

# 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18期(決算日2019年5月10日)

作成対象期間(2018年5月11日～2019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 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
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
16期(2017年5月10日)	12,628		5	△2.7	392.235	△2.3	99.5	5,735
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

\*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	%	%	%	%	%
2018年5月10日	12,678	—	395.239	—	99.6	—
5月末	12,695	0.1	395.854	0.2	99.5	—
6月末	12,697	0.1	396.028	0.2	99.6	—
7月末	12,669	△0.1	395.242	0.0	99.4	—
8月末	12,591	△0.7	392.894	△0.6	99.4	—
9月末	12,553	△1.0	391.840	△0.9	99.3	—
10月末	12,572	△0.8	392.522	△0.7	99.3	—
11月末	12,625	△0.4	394.286	△0.2	99.6	—
12月末	12,724	0.4	397.555	0.6	99.7	—
2019年1月末	12,777	0.8	399.237	1.0	99.4	—
2月末	12,803	1.0	400.185	1.3	99.5	—
3月末	12,897	1.7	403.267	2.0	99.6	—
4月末	12,848	1.3	401.911	1.7	99.4	—
(期末)						
2019年5月10日	12,859	1.4	402.339	1.8	99.6	—

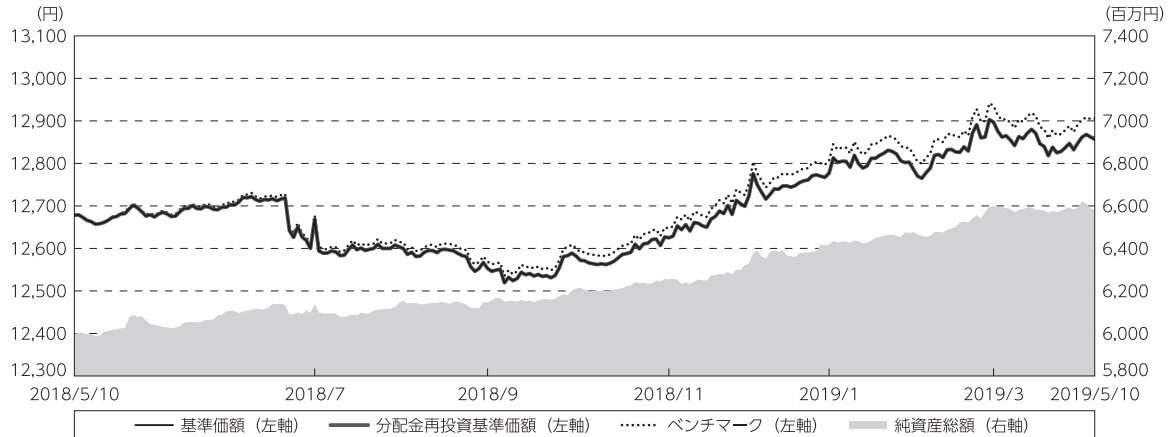
\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\*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：12,678円

期末：12,854円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 1.4%（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（2018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（2018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

基準価額は、期首12,678円から期末12,859円（分配金込み）に181円の値上がりとなりました。

国内株式市場の下落に伴い安全資産としての国債需要が増加したことや外国債券の利回りが低下（価格は上昇）したことなどを背景に、国内債券利回りが低下したため、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

2018年7月末に開催された日銀の金融政策決定会合で、金融緩和の長期化が確認されたものの、長期金利の誘導目標（0%程度）に対する変動幅拡大が容認されたことなどを受けて、国内債券利回りは上昇（価格は下落）する局面もありました。しかし、FOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ打ち止め観測やECB（欧州中央銀行）理事会で2019年内の利上げ見送りの方針が示されたことを受けて主要国の債券利回りが低下（価格は上昇）したこと、国内株式市場の下落を受けて安全資産としての国債需要が高まったことなどを背景に、国内債券利回りは低下しました。

当運用期間では、国内債券利回りは低下しました。

## ○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。

## ○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+1.4%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の+1.8%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)

