

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21期(決算日2022年5月10日)

作成対象期間(2021年5月11日~2022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せん。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せん。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配	達 金 騰 落	中 率	中 率			
	円		円	%		%	%	百万円
17期(2018年5月10日)	12,678		5	0.4	395.239	0.8	99.6	5,998
18期(2019年5月10日)	12,854		5	1.4	402.339	1.8	99.6	6,581
19期(2020年5月11日)	12,804		5	△0.4	402.294	△0.0	99.2	6,951
20期(2021年5月10日)	12,688		5	△0.9	400.066	△0.6	99.1	7,180
21期(2022年5月10日)	12,357		5	△2.6	391.185	△2.2	99.7	6,700

*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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首)	円	%		%	%	%
2021年5月10日	12,688	—	400.066	—	99.1	—
5月末	12,681	△0.1	399.926	△0.0	99.0	—
6月末	12,683	△0.0	400.183	0.0	99.3	—
7月末	12,748	0.5	402.301	0.6	98.9	—
8月末	12,733	0.4	401.892	0.5	99.1	—
9月末	12,681	△0.1	400.389	0.1	99.2	—
10月末	12,662	△0.2	399.941	△0.0	99.0	—
11月末	12,689	0.0	400.931	0.2	99.0	—
12月末	12,656	△0.3	400.021	△0.0	99.0	—
2022年1月末	12,558	△1.0	396.940	△0.8	98.7	—
2月末	12,487	△1.6	394.787	△1.3	98.9	—
3月末	12,448	△1.9	393.640	△1.6	99.1	—
4月末	12,409	△2.2	392.589	△1.9	99.1	—
(期末)						
2022年5月10日	12,362	△2.6	391.185	△2.2	99.7	—

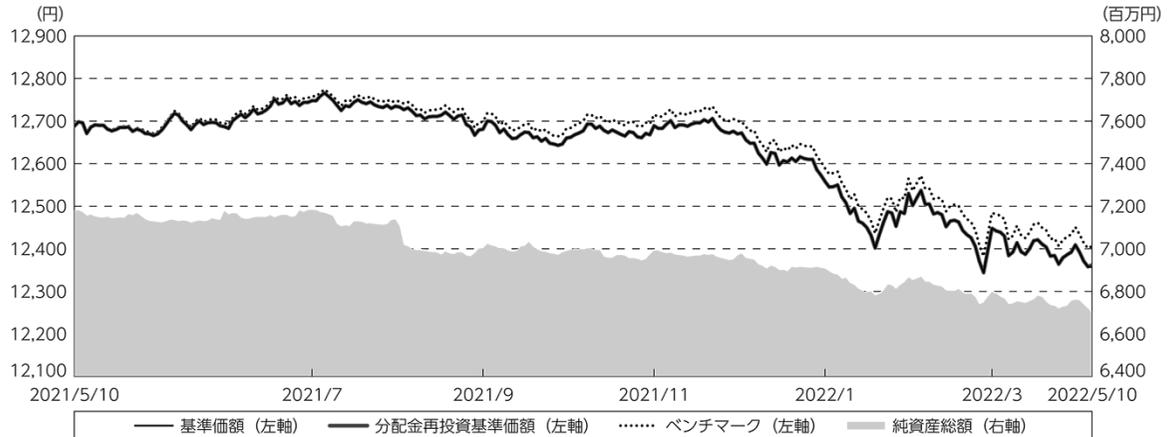
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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：12,688円

期 末：12,357円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：△ 2.6% (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。作成期首(2021年5月10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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々の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、作成期首(2021年5月10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

国内債券利回りが上昇(価格は下落)したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

日銀による金融緩和政策は継続されたものの、世界的なインフレ懸念などを背景に外国債券利回りは上昇(価格は下落)したことなどを受けて、国内債券利回りは上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

【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ない、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日本国債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）を行ないました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

【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受益証券に投資しました。期を通じて国内債券マザーファンド受益証券の組入比率は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-2.6%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の-2.2%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）

