

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20期(決算日2021年5月10日)

作成対象期間(2020年5月12日～2021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等に関し、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	期 騰 落	中 率			
	円		円		%	%	%	百万円
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
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

*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) 2020年5月11日	円	%		%	%	%
	12,804	—	402.294	—	99.2	—
5月末	12,794	△0.1	402.082	△0.1	99.1	—
6月末	12,734	△0.5	400.225	△0.5	99.3	—
7月末	12,776	△0.2	401.696	△0.1	99.2	—
8月末	12,708	△0.7	399.644	△0.7	98.9	—
9月末	12,743	△0.5	400.853	△0.4	99.2	—
10月末	12,717	△0.7	400.170	△0.5	99.0	—
11月末	12,730	△0.6	400.681	△0.4	99.0	—
12月末	12,727	△0.6	400.723	△0.4	98.9	—
2021年1月末	12,689	△0.9	399.636	△0.7	98.9	—
2月末	12,572	△1.8	396.075	△1.5	98.8	—
3月末	12,663	△1.1	399.005	△0.8	99.2	—
4月末	12,684	△0.9	399.764	△0.6	99.2	—
(期末) 2021年5月10日	12,693	△0.9	400.066	△0.6	99.1	—

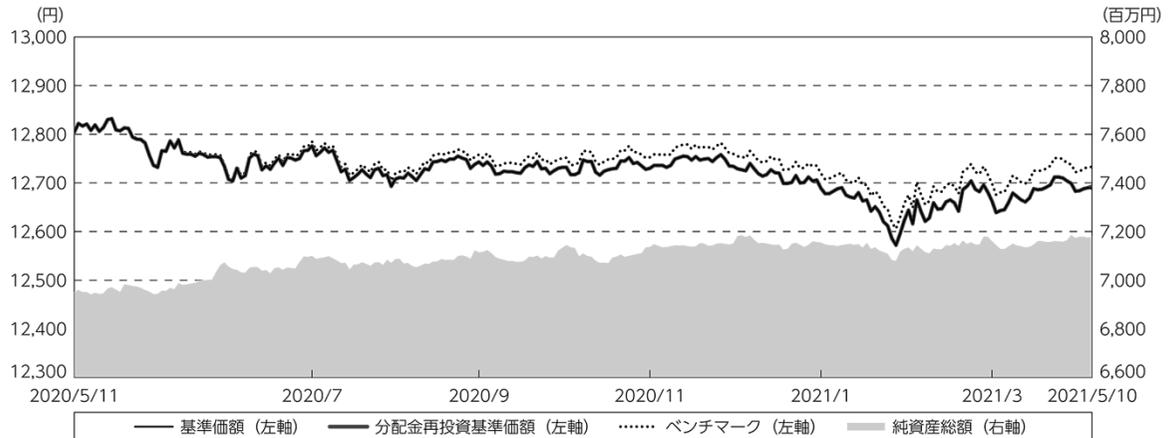
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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：12,804円

期 末：12,688円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：△ 0.9% (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(2020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(2020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

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

国内債券は、新型コロナウイルスの感染拡大により停滞した経済活動を再開する動きが各国で出た後、新型コロナウイルスのワクチン開発に関する前向きな報道などから経済正常化期待が高まったこと、米国における景況感や雇用市場の回復を受けて投資家のリスク選好が高まったことなどを背景に、安全資産としての需要が減退し、国内債券利回りは上昇(価格は下落)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-0.9%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の-0.6%を0.3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）

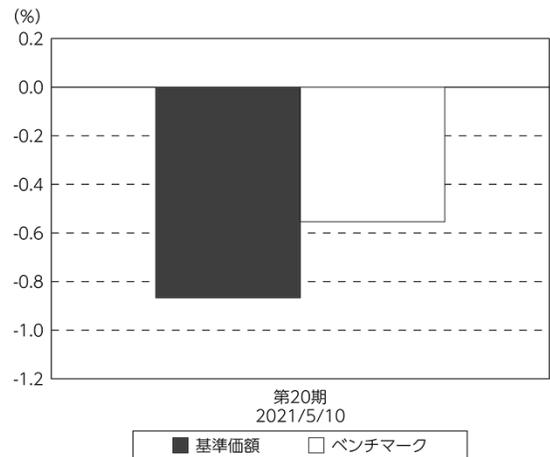
費用として信託報酬が生じること

（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、1万口当たり・税込み)