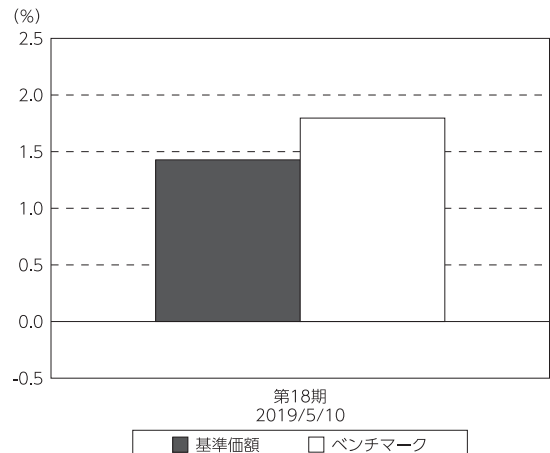
費用として信託報酬が生じること

### (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います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項 目	第18期
	2018年5月11日～ 2019年5月10日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.039%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,111

(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

(2018年5月11日～2019年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 41	% 0.324	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(10)	(0.076)	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)	(0.216)	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	41	0.326	
期中の平均基準価額は、12,704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

(2018年5月11日～2019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 668,200	千円 903,893	千口 320,251	千円 433,157

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年5月11日～2019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。

## &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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
公社債	百万円 20,840	百万円 3,213	% 15.4	百万円 16,076	百万円 1,273	% 7.9

平均保有割合 21.8%

※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です。

## ○組入資産の明細

(2019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 4,449,027	千口 4,796,976	千円 6,580,971

\*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

(2019年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券マザーファンド	千円 6,580,971	% 98.7
コール・ローン等、その他	85,718	1.3
投資信託財産総額	6,666,689	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（2019年5月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,666,689,432
コール・ローン等	46,781,966
国内債券マザーファンド(評価額)	6,580,971,480
未収入金	38,935,986
(B) 負債	85,059,833
未払収益分配金	2,560,135
未払解約金	72,224,958
未払信託報酬	10,206,693
未払利息	58
その他未払費用	67,989
(C) 純資産総額(A-B)	6,581,629,599
元本	5,120,271,782
次期繰越損益金	1,461,357,817
(D) 受益権総口数	5,120,271,782口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,854円

(注) 期首元本額は4,731,566,257円、期中追加設定元本額は1,051,718,755円、期中一部解約元本額は663,013,230円、1口当たり純資産額は1.2854円です。

## ○損益の状況（2018年5月11日～2019年5月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,626
支払利息	△ 6,626
(B) 有価証券売買損益	110,540,221
売買益	126,726,177
売買損	△ 16,185,956
(C) 信託報酬等	△ 20,428,365
(D) 当期損益金(A+B+C)	90,105,230
(E) 前期繰越損益金	317,579,452
(F) 追加信託差損益金	1,056,233,270
(配当等相当額)	( 1,101,150,796)
(売買損益相当額)	(△ 44,917,526)
(G) 計(D+E+F)	1,463,917,952
(H) 収益分配金	△ 2,560,135
次期繰越損益金(G+H)	1,461,357,817
追加信託差損益金	1,056,233,270
(配当等相当額)	( 1,101,975,646)
(売買損益相当額)	(△ 45,742,376)
分配準備積立金	491,115,220
繰越損益金	△ 85,990,673

\*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（2018年5月11日～2019年5月10日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年5月11日～ 2019年5月10日
a. 配当等収益(経費控除後)	38,888,208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	1,101,975,646円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	454,787,147円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,595,651,001円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,116円
g. 分配金	2,560,135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

---

信託報酬率について、上限率を定めた信託報酬率（年0.432%（税抜年0.40%）以内）を固定化した率（年0.324%（税抜年0.30%））に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2018年7月25日>

