

# 野村日本国債インデックスファンド (確定拠出年金向け)

## 運用報告書(全体版)

第15期(決算日2016年5月10日)

作成対象期間(2015年5月12日~2016年5月10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/国内/債券/インデックス型	
信託期間	2002年1月7日以降、無期限とします。	
運用方針	親投資信託である「国内債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、直接公社債等に投資する場合があります。	
主な投資対象	野村日本国債インデックスファンド (確定拠出年金向け)	「国内債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村日本国債インデックスファンド (確定拠出年金向け)	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。
	国内債券マザーファンド	外貨建て資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等から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、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/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク NOMURA-BPI国債	債券組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	百万円
11期(2012年5月10日)	11,474	5	2.8	349.929	3.1	99.2	3,716
12期(2013年5月10日)	11,663	5	1.7	357.008	2.0	99.2	4,047
13期(2014年5月12日)	11,828	5	1.5	363.350	1.8	99.1	4,391
14期(2015年5月11日)	12,118	5	2.5	373.608	2.8	99.3	4,768
15期(2016年5月10日)	12,978	5	7.1	401.668	7.5	99.5	5,384

\*基準価額の騰落率は分配金込み。

\*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。

NOMURA-BPI国債は、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。  
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

## ○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 NOMURA-BPI国債	債券組入比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率			
(期首)	円	%	%	%	%
2015年5月11日	12,118	—	373.608	99.3	—
5月末	12,110	△0.1	373.501	98.0	—
6月末	12,101	△0.1	373.286	98.4	—
7月末	12,135	0.1	374.442	98.5	—
8月末	12,152	0.3	375.113	97.7	—
9月末	12,192	0.6	376.397	97.7	—
10月末	12,239	1.0	378.001	98.4	—
11月末	12,234	1.0	377.894	98.1	—
12月末	12,314	1.6	380.531	97.6	—
2016年1月末	12,482	3.0	385.751	97.2	—
2月末	12,710	4.9	392.964	99.0	—
3月末	12,830	5.9	396.850	99.5	—
4月末	12,954	6.9	400.751	99.5	—
(期末)					
2016年5月10日	12,983	7.1	401.668	99.5	—

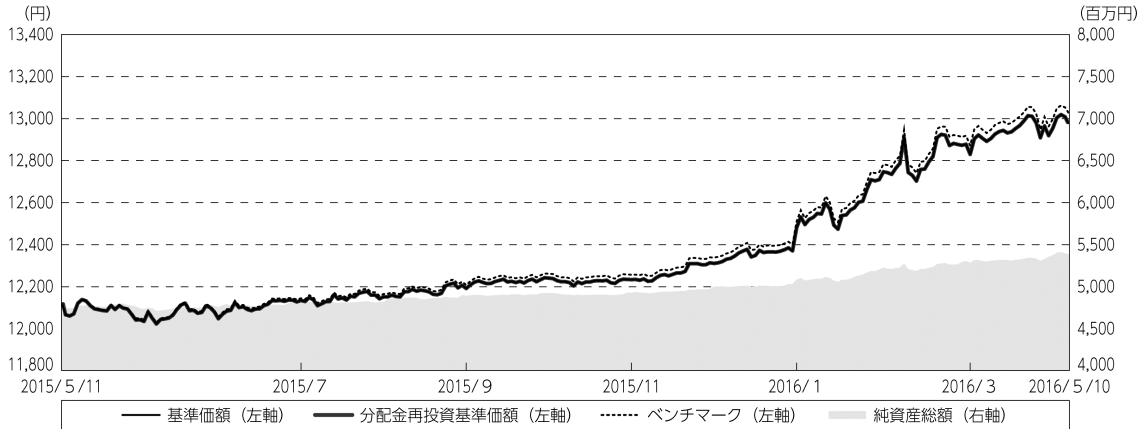
\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\*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：12,118円

期末：12,978円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：7.1%（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。作定期首（2015年5月11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、NOMURA-BPI国債です。ベンチマークは、作定期首（2015年5月11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12,118円から期末12,983円（分配金込み）に865円の値上がりとなりました。

世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。また日銀による国債買い入れの平均残存年限長期化やマイナス金利政策の導入などを背景に、国内債券利回りが低下（価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

期首から2015年6月中旬にかけては、円安の進行や2015年1－3月期実質GDP（国内総生産）成長率が景気の拡大を示したことを受けて国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券市場は軟調となりました。その後は8月中旬から9月下旬や2016年1月から2月中旬にかけては、世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。日銀が国債買い入れの平均残存年限長期化を発表したことや、マイナス金利政策の導入を決定したことなどを背景に、国内債券市場は堅調となり国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）]