項 目	第20期
	2020年5月12日～ 2021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	3,214

(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ってまいります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021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	% 0.329	(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)	(0.219)	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	0.331	
期中の平均基準価額は、12,711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。

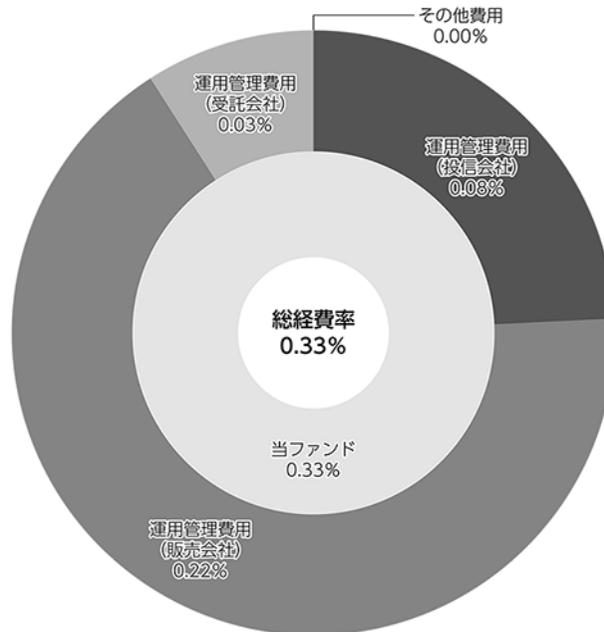
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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

(2020年5月12日～2021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 640,506	千円 874,512	千口 444,792	千円 606,772

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2021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			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	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 10,134	百万円 40	0.4	百万円 12,962	百万円 -	-
債券先物取引	5,153	5,153	100.0	5,154	5,154	100.0

平均保有割合 24.0%

※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)	18千円
うち利害関係人への支払額 (B)	18千円
(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

(2021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 5,067,330	千口 5,263,043	千円 7,179,844

*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

(2021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 7,179,844	% 99.5
コール・ローン等、その他	33,037	0.5
投資信託財産総額	7,212,881	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（2021年5月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,212,881,304
コール・ローン等	22,089,416
国内債券マザーファンド(評価額)	7,179,844,548
未収入金	10,947,340
(B) 負債	32,319,903
未払収益分配金	2,829,746
未払解約金	17,725,874
未払信託報酬	11,686,422
未払利息	11
その他未払費用	77,850
(C) 純資産総額(A-B)	7,180,561,401
元本	5,659,493,653
次期繰越損益金	1,521,067,748
(D) 受益権総口数	5,659,493,653口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,688円

(注) 期首元本額は5,428,883,493円、期中追加設定元本額は1,157,880,347円、期中一部解約元本額は927,270,187円、1口当たり純資産額は1.2688円です。

○損益の状況（2020年5月12日～2021年5月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,509
支払利息	△ 3,509
(B) 有価証券売買損益	△ 30,450,485
売買益	4,027,656
売買損	△ 34,478,141
(C) 信託報酬等	△ 23,507,347
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 53,961,341
(E) 前期繰越損益金	250,883,319
(F) 追加信託差損益金	1,326,975,516
(配当等相当額)	(1,422,750,047)
(売買損益相当額)	(△ 95,774,531)
(G) 計(D+E+F)	1,523,897,494
(H) 収益分配金	△ 2,829,746
次期繰越損益金(G+H)	1,521,067,748
追加信託差損益金	1,326,975,516
(配当等相当額)	(1,423,717,282)
(売買損益相当額)	(△ 96,741,766)
分配準備積立金	395,593,903
繰越損益金	△ 201,501,671

*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（2020年5月12日～2021年5月10日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年5月12日～ 2021年5月10日
a. 配当等収益(経費控除後)	32,089,226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	1,423,717,282円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	366,334,423円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,822,140,931円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,219円
g. 分配金	2,829,746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20期（決算日2021年5月10日）

作成対象期間（2020年5月12日～2021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
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
16期(2017年5月10日)	13,380	△2.3	392.235	△2.3	99.5	—	百万円 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
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