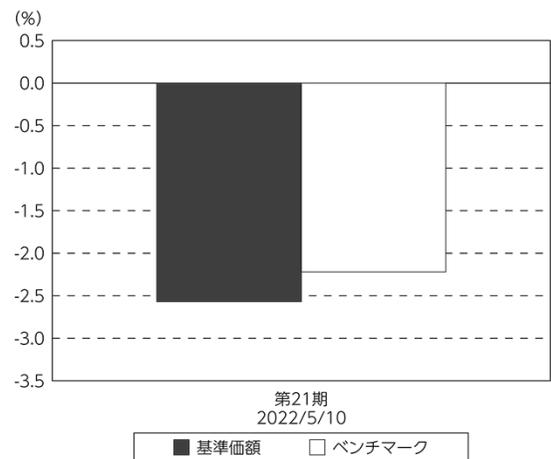
費用として信託報酬が生じること

（その他の差異要因）

マザーファンドにおいて、資金流出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

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、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ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第21期
	2021年5月11日～ 2022年5月10日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.040%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,269

(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日本国債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なってまいります。

[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受益証券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なってまいります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年5月11日～2022年5月10日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 42	% 0.330	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(10)	(0.077)	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 ）	(28)	(0.220)	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)	(0.033)	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) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 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	42	0.332	
期中の平均基準価額は、12,619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。

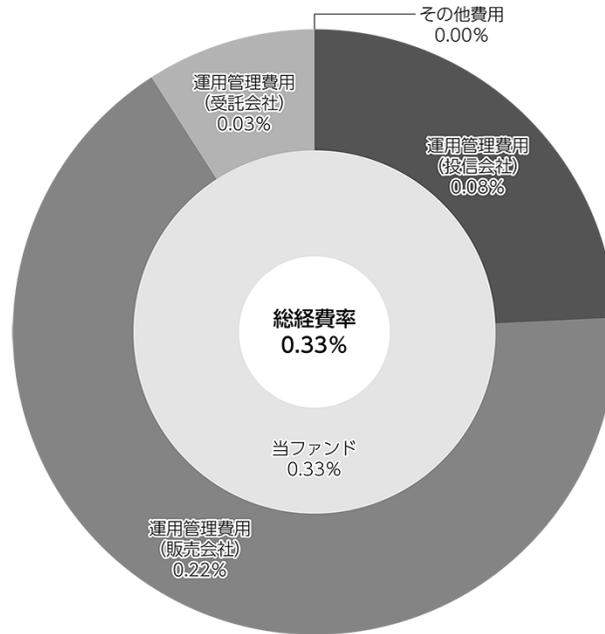
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.33%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年5月11日～2022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 459,620	千円 624,930	千口 698,872	千円 950,561

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月11日～2022年5月10日)

利害関係人との取引状況

<野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）>
該当事項はございません。

<国内債券マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			B A			D C
公社債	百万円 9,475	百万円 —	% —	百万円 17,549	百万円 282	% 1.6
債券先物取引	2,733	2,733	100.0	2,734	2,734	100.0

平均保有割合 29.4%

※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。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	10千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B) / (A)	100.0%

*売買委託手数料総額は、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です。

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です。

○組入資産の明細

(2022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 5,263,043	千口 5,023,791	千円 6,699,728

*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

(2022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 6,699,728	% 99.2
コール・ローン等、その他	56,921	0.8
投資信託財産総額	6,756,649	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（2022年5月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,756,649,203
コール・ローン等	15,008,434
国内債券マザーファンド(評価額)	6,699,728,521
未収入金	41,912,248
(B) 負債	56,250,978
未払収益分配金	2,711,192
未払解約金	42,232,289
未払信託報酬	11,232,667
未払利息	5
その他未払費用	74,825
(C) 純資産総額(A-B)	6,700,398,225
元本	5,422,384,002
次期繰越損益金	1,278,014,223
(D) 受益権総口数	5,422,384,002口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,357円

(注) 期首元本額は5,659,493,653円、期中追加設定元本額は942,121,272円、期中一部解約元本額は1,179,230,923円、1口当たり純資産額は1.2357円です。