NOMURA-BPI国債の動きに連動した投資成果を得るために、[国内債券マザーファンド]へ投資しました。期を通じてマザーファンドの組入比率は高位に維持しました。

### [国内債券マザーファンド]

NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、デュレーション（金利感応度）などを考慮して選択した利付国債銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（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。

## ○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+7.1%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の+7.5%を0.4ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

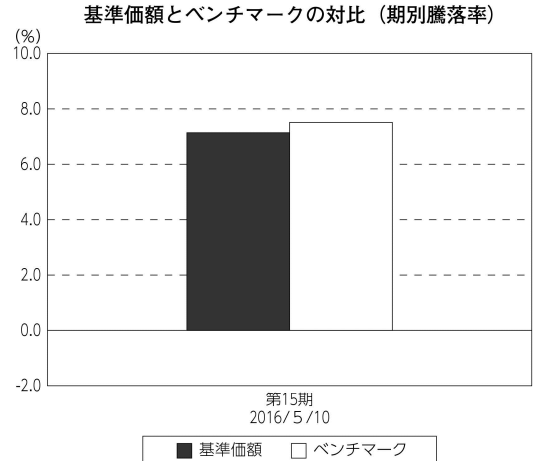
### （マイナス要因）

費用として信託報酬が生じること

### （その他の差異要因）

マザーファンドにおいて、資金流入に伴う取引で価格差や取引コストが生じること

マザーファンドにおいて、ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること



(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、NOMURA-BPI国債です。

## ◎分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準などを勘案し決定しました。
- (2) 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15期
	2015年5月12日～ 2016年5月10日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.039%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,977

(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

### 〔国内債券マザーファンド〕

引き続き、債券組入比率を高位に保ち、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した利付債券に分散投資することでNOMURA-BPI国債との連動を高めるように運用を行ってまいります。

### 〔野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）〕

当ファンドでは引き続き、〔国内債券マザーファンド〕の組入比率を高位に保つことでNOMURA-BPI国債との連動を高めるように運用を行ってまいります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 40	% 0.323	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	( 9 )	(0.075)	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 ）	(27)	(0.215)	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	0	0.002	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益口数
（ 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
合 計	40	0.325	
期中の平均基準価額は、12,371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5月12日～2016年5月10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
国内債券マザーファンド	千口 501,042	千円 652,820	千口 311,669	千円 404,141

\* 単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）&gt;

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 261	百万円 261	100.0	百万円 261	百万円 261	100.0

## &lt;国内債券マザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 3,775	百万円 288	7.6	百万円 3,040	百万円 210	6.9
預金	1,919	1,919	100.0	1,919	1,919	100.0

平均保有割合 57.9%

※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證券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年5月10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
国内債券マザーファンド	千口 3,740,066	千口 3,929,439	千円 5,383,724

\*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5月10日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
国内債券マザーファンド	千円 5,383,724	% 99.5
コール・ローン等、その他	29,192	0.5
投資信託財産総額	5,412,916	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年5月10日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	5,412,916,619
コール・ローン等	14,344,913
国内債券マザーファンド(評価額)	5,383,724,945
未収入金	14,846,761
(B) 負債	28,636,391
未払収益分配金	2,074,461
未払解約金	18,259,573
未払信託報酬	8,247,409
未払利息	25
その他未払費用	54,923
(C) 純資産総額(A-B)	5,384,280,228
元本	4,148,922,870
次期繰越損益金	1,235,357,358
(D) 受益権総口数	4,148,922,870口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,978円

(注) 期首元本額は3,935,215,553円、期中追加設定元本額は823,685,302円、期中一部解約元本額は609,977,985円、1口当たり純資産額は1,2978円です。

## ○損益の状況（2015年5月12日～2016年5月10日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	3,622
受取利息	4,085
支払利息	△ 463
(B) 有価証券売買損益	355,761,068
売買益	375,027,262
売買損	△ 19,266,194
(C) 信託報酬等	△ 16,170,591
(D) 当期損益金(A+B+C)	339,594,099
(E) 前期繰越損益金	268,160,558
(F) 追加信託差損益金	629,677,162
(配当等相当額)	( 602,366,462)
(売買損益相当額)	( 27,310,700)
(G) 計(D+E+F)	1,237,431,819
(H) 収益分配金	△ 2,074,461
次期繰越損益金(G+H)	1,235,357,358
追加信託差損益金	629,677,162
(配当等相当額)	( 603,350,311)
(売買損益相当額)	( 26,326,851)
分配準備積立金	605,680,196