# 国内債券マザーファンド

## 運用報告書

第18期（決算日2019年5月10日）

作成対象期間（2018年5月11日～2019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			
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
16期(2017年5月10日)	13,380	△2.3	392.235	△2.3	99.5	—	16,780
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

\*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	債券先物比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2018年5月10日	13,482	—	395.239	—	99.6	—
5月末	13,502	0.1	395.854	0.2	99.5	—
6月末	13,508	0.2	396.028	0.2	99.6	—
7月末	13,482	0.0	395.242	0.0	99.5	—
8月末	13,403	△0.6	392.894	△0.6	99.4	—
9月末	13,366	△0.9	391.840	△0.9	99.3	—
10月末	13,390	△0.7	392.522	△0.7	99.3	—
11月末	13,450	△0.2	394.286	△0.2	99.6	—
12月末	13,559	0.6	397.555	0.6	99.7	—
2019年1月末	13,619	1.0	399.237	1.0	99.4	—
2月末	13,650	1.2	400.185	1.3	99.5	—
3月末	13,754	2.0	403.267	2.0	99.7	—
4月末	13,705	1.7	401.911	1.7	99.4	—
(期末) 2019年5月10日	13,719	1.8	402.339	1.8	99.6	—

\*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13,482円から期末13,719円に237円の値上がりとなりました。

国内株式市場の下落に伴い安全資産としての国債需要が増加したことや外国債券の利回りが低下（価格は上昇）したことなどを背景に、国内債券利回りが低下したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

2018年7月末に開催された日銀の金融政策決定会合で、金融緩和の長期化が確認されたものの、長期金利の誘導目標（0%程度）に対する変動幅拡大が容認されたことなどを受けて、国内債券利回りは上昇（価格は下落）する局面もありました。しかし、FOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ打ち止め観測やECB（欧州中央銀行）理事会で2019年内の利上げ見送りの方針が示されたことを受けて主要国の債券利回りが低下（価格は上昇）したこと、国内株式市場の下落を受けて安全資産としての国債需要が高まったことなどを背景に、国内債券利回りは低下しました。

当運用期間では、国内債券利回りは低下しました。

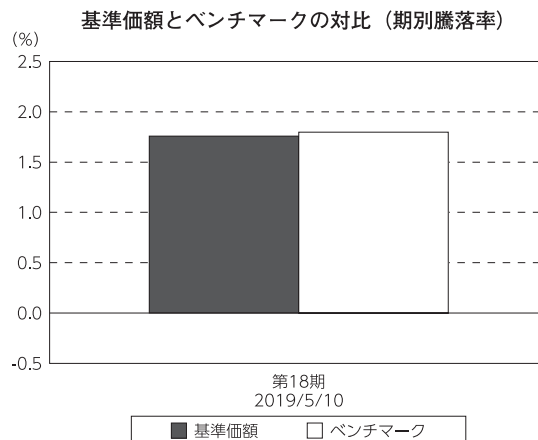
## ○当ファンドのポートフォリオ

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+1.8%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の+1.8%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

(2018年5月11日～2019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

(2018年5月11日～2019年5月10日)

### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	20,840,986	16,076,059

\*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

(2018年5月11日～2019年5月10日)

### 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		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	20,840	3,213	15.4	16,076	1,273	7.9

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

(2019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	25,797,000 ( 30,000)	28,470,639 ( 45,111)	99.6 ( 0.2)	— (—)	66.5 ( 0.2)	23.0 ( —)	10.1 ( —)	
合 計	25,797,000 ( 30,000)	28,470,639 ( 45,111)	99.6 ( 0.2)	— (—)	66.5 ( 0.2)	23.0 ( —)	10.1 ( —)	