○損益の状況（2021年5月11日～2022年5月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,425
支払利息	△ 2,425
(B) 有価証券売買損益	△ 147,550,654
売買益	7,945,612
売買損	△ 155,496,266
(C) 信託報酬等	△ 23,176,308
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 170,729,387
(E) 前期繰越損益金	156,825,297
(F) 追加信託差損益金	1,294,629,505
(配当等相当額)	(1,423,452,037)
(売買損益相当額)	(△ 128,822,532)
(G) 計(D+E+F)	1,280,725,415
(H) 収益分配金	△ 2,711,192
次期繰越損益金(G+H)	1,278,014,223
追加信託差損益金	1,294,629,505
(配当等相当額)	(1,424,258,097)
(売買損益相当額)	(△ 129,628,592)
分配準備積立金	348,859,916
繰越損益金	△ 365,475,198

*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（2021年5月11日～2022年5月10日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年5月11日～ 2022年5月10日
a. 配当等収益(経費控除後)	31,933,737円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,424,258,097円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	319,637,371円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,775,829,205円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,274円
g. 分配金	2,711,192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21期（決算日2022年5月10日）

作成対象期間（2021年5月11日～2022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せん。
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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<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	債先物比率	純資産額
	騰落	率	騰落	率			
	円	%		%	%	%	百万円
17期(2018年5月10日)	13,482	0.8	395.239	0.8	99.6	—	23,470
18期(2019年5月10日)	13,719	1.8	402.339	1.8	99.6	—	28,594
19期(2020年5月11日)	13,716	△0.0	402.294	△0.0	99.2	—	31,736
20期(2021年5月10日)	13,642	△0.5	400.066	△0.6	99.1	—	28,487
21期(2022年5月10日)	13,336	△2.2	391.185	△2.2	99.8	—	19,538

*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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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	債先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2021年5月10日	円	%		%	%	%
5月末	13,637	△0.0	399.926	△0.0	99.0	—
6月末	13,643	0.0	400.183	0.0	99.3	—
7月末	13,717	0.5	402.301	0.6	98.9	—
8月末	13,705	0.5	401.892	0.5	99.2	—
9月末	13,653	0.1	400.389	0.1	99.2	—
10月末	13,636	△0.0	399.941	△0.0	99.0	—
11月末	13,669	0.2	400.931	0.2	99.0	—
12月末	13,637	△0.0	400.021	△0.0	99.0	—
2022年1月末	13,535	△0.8	396.940	△0.8	98.7	—
2月末	13,462	△1.3	394.787	△1.3	98.9	—
3月末	13,424	△1.6	393.640	△1.6	99.1	—
4月末	13,385	△1.9	392.589	△1.9	99.1	—
(期末) 2022年5月10日	13,336	△2.2	391.185	△2.2	99.8	—

*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

国内債券利回りが上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

日銀による金融緩和政策は継続されたものの、世界的なインフレ懸念などを背景に外国債券利回りは上昇（価格は下落）したことなどを受けて、国内債券利回りは上昇しました。

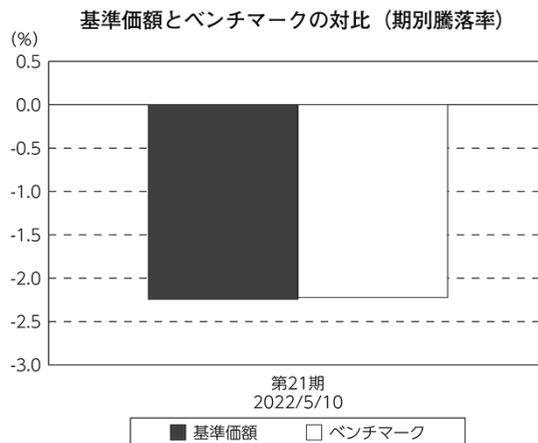
○当ファンドのポートフォリオ

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ない、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日本国債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）を行ないました。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-2.2%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の-2.2%と同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

- ・資金流出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日本国債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なってまいります。

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

(2021年5月11日～2022年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,591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

(2021年5月11日～2022年5月10日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 9,475,418	千円 17,549,139

*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。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 2,733	百万円 2,734	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月11日～2022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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	9,475	—	—	17,549	282	1.6
債券先物取引	2,733	2,733	100.0	2,734	2,734	100.0

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	39千円
うち利害関係人への支払額 (B)	39千円
(B) / (A)	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です。