\*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5月12日～2016年5月10日）は以下の通りです。

項目	当期
	2015年5月12日～ 2016年5月10日
a. 配当等収益(経費控除後)	55,244,656円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	284,349,443円
c. 信託約款に定める収益調整金	629,677,162円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	268,160,558円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,237,431,819円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,982円
g. 分配金	2,074,461円
h. 分配金(1万口当たり)	5円



## ○分配金のお知らせ

---

1 万口当たり分配金（税込み）	5円
-----------------	----

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

# 国内債券マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016年5月10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	NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資は行いません。

**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/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク NOMURA-BPI国債		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
11期(2012年5月10日)	11,945	3.1	349.929	3.1	99.2	—	5,536
12期(2013年5月10日)	12,185	2.0	357.008	2.0	99.2	—	6,182
13期(2014年5月12日)	12,400	1.8	363.350	1.8	99.1	—	6,349
14期(2015年5月11日)	12,749	2.8	373.608	2.8	99.3	—	6,933
15期(2016年5月10日)	13,701	7.5	401.668	7.5	99.5	—	8,223

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

NOMURA-BPI国債は、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。  
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

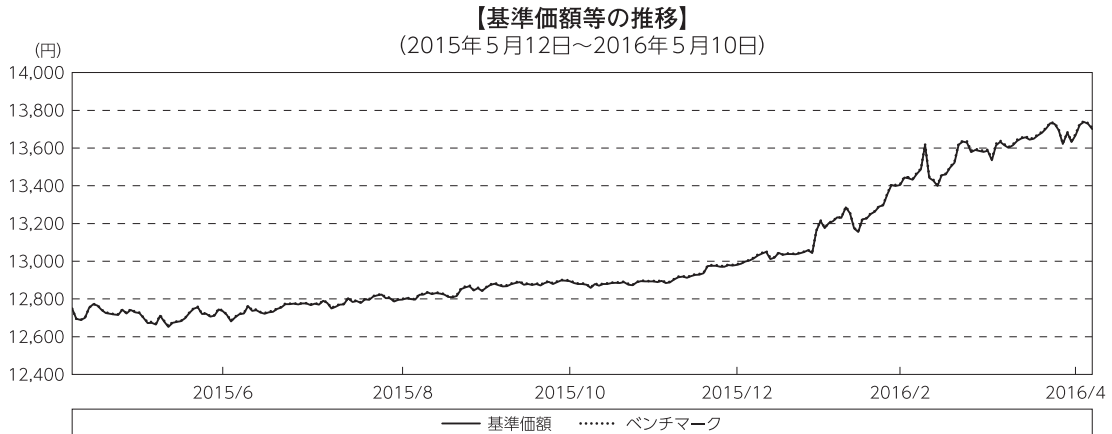
年月日	基準価額		ベンチマーク NOMURA-BPI国債		債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2015年5月11日	12,749	—	373.608	—	99.3	—
5月末	12,742	△0.1	373.501	△0.0	98.0	—
6月末	12,736	△0.1	373.286	△0.1	98.4	—
7月末	12,775	0.2	374.442	0.2	98.5	—
8月末	12,797	0.4	375.113	0.4	97.7	—
9月末	12,842	0.7	376.397	0.7	97.7	—
10月末	12,895	1.1	378.001	1.2	98.4	—
11月末	12,893	1.1	377.894	1.1	98.1	—
12月末	12,981	1.8	380.531	1.9	97.6	—
2016年1月末	13,161	3.2	385.751	3.2	97.2	—
2月末	13,405	5.1	392.964	5.2	99.1	—
3月末	13,535	6.2	396.850	6.2	99.6	—
4月末	13,669	7.2	400.751	7.3	99.5	—
(期末) 2016年5月10日	13,701	7.5	401.668	7.5	99.5	—

\*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、NOMURA-BPI国債です。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。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首12,749円から期末13,701円に952円の値上がりとなりました。

世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。また日銀による国債買い入れの平均残存年限長期化やマイナス金利政策の導入などを背景に、国内債券利回りが低下（価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