\* ( )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390回	0.1	50,000	50,150	2020/7/1
国庫債券	利付(2年)第391回	0.1	100,000	100,323	2020/8/1
国庫債券	利付(2年)第392回	0.1	110,000	110,380	2020/9/1
国庫債券	利付(2年)第393回	0.1	120,000	120,441	2020/10/1
国庫債券	利付(2年)第394回	0.1	170,000	170,651	2020/11/1
国庫債券	利付(2年)第395回	0.1	120,000	120,484	2020/12/1
国庫債券	利付(2年)第396回	0.1	340,000	341,451	2021/1/1
国庫債券	利付(5年)第124回	0.1	250,000	250,732	2020/6/20
国庫債券	利付(5年)第125回	0.1	380,000	381,368	2020/9/20
国庫債券	利付(5年)第126回	0.1	500,000	502,130	2020/12/20
国庫債券	利付(5年)第127回	0.1	150,000	150,738	2021/3/20
国庫債券	利付(5年)第128回	0.1	580,000	583,242	2021/6/20
国庫債券	利付(5年)第129回	0.1	270,000	271,690	2021/9/20
国庫債券	利付(5年)第130回	0.1	160,000	161,108	2021/12/20
国庫債券	利付(5年)第131回	0.1	420,000	423,187	2022/3/20
国庫債券	利付(5年)第132回	0.1	320,000	322,643	2022/6/20
国庫債券	利付(5年)第133回	0.1	120,000	121,093	2022/9/20
国庫債券	利付(5年)第134回	0.1	440,000	444,307	2022/12/20
国庫債券	利付(5年)第135回	0.1	290,000	293,033	2023/3/20
国庫債券	利付(5年)第136回	0.1	130,000	131,449	2023/6/20
国庫債券	利付(5年)第137回	0.1	50,000	50,592	2023/9/20
国庫債券	利付(5年)第138回	0.1	130,000	131,628	2023/12/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	30,000	45,111	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	30,000	43,816	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	60,000	88,325	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	75,000	111,409	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	100,000	143,745	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	60,000	84,933	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	100,000	136,222	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	100,000	127,168	2055/3/20
国庫債券	利付(40年)第10回	0.9	120,000	133,366	2057/3/20
国庫債券	利付(40年)第11回	0.8	50,000	53,829	2058/3/20
国庫債券	利付(10年)第308回	1.3	30,000	30,486	2020/6/20
国庫債券	利付(10年)第309回	1.1	130,000	131,818	2020/6/20
国庫債券	利付(10年)第310回	1.0	30,000	30,474	2020/9/20
国庫債券	利付(10年)第311回	0.8	190,000	192,490	2020/9/20
国庫債券	利付(10年)第312回	1.2	70,000	71,537	2020/12/20
国庫債券	利付(10年)第314回	1.1	30,000	30,702	2021/3/20
国庫債券	利付(10年)第315回	1.2	70,000	72,017	2021/6/20
国庫債券	利付(10年)第316回	1.1	130,000	133,471	2021/6/20
国庫債券	利付(10年)第317回	1.1	30,000	30,897	2021/9/20
国庫債券	利付(10年)第318回	1.0	80,000	82,204	2021/9/20
国庫債券	利付(10年)第319回	1.1	70,000	72,317	2021/12/20
国庫債券	利付(10年)第320回	1.0	90,000	92,743	2021/12/20
国庫債券	利付(10年)第321回	1.0	150,000	155,007	2022/3/20
国庫債券	利付(10年)第322回	0.9	130,000	133,966	2022/3/20