○組入資産の明細

(2022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BB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	18,275,000 (80,000)	19,490,802 (106,738)	99.8 (0.5)	— (—)	65.8 (0.5)	24.5 (—)	9.5 (—)	
合 計	18,275,000 (80,000)	19,490,802 (106,738)	99.8 (0.5)	— (—)	65.8 (0.5)	24.5 (—)	9.5 (—)	

* () 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	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(2年)第434回	0.005	100,000	100,117	2024/3/1
国庫債券	利付(5年)第137回	0.1	300,000	300,693	2023/9/20
国庫債券	利付(5年)第139回	0.1	420,000	421,209	2024/3/20
国庫債券	利付(5年)第140回	0.1	370,000	371,132	2024/6/20
国庫債券	利付(5年)第141回	0.1	340,000	341,122	2024/9/20
国庫債券	利付(5年)第142回	0.1	150,000	150,547	2024/12/20
国庫債券	利付(5年)第145回	0.1	270,000	271,179	2025/9/20
国庫債券	利付(5年)第146回	0.1	250,000	251,127	2025/12/20
国庫債券	利付(5年)第147回	0.005	250,000	250,192	2026/3/20
国庫債券	利付(5年)第148回	0.005	160,000	160,097	2026/6/20
国庫債券	利付(5年)第149回	0.005	250,000	250,052	2026/9/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	80,000	106,738	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	110,000	142,004	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	70,000	90,672	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	110,000	142,758	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	110,000	137,504	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	80,000	98,369	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	70,000	82,637	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	60,000	66,016	2055/3/20
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	40,000	32,689	2056/3/20
国庫債券	利付(40年)第10回	0.9	70,000	66,978	2057/3/20
国庫債券	利付(40年)第11回	0.8	30,000	27,756	2058/3/20
国庫債券	利付(40年)第12回	0.5	40,000	33,269	2059/3/20
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	80,000	66,197	2060/3/20
国庫債券	利付(40年)第14回	0.7	100,000	88,389	2061/3/20
国庫債券	利付(10年)第330回	0.8	70,000	70,829	2023/9/20
国庫債券	利付(10年)第331回	0.6	90,000	90,821	2023/9/20
国庫債券	利付(10年)第332回	0.6	350,000	353,752	2023/12/20
国庫債券	利付(10年)第333回	0.6	250,000	253,042	2024/3/20
国庫債券	利付(10年)第334回	0.6	220,000	222,994	2024/6/20
国庫債券	利付(10年)第335回	0.5	200,000	202,552	2024/9/20
国庫債券	利付(10年)第336回	0.5	120,000	121,693	2024/12/20
国庫債券	利付(10年)第337回	0.3	100,000	100,888	2024/12/20
国庫債券	利付(10年)第338回	0.4	80,000	81,006	2025/3/20
国庫債券	利付(10年)第339回	0.4	100,000	101,354	2025/6/20
国庫債券	利付(10年)第341回	0.3	200,000	202,348	2025/12/20
国庫債券	利付(10年)第342回	0.1	230,000	231,018	2026/3/20
国庫債券	利付(10年)第343回	0.1	200,000	200,904	2026/6/20
国庫債券	利付(10年)第344回	0.1	300,000	301,308	2026/9/20
国庫債券	利付(10年)第345回	0.1	240,000	241,048	2026/12/20
国庫債券	利付(10年)第346回	0.1	270,000	271,112	2027/3/20
国庫債券	利付(10年)第347回	0.1	200,000	200,662	2027/6/20
国庫債券	利付(10年)第348回	0.1	150,000	150,400	2027/9/20
国庫債券	利付(10年)第349回	0.1	100,000	100,195	2027/12/20
国庫債券	利付(10年)第350回	0.1	320,000	320,371	2028/3/20
国庫債券	利付(10年)第351回	0.1	180,000	180,000	2028/6/20

