	2030/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	70	80	9,270	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	90	107	12,420	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	150	178	20,579	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	120	142	16,495	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	160	185	21,393	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	180	206	23,849	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	70	108	12,488	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	100	132	15,278	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	60	76	8,811	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	120	196	22,716	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	140	159	18,368	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	150	246	28,407	2038/10/25
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	70	125	14,512	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	60	93	10,769	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	70	131	15,131	2055/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	100	113	13,080	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	100	115	13,382	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	20	23	2,732	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	30	37	4,385	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	70	82	9,498	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	40	41	4,747	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	80	83	9,632	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	50	67	7,790	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	100	177	20,504	2042/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5	330	351	40,578	2018/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1	230	248	28,693	2018/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	200	201	23,266	2019/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	130	139	16,119	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	170	178	20,557	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	50	57	6,608	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	30	35	4,154	2020/10/31

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	100	125	14,436	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	30	30	3,566	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	190	247	28,553	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	100	131	15,169	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	120	152	17,558	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	20	23	2,665	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	110	145	16,775	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	70	76	8,789	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	60	87	10,091	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	60	85	9,906	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	80	123	14,236	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	50	82	9,571	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	60	92	10,695	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	50	80	9,280	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	30	42	4,913	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	110	129	14,929	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	30	38	4,447	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.6	130	157	18,217	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	20	30	3,508	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	60	104	12,094	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	50	84	9,763	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	120	191	22,141	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	40	70	8,122	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	20	21	2,471	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	30	35	4,055	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	50	57	6,623	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	30	31	3,676	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	50	83	9,648	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	40	67	7,793	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	40	63	7,352	2044/6/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.375	20	22	2,636	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	80	93	10,770	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	30	31	3,659	2031/4/15
アイルランド	国債証券	IRELAND (REPUBLIC OF) 4.4	4.4	70	79	9,170	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	60	85	9,874	2025/3/13
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	60	72	8,414	2030/5/15
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	30	37	4,352	2023/3/20
小 計						1,731,394	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	250	277	7,387	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	180	178	4,753	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	240	261	6,963	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	90	87	2,322	2026/7/25
小 計						21,427	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	0.5	40	39	3,042	2018/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	160	167	12,770	2021/6/1

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	50	52	4,011	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	80	88	6,736	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	50	56	4,303	2042/4/1
小	計					30,863	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	140	153	12,061	2019/3/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	70	77	6,102	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	120	121	9,544	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	80	98	7,731	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	110	117	9,237	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	90	99	7,876	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	150	180	14,252	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	30	32	2,543	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	50	56	4,439	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	30	39	3,083	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	40	44	3,503	2039/6/21
小	計					80,375	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4.75	1,200	1,192	6,652	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	1,000	1,086	6,063	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	1,200	1,246	6,956	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	1,000	1,220	6,813	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	200	232	1,297	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	300	427	2,383	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	500	589	3,287	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	1,000	1,137	6,346	2023/12/7
小	計					39,801	
南アフリカ			千ランド	千ランド			
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	800	804	5,793	2017/9/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	700	659	4,745	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	250	240	1,729	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	650	589	4,246	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	800	657	4,734	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	700	506	3,644	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	250	180	1,296	2041/2/28
小	計					26,190	
合	計					4,289,160	

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,289,160	97.4
コール・ローン等、その他	116,575	2.6
投資信託財産総額	4,405,735	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(4,358,844千円)の投資信託財産総額(4,405,735千円)に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=103.60円、1カナダドル=80.12円、1英ポンド=137.85円、1スイスフラン=105.66円、1スウェーデンクローナ=12.09円、1ノルウェークローネ=12.50円、1デンマーククローネ=15.51円、1ユーロ=115.43円、1ズロチ=26.60円、1シンガポールドル=76.33円、1豪ドル=78.78円、1メキシコペソ=5.58円、1ランド=7.20円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,753,376,095
コール・ローン等	24,339,744
公社債(評価額)	4,289,160,325
未収入金	4,410,463,535
未収利息	24,181,193
前払費用	5,231,298
(B) 負債	4,428,861,347
未払金	4,428,731,730
未払解約金	4,795
未払利息	22
その他未払費用	124,800
(C) 純資産総額(A-B)	4,324,514,748
元本	3,692,547,438
次期繰越損益金	631,967,310
(D) 受益権総口数	3,692,547,438口
1万円当たり基準価額(C/D)	11,711円

(注) 期首元本額は1,221,501,342円、期中追加設定元本額は3,189,269,688円、期中一部解約元本額は718,223,592円、1口当たり純資産額は1.1711円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

- ・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) 2,706,225,451円
- ・野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型 710,779,048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 264,470,021円
- ・野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 7,514,509円
- ・野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 1,211,454円
- ・野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け) 850,522円
- ・野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 763,065円
- ・野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 733,368円

○損益の状況 (2015年9月8日~2016年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	63,253,122
受取利息	63,263,736
支払利息	△ 10,614
(B) 有価証券売買損益	98,512,089
売買益	794,804,580
売買損	△696,292,491
(C) 保管費用等	△ 1,385,628
(D) 当期損益金(A+B+C)	160,379,583
(E) 前期繰越損益金	132,956,867
(F) 追加信託差損益金	441,687,672
(G) 解約差損益金	△103,056,812
(H) 計(D+E+F+G)	631,967,310
次期繰越損益金(H)	631,967,310

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

<お申し込み時の留意点>

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

(2016年9月6日現在)

年 月	日
2016年9月	-
10月	-
11月	10、11、22、24
12月	22、26、27

※2016年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。