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 (10年) 第323回	0.9	70,000	72,325	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第324回	0.8	150,000	154,515	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第325回	0.8	330,000	340,744	2022/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第326回	0.7	240,000	247,528	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第327回	0.8	230,000	238,050	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第328回	0.6	230,000	236,865	2023/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第329回	0.8	350,000	364,028	2023/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第330回	0.8	220,000	229,365	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第331回	0.6	150,000	155,068	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第332回	0.6	350,000	362,509	2023/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第333回	0.6	200,000	207,534	2024/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第334回	0.6	220,000	228,720	2024/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第335回	0.5	370,000	383,397	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	230,000	238,719	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	220,000	225,849	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第338回	0.4	470,000	485,688	2025/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	440,000	455,325	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	335,000	347,157	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	400,000	412,420	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	430,000	437,894	2026/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	350,000	356,538	2026/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	350,000	356,506	2026/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	260,000	264,898	2026/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第346回	0.1	330,000	336,286	2027/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第347回	0.1	260,000	264,895	2027/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第348回	0.1	150,000	152,784	2027/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第349回	0.1	240,000	244,377	2027/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第350回	0.1	160,000	162,857	2028/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第352回	0.1	220,000	223,625	2028/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第353回	0.1	140,000	142,231	2028/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	40,000	50,165	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	10,000	12,591	2031/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	10,000	12,916	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	15,000	19,303	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	20,000	24,554	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	20,000	23,489	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	30,000	34,029	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	10,000	12,191	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	10,000	12,785	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	10,000	12,671	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	30,000	39,835	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	70,000	94,295	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	10,000	13,507	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	20,000	26,780	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	120,000	159,208	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	10,000	13,297	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	10,000	13,653	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	60,000	80,121	2035/12/20



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 (30年) 第22回		2.5	50,000	68,580	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回		2.5	40,000	54,987	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回		2.5	80,000	110,216	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回		2.3	50,000	67,284	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回		2.4	80,000	109,300	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回		2.5	100,000	139,001	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回		2.5	30,000	41,888	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回		2.4	120,000	165,948	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回		2.3	80,000	109,567	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回		2.2	60,000	81,401	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回		2.3	110,000	152,127	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回		2.0	130,000	172,621	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回		2.2	110,000	151,155	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回		2.0	122,000	163,228	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回		2.0	130,000	174,647	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回		1.9	130,000	172,389	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回		1.8	90,000	117,692	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回		1.9	80,000	106,615	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回		1.8	120,000	157,460	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回		1.7	100,000	129,120	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回		1.7	60,000	77,544	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回		1.7	90,000	116,425	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回		1.7	110,000	142,591	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回		1.5	90,000	112,471	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回		1.5	100,000	125,039	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回		1.6	110,000	140,369	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回		1.4	110,000	135,098	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回		1.4	120,000	147,436	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回		0.8	110,000	118,654	2046/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第51回		0.3	80,000	76,180	2046/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第54回		0.8	160,000	172,577	2047/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第55回		0.8	80,000	86,232	2047/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第56回		0.8	80,000	86,174	2047/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第57回		0.8	110,000	118,406	2047/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第58回		0.8	110,000	118,320	2048/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第59回		0.7	90,000	94,333	2048/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第61回		0.7	100,000	104,752	2048/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第46回		2.2	5,000	5,131	2020/6/22
国庫債券 利付 (20年) 第47回		2.2	15,000	15,483	2020/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第48回		2.5	30,000	31,286	2020/12/21
国庫債券 利付 (20年) 第49回		2.1	40,000	41,684	2021/3/22
国庫債券 利付 (20年) 第52回		2.1	25,000	26,340	2021/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第53回		2.1	10,000	10,592	2021/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第54回		2.2	10,000	10,618	2021/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第55回		2.0	10,000	10,620	2022/3/21
国庫債券 利付 (20年) 第56回		2.0	10,000	10,675	2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第57回		1.9	10,000	10,644	2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第58回		1.9	10,000	10,696	2022/9/20

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 (20年) 第59回	1.7	30,000	32,029	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	10,000	10,567	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	10,000	10,453	2023/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	10,000	10,400	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	10,000	10,811	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	10,000	10,906	2023/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	10,000	10,958	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	20,000	21,823	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	10,000	11,010	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	10,000	11,156	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	30,000	33,323	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	40,000	45,281	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	10,000	11,217	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	20,000	22,447	2024/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	10,000	11,224	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	10,000	11,281	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	40,000	45,340	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	17,000	19,068	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	15,000	16,913	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	10,000	11,269	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	10,000	11,331	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	10,000	11,393	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	10,000	11,387	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	15,000	17,176	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	15,000	17,263	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	50,000	57,210	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	13,000	15,030	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	10,000	11,700	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	20,000	23,518	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	20,000	23,478	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	10,000	11,813	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	30,000	35,152	2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	20,000	23,379	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	20,000	23,538	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	10,000	11,980	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	15,000	17,725	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	50,000	59,740	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	30,000	35,728	2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	20,000	24,086	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	20,000	24,443	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	20,000	24,548	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	25,000	30,456	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	10,000	11,999	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	70,000	84,305	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	100,000	121,378	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	20,000	24,173	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	80,000	95,148	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	30,000	35,791	2029/3/20