期首から2015年6月中旬にかけては、円安の進行や2015年1-3月期実質GDP（国内総生産）成長率が景気の拡大を示したことを受けて国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券市場は軟調となりました。その後は8月中旬から9月下旬や2016年1月から2月中旬にかけては、世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。日銀が国債買い入れの平均残存年限長期化を発表したことや、マイナス金利政策の導入を決定したことなどを背景に、国内債券市場は堅調となり国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

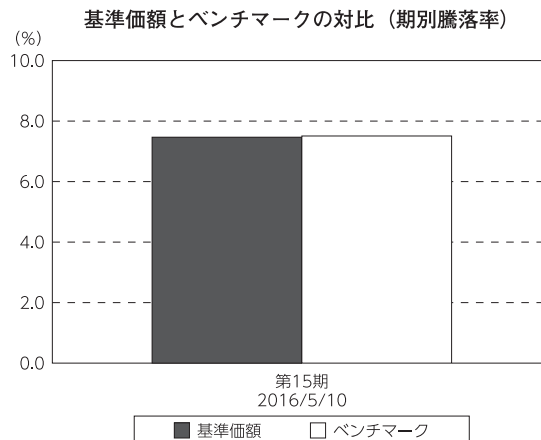
## ○当ファンドのポートフォリオ

NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、デュレーション（金利感応度）などを考慮して選択した利付国債銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（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。

## ○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+7.5%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の+7.5%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

- ・ 資金流入に伴う取引で価格差や取引コストが生じること
- ・ ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI国債です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、債券組入比率を高位に保ち、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した利付債券に分散投資することでNOMURA-BPI国債との連動を高めるように運用を行ってまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	3,775,197	3,040,399

\*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5月12日～2016年5月10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	$\frac{D}{C}$
公社債	3,775	288	7.6	3,040	210	6.9
預金	1,919	1,919	100.0	1,919	1,919	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證券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年5月10日現在)

### 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)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B B格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
千円	千円	%	%	%	%	%		
国債証券	7,160,000 ( 10,000)	8,184,897 ( 16,223)	99.5 ( 0.2)	— (—)	64.8 ( 0.2)	23.8 ( —)	11.0 ( —)	
合 計	7,160,000 ( 10,000)	8,184,897 ( 16,223)	99.5 ( 0.2)	— (—)	64.8 ( 0.2)	23.8 ( —)	11.0 ( —)	

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
		%	千円	千円
国債証券				
国庫債券	利付(2年)第355回	0.1	60,000	60,284
国庫債券	利付(2年)第357回	0.1	100,000	100,544
国庫債券	利付(2年)第360回	0.1	130,000	130,799
国庫債券	利付(5年)第105回	0.2	50,000	50,255
国庫債券	利付(5年)第106回	0.2	40,000	40,253
国庫債券	利付(5年)第107回	0.2	40,000	40,300
国庫債券	利付(5年)第108回	0.1	60,000	60,353
国庫債券	利付(5年)第110回	0.3	20,000	20,208
国庫債券	利付(5年)第111回	0.4	40,000	40,492
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	30,000	30,419
国庫債券	利付(5年)第113回	0.3	50,000	50,593
国庫債券	利付(5年)第114回	0.3	20,000	20,265
国庫債券	利付(5年)第115回	0.2	60,000	60,654
国庫債券	利付(5年)第116回	0.2	50,000	50,597
国庫債券	利付(5年)第117回	0.2	80,000	81,034
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	50,000	50,704
国庫債券	利付(5年)第119回	0.1	40,000	40,438
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	20,000	20,301
国庫債券	利付(5年)第121回	0.1	40,000	40,467
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	80,000	81,004
国庫債券	利付(5年)第123回	0.1	170,000	172,247
国庫債券	利付(5年)第124回	0.1	80,000	81,128
国庫債券	利付(5年)第125回	0.1	70,000	71,032
国庫債券	利付(5年)第126回	0.1	70,000	71,092
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	10,000	16,223
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	10,000	15,776
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	20,000	31,825
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	15,000	24,069
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	28,000	43,479
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	20,000	30,619
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	30,000	44,127
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	20,000	27,417
国庫債券	利付(10年)第287回	1.9	50,000	51,204
国庫債券	利付(10年)第288回	1.7	65,000	66,745
国庫債券	利付(10年)第289回	1.5	100,000	102,850
国庫債券	利付(10年)第290回	1.4	50,000	51,542
国庫債券	利付(10年)第291回	1.3	20,000	20,579
国庫債券	利付(10年)第292回	1.7	35,000	36,275
国庫債券	利付(10年)第293回	1.8	30,000	31,305
国庫債券	利付(10年)第294回	1.7	40,000	41,656
国庫債券	利付(10年)第295回	1.5	25,000	25,929
国庫債券	利付(10年)第296回	1.5	65,000	67,706
国庫債券	利付(10年)第297回	1.4	40,000	41,727
国庫債券	利付(10年)第298回	1.3	20,000	20,811
国庫債券	利付(10年)第299回	1.3	45,000	46,998
国庫債券	利付(10年)第300回	1.5	35,000	36,755
国庫債券	利付(10年)第301回	1.5	45,000	47,458