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 (10年) 第352回	0.1	150,000	149,857	2028/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第355回	0.1	100,000	99,543	2029/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第356回	0.1	60,000	59,629	2029/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第357回	0.1	130,000	129,025	2029/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第358回	0.1	100,000	99,149	2030/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第359回	0.1	170,000	168,373	2030/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第360回	0.1	130,000	128,612	2030/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第361回	0.1	150,000	148,290	2030/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第362回	0.1	80,000	79,028	2031/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第363回	0.1	70,000	69,094	2031/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第364回	0.1	20,000	19,734	2031/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	119,121	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	40,000	46,634	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	40,000	48,116	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	15,000	18,015	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	20,000	23,098	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	20,000	22,262	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	30,000	32,472	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	10,000	11,480	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	10,000	11,938	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	10,000	11,847	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	30,000	37,001	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	70,000	87,381	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	10,000	12,517	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	80,000	99,387	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	30,000	36,992	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	10,000	12,359	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	60,000	75,837	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	50,000	62,062	2035/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	40,000	50,795	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	40,000	50,912	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	80,000	101,985	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	30,000	37,480	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	80,000	101,231	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	70,000	89,971	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	100,000	128,817	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	110,000	140,441	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	100,000	126,315	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	70,000	87,472	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	150,000	190,209	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	100,000	121,845	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	110,000	138,176	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	80,000	97,899	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	70,000	85,715	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	110,000	132,814	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	80,000	95,149	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	80,000	96,677	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	70,000	83,302	2043/9/20

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 (30年) 第41回	1.7	90,000	105,409	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	70,000	82,025	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	80,000	93,790	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	40,000	46,917	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	60,000	67,911	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	90,000	101,878	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	90,000	103,738	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	60,000	66,626	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	60,000	66,619	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第54回	0.8	30,000	29,241	2047/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第55回	0.8	30,000	29,205	2047/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第56回	0.8	40,000	38,892	2047/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第57回	0.8	50,000	48,505	2047/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第58回	0.8	60,000	58,071	2048/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第59回	0.7	70,000	65,993	2048/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第60回	0.9	50,000	49,316	2048/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第61回	0.7	60,000	56,275	2048/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第62回	0.5	30,000	26,682	2049/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第63回	0.4	30,000	25,912	2049/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第64回	0.4	30,000	25,827	2049/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第65回	0.4	20,000	17,198	2049/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第67回	0.6	60,000	54,257	2050/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第68回	0.6	60,000	54,158	2050/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第69回	0.7	60,000	55,563	2050/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第70回	0.7	40,000	36,940	2051/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第71回	0.7	60,000	55,379	2051/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第72回	0.7	50,000	46,072	2051/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第73回	0.7	50,000	45,995	2051/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第74回	1.0	30,000	29,794	2052/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	80,000	80,776	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	10,000	10,208	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	10,000	10,268	2023/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	10,000	10,316	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	20,000	20,601	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	10,000	10,363	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	80,000	83,354	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	30,000	31,202	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	10,000	10,474	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	20,000	21,011	2024/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	10,000	10,533	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	10,000	10,559	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	40,000	42,448	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	17,000	17,943	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	15,000	15,875	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	10,000	10,602	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	10,000	10,633	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	10,000	10,664	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	10,000	10,683	2025/9/20

銘柄	当期			末	償還年月日		
	利	率	額	面金額		評	価
国債証券		%	千円	千円			
国庫債券 利付 (20年) 第82回		2.1	15,000	16,075			2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回		2.1	15,000	16,152			2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回		2.0	50,000	53,659			2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回		2.1	13,000	14,061			2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第86回		2.3	10,000	10,893			2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第88回		2.3	20,000	21,899			2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回		2.2	20,000	21,919			2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回		2.3	10,000	11,003			2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回		2.1	30,000	32,897			2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回		2.0	70,000	76,744			2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回		2.1	20,000	22,024			2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回		2.3	10,000	11,155			2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回		2.1	15,000	16,579			2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回		2.2	50,000	55,748			2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回		2.1	30,000	33,412			2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回		2.2	20,000	22,478			2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回		2.4	20,000	22,711			2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回		2.4	70,000	79,800			2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回		2.3	25,000	28,348			2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回		2.1	10,000	11,217			2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回		2.1	70,000	78,799			2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回		2.1	70,000	79,064			2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回		1.9	80,000	89,310			2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回		1.9	60,000	67,195			2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回		2.1	80,000	90,680			2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回		2.2	10,000	11,438			2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回		2.1	85,000	96,625			2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回		2.1	160,000	182,384			2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回		2.1	40,000	45,731			2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回		2.2	50,000	57,539			2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回		2.2	70,000	80,861			2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回		2.1	60,000	68,845			2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回		2.0	40,000	45,727			2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回		1.8	50,000	56,361			2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回		1.6	110,000	122,239			2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回		1.9	70,000	79,688			2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回		1.8	40,000	45,207			2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回		2.1	100,000	115,887			2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回		2.0	50,000	57,521			2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回		2.2	40,000	46,860			2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回		1.9	120,000	137,880			2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回		1.8	50,000	57,004			2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回		1.8	50,000	57,193			2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回		1.7	10,000	11,376			2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回		1.8	40,000	46,008			2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回		1.7	10,000	11,405			2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回		1.7	40,000	45,673			2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回		1.6	30,000	33,959			2032/6/20