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110回	2.1	90,000	109,157	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	10,000	12,272	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	85,000	103,453	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	160,000	195,403	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	130,000	159,290	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	50,000	61,797	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	110,000	136,409	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	60,000	73,753	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	40,000	48,883	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	50,000	59,993	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	110,000	129,542	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	100,000	121,438	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	130,000	156,395	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	100,000	124,083	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	100,000	122,925	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	100,000	125,627	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	30,000	36,979	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	120,000	146,500	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	100,000	122,405	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	50,000	60,600	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	90,000	109,341	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	35,000	42,091	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	60,000	72,310	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	120,000	146,121	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	70,000	85,424	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	60,000	72,457	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	30,000	35,846	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	40,000	48,403	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	50,000	59,207	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	60,000	71,826	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	140,000	169,747	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	140,000	170,066	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	100,000	122,818	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	130,000	156,427	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	80,000	95,172	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	140,000	170,678	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	140,000	170,976	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	150,000	181,344	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	120,000	143,535	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	90,000	107,784	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	130,000	153,929	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	170,000	196,319	2034/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	120,000	140,593	2035/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	160,000	179,848	2035/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	30,000	30,752	2036/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第157回	0.2	180,000	178,230	2036/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第158回	0.5	60,000	62,339	2036/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第159回	0.6	100,000	105,457	2036/12/20

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160回	0.7	70,000	74,998
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	110,000	115,765
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	140,000	147,177
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	190,000	199,515
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	130,000	134,040
国庫債券	利付 (20年) 第166回	0.7	40,000	42,614
国庫債券	利付 (20年) 第167回	0.5	60,000	61,594
合	計		25,797,000	28,470,639

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 28,470,639	% 99.4
コール・ローン等、その他	165,226	0.6
投資信託財産総額	28,635,865	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 (2019年5月10日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	28,635,865,047
コール・ローン等	107,354,847
公社債(評価額)	28,470,639,970
未收利息	56,077,543
前払費用	1,792,687
(B) 負債	41,861,606
未払解約金	41,861,471
未払利息	135
(C) 純資産総額(A-B)	28,594,003,441
元本	20,842,266,404
次期繰越損益金	7,751,737,037
(D) 受益権総口数	20,842,266,404口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,719円

(注) 期首元本額は17,409,321,655円、期中追加設定元本額は14,559,558,385円、期中一部解約元本額は11,126,613,636円、1口当たり純資産額は1.3719円です。

## ○損益の状況 (2018年5月11日～2019年5月10日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	221,522,530
受取利息	221,771,835
支払利息	△ 249,305
(B) 有価証券売買損益	330,074,800
売買益	402,452,590
売買損	△ 72,377,790
(C) 当期損益金(A+B)	551,597,330
(D) 前期繰越損益金	6,061,562,617
(E) 追加信託差損益金	5,133,009,626
(F) 解約差損益金	△3,994,432,536
(G) 計(C+D+E+F)	7,751,737,037
次期繰越損益金(G)	7,751,737,037

\*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)	9,913,324,358
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	4,796,976,077
野村DC運用戦略ファンド	3,656,232,617
バランスセレクト50	601,712,847
バランスセレクト30	530,702,791
ネクストコア	463,217,250
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	393,617,859
バランスセレクト70	251,167,349
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	136,615,504
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	51,004,635
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	25,423,289
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	22,271,828

## ○お知らせ

該当事項はございません。