銘柄	当期末				
	利	率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券 利付 (10年) 第302回		1.4	40,000	42,059	2019/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第303回		1.4	45,000	47,498	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第304回		1.3	30,000	31,564	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第305回		1.3	90,000	95,044	2019/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第306回		1.4	45,000	47,871	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第307回		1.3	30,000	31,797	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第308回		1.3	30,000	31,916	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第309回		1.1	40,000	42,222	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第310回		1.0	30,000	31,631	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第311回		0.8	20,000	20,911	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第312回		1.2	70,000	74,679	2020/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第314回		1.1	30,000	31,958	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第315回		1.2	50,000	53,708	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第316回		1.1	10,000	10,690	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第317回		1.1	30,000	32,173	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第318回		1.0	80,000	85,361	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第319回		1.1	30,000	32,275	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第320回		1.0	110,000	117,719	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第321回		1.0	40,000	42,932	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第322回		0.9	30,000	32,021	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第323回		0.9	20,000	21,399	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第324回		0.8	70,000	74,465	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第325回		0.8	70,000	74,652	2022/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第326回		0.7	40,000	42,481	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第327回		0.8	40,000	42,750	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第328回		0.6	90,000	95,135	2023/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第329回		0.8	70,000	75,100	2023/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第330回		0.8	50,000	53,754	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第331回		0.6	60,000	63,608	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第332回		0.6	60,000	63,683	2023/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第333回		0.6	20,000	21,251	2024/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第334回		0.6	40,000	42,549	2024/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第335回		0.5	50,000	52,818	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回		0.5	40,000	42,285	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回		0.3	10,000	10,396	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第338回		0.4	160,000	167,745	2025/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第339回		0.4	50,000	52,442	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回		0.4	25,000	26,230	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回		0.3	40,000	41,592	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回		0.1	20,000	20,398	2026/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回		2.3	10,000	13,169	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回		2.2	10,000	13,185	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回		2.4	10,000	13,557	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回		2.3	15,000	20,235	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回		1.8	20,000	25,467	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回		1.4	20,000	24,168	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回		1.1	10,000	11,599	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回		1.7	10,000	12,616	2033/6/20



銘柄	当期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	10,000	13,321	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	10,000	13,173	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	30,000	41,701	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	10,000	14,105	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	10,000	14,148	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	10,000	13,997	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	20,000	27,681	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	10,000	13,864	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	10,000	14,273	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	10,000	13,909	2035/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	10,000	14,323	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	10,000	14,348	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	10,000	14,400	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	20,000	28,090	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	20,000	28,551	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	20,000	29,153	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	30,000	43,987	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	20,000	29,074	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	30,000	43,202	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	30,000	42,769	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	40,000	58,263	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	20,000	27,908	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	40,000	58,048	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	42,000	59,244	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	30,000	42,594	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	20,000	28,022	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	20,000	27,662	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	20,000	28,269	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	20,000	27,795	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	20,000	27,313	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	20,000	27,338	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	10,000	13,699	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	20,000	27,461	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	40,000	52,855	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	10,000	13,239	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	20,000	27,068	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	20,000	26,006	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	30,000	39,079	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	20,000	22,677	2046/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第37回	3.1	30,000	31,378	2017/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第41回	1.5	30,000	31,509	2019/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第42回	2.6	10,000	10,819	2019/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第43回	2.9	10,000	11,061	2019/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第44回	2.5	10,000	11,059	2020/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第45回	2.4	10,000	11,020	2020/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第46回	2.2	5,000	5,504	2020/6/22
国庫債券 利付 (20年) 第47回	2.2	15,000	16,605	2020/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第49回	2.1	40,000	44,558	2021/3/22