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140回	1.7	70,000	80,008	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	100,000	114,455	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	100,000	115,484	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	90,000	102,195	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	80,000	89,999	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	150,000	172,206	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	140,000	160,916	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	150,000	170,919	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	150,000	169,348	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	100,000	113,031	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	130,000	145,484	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	100,000	109,538	2034/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第152回	1.2	150,000	164,371	2035/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	120,000	133,038	2035/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第154回	1.2	110,000	120,549	2035/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	110,000	117,683	2035/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	10,000	9,889	2036/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第158回	0.5	10,000	9,986	2036/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第159回	0.6	20,000	20,217	2036/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第160回	0.7	10,000	10,234	2037/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第161回	0.6	30,000	30,230	2037/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第162回	0.6	40,000	40,226	2037/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第163回	0.6	50,000	50,179	2037/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第164回	0.5	60,000	59,173	2038/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第165回	0.5	50,000	49,193	2038/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第166回	0.7	60,000	60,757	2038/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第167回	0.5	40,000	39,158	2038/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第168回	0.4	70,000	67,238	2039/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第170回	0.3	50,000	46,940	2039/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第171回	0.3	60,000	56,148	2039/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第172回	0.4	70,000	66,507	2040/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第173回	0.4	50,000	47,360	2040/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第174回	0.4	30,000	28,328	2040/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第175回	0.5	80,000	76,733	2040/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第176回	0.5	90,000	86,139	2041/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第177回	0.4	50,000	46,879	2041/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第178回	0.5	60,000	57,222	2041/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第179回	0.5	20,000	19,031	2041/12/20
合 計		18,275,000	19,490,802	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 19,490,802	% 98.7
コール・ローン等、その他	254,755	1.3
投資信託財産総額	19,745,557	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 (2022年5月10日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	19,745,557,799
コール・ローン等	161,484,035
公社債(評価額)	19,490,802,370
未収入金	50,485,500
未収利息	40,275,594
前払費用	2,510,300
(B) 負債	206,749,438
未払金	160,989,200
未払解約金	45,760,177
未払利息	61
(C) 純資産総額(A-B)	19,538,808,361
元本	14,651,064,577
次期繰越損益金	4,887,743,784
(D) 受益権総口数	14,651,064,577口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,336円

(注) 期首元本額は20,882,177,477円、期中追加設定元本額は5,648,045,236円、期中一部解約元本額は11,879,158,136円、1口当たり純資産額は1.3336円です。

○損益の状況 (2021年5月11日～2022年5月10日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	192,360,272
受取利息	192,435,706
支払利息	△ 75,434
(B) 有価証券売買損益	△ 675,641,590
売買益	22,082,450
売買損	△ 697,724,040
(C) 先物取引等取引損益	860,400
取引益	860,400
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 482,420,918
(E) 前期繰越損益金	7,605,692,609
(F) 追加信託差損益金	2,055,297,902
(G) 解約差損益金	△4,290,825,809
(H) 計(D+E+F+G)	4,887,743,784
次期繰越損益金(H)	4,887,743,784

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引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。

○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DC運用戦略ファンド	5,551,339,084
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	5,023,791,633
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)	905,448,424
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	736,001,526
バランスセレクト50	627,011,387
バランスセレクト30	569,708,169
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)	471,591,932
バランスセレクト70	307,023,879
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	177,602,830
ネクストコア	177,219,328
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	56,337,066
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	24,878,485
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	23,110,834

○お知らせ

該当事項はございません。