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
国債証券	%	千円	千円
国庫債券 利付 (20年) 第52回	2.1	25,000	28,162
国庫債券 利付 (20年) 第53回	2.1	10,000	11,323
国庫債券 利付 (20年) 第54回	2.2	10,000	11,380
国庫債券 利付 (20年) 第55回	2.0	10,000	11,324
国庫債券 利付 (20年) 第56回	2.0	10,000	11,377
国庫債券 利付 (20年) 第57回	1.9	10,000	11,315
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	10,000	11,370
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	30,000	33,862
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	10,000	11,090
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	10,000	10,849
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	10,000	10,732
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	10,000	11,450
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	10,000	11,568
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	10,000	11,613
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	20,000	23,072
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	10,000	11,657
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	10,000	11,896
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	30,000	35,449
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	10,000	12,107
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	10,000	11,943
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	20,000	23,819
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	30,000	35,624
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	10,000	11,962
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	40,000	48,011
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	17,000	20,100
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	15,000	17,869
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	10,000	11,865
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	10,000	11,957
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	10,000	12,049
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	10,000	12,000
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	15,000	18,143
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	15,000	18,201
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	10,000	12,037
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	13,000	15,822
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	10,000	12,370
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	20,000	24,862
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	20,000	24,750
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	10,000	12,479
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	30,000	36,957
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	20,000	24,514
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	20,000	24,733
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	10,000	12,631
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	15,000	18,612
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	10,000	12,563
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	140,000	174,939
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	20,000	25,321
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	20,000	25,797
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	20,000	25,889

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	15,000	19,234	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	10,000	12,580	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	20,000	25,237	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	10,000	12,742	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	20,000	25,327	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	10,000	12,411	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	10,000	12,442	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	20,000	25,399	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	10,000	12,866	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	35,000	44,574	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	40,000	51,084	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	30,000	38,442	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	10,000	12,949	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	10,000	12,994	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	10,000	12,758	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	10,000	12,477	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	25,000	30,492	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	20,000	25,007	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	10,000	12,972	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	20,000	25,655	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	10,000	13,150	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	30,000	38,568	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	20,000	25,418	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	20,000	25,490	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	20,000	25,191	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	20,000	25,238	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	15,000	18,700	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	10,000	12,497	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	10,000	12,673	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	15,000	18,775	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	10,000	12,536	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	10,000	12,219	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	10,000	12,377	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	80,000	100,520	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	30,000	37,749	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	20,000	25,492	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	10,000	12,434	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	10,000	12,269	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	10,000	12,616	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	70,000	88,431	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	20,000	24,953	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	10,000	12,315	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	20,000	24,650	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	20,000	24,314	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	40,000	47,218	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	30,000	35,418	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	60,000	72,013	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	50,000	59,098	2035/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	40,000	45,735	2035/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	10,000	10,264	2036/3/20
合 計		7,160,000	8,184,897	

\*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5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	8,184,897	99.3
コール・ローン等、その他	57,684	0.7
投資信託財産総額	8,242,581	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,242,581,016
コール・ローン等	14,873,533
公社債(評価額)	8,184,897,560
未収入金	20,265,000
未収利息	22,169,261
前払費用	375,662
(B) 負債	19,079,240
未払解約金	19,079,214
未払利息	26
(C) 純資産総額(A-B)	8,223,501,776
元本	6,001,927,033
次期繰越損益金	2,221,574,743
(D) 受益権総口数	6,001,927,033口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,701円

(注) 期首元本額は5,438,368,348円、期中追加設定元本額は2,803,082,707円、期中一部解約元本額は2,239,524,022円、1口当たり純資産額は1.3701円です。

## ○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	101,126,186
受取利息	101,128,106
支払利息	△ 1,920
(B) 有価証券売買損益	563,979,730
売買益	577,236,430
売買損	△ 13,256,700
(C) 当期損益金(A+B)	665,105,916
(D) 前期繰越損益金	1,495,210,650
(E) 追加信託差損益金	811,634,715
(F) 解約差損益金	△ 750,376,538
(G) 計(C+D+E+F)	2,221,574,743
次期繰越損益金(G)	2,221,574,743

\*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(E)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(F)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。

## ○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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）	3,929,439,417
バランスセレクト50	572,334,158
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）	529,127,742
バランスセレクト30	507,631,703
バランスセレクト70	215,604,730
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	88,512,814
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	48,371,723
野村DC運用戦略ファンド	41,300,927
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	25,311,797
ネクストコア	24,852,591
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	15,911,757
野村DC運用戦略ファンドM	3,253,380
野村DC運用戦略ファンドA	274,294

## ○お知らせ

該当事項はございません。