*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
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2020年5月11日	13,716	—	402.294	—	99.2	—
5月末	13,708	△0.1	402.082	△0.1	99.1	—
6月末	13,647	△0.5	400.225	△0.5	99.3	—
7月末	13,696	△0.1	401.696	△0.1	99.2	—
8月末	13,627	△0.6	399.644	△0.7	99.0	—
9月末	13,668	△0.3	400.853	△0.4	99.2	—
10月末	13,644	△0.5	400.170	△0.5	99.0	—
11月末	13,662	△0.4	400.681	△0.4	99.0	—
12月末	13,663	△0.4	400.723	△0.4	98.9	—
2021年1月末	13,626	△0.7	399.636	△0.7	98.9	—
2月末	13,503	△1.6	396.075	△1.5	98.8	—
3月末	13,605	△0.8	399.005	△0.8	99.2	—
4月末	13,631	△0.6	399.764	△0.6	99.2	—
(期末) 2021年5月10日	13,642	△0.5	400.066	△0.6	99.1	—

*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

国内債券は、新型コロナウイルスの感染拡大により停滞した経済活動を再開する動きが各国で出た後、新型コロナウイルスのワクチン開発に関する前向きな報道などから経済正常化期待が高まったこと、米国における景況感や雇用市場の回復を受けて投資家のリスク選好が高まったことなどを背景に、安全資産としての需要が減退し、国内債券利回りは上昇（価格は下落）しました。

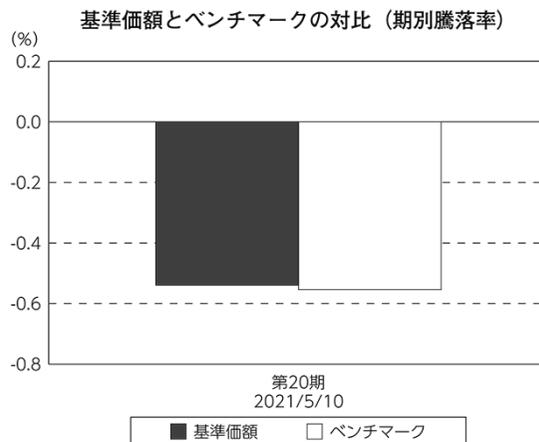
○当ファンドのポートフォリオ

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-0.5%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の-0.6%を0.1ポイント上回りました。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

(2020年5月12日～2021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、13,640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

(2020年5月12日～2021年5月10日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国内	国債証券	千円 10,134,125	千円 12,962,727

*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 5,153	百万円 5,154	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

(2020年5月12日～2021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	10,134	40	0.4	12,962	—	—
債券先物取引	5,153	5,153	100.0	5,154	5,154	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)	74千円
うち利害関係人への支払額 (B)	74千円
(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

(2021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	26,247,000 (30,000)	28,240,164 (43,496)	99.1 (0.2)	— (—)	65.0 (0.2)	23.6 (—)	10.5 (—)	
合 計	26,247,000 (30,000)	28,240,164 (43,496)	99.1 (0.2)	— (—)	65.0 (0.2)	23.6 (—)	10.5 (—)	

* ()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
		%	千円	千円
国債証券				
国庫債券	利付(2年)第414回	0.1	200,000	200,546
国庫債券	利付(2年)第417回	0.1	300,000	301,002
国庫債券	利付(2年)第419回	0.1	100,000	100,374
国庫債券	利付(2年)第420回	0.1	140,000	140,541
国庫債券	利付(2年)第421回	0.1	50,000	50,203
国庫債券	利付(5年)第133回	0.1	380,000	381,162
国庫債券	利付(5年)第134回	0.1	470,000	471,743
国庫債券	利付(5年)第135回	0.1	150,000	150,655
国庫債券	利付(5年)第136回	0.1	200,000	200,994
国庫債券	利付(5年)第137回	0.1	150,000	150,852
国庫債券	利付(5年)第138回	0.1	100,000	100,642
国庫債券	利付(5年)第139回	0.1	600,000	604,218
国庫債券	利付(5年)第141回	0.1	140,000	141,110
国庫債券	利付(5年)第142回	0.1	270,000	272,251
国庫債券	利付(5年)第143回	0.1	350,000	353,118
国庫債券	利付(5年)第144回	0.1	200,000	201,900
国庫債券	利付(5年)第145回	0.1	410,000	414,042
国庫債券	利付(5年)第146回	0.1	250,000	252,432
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	30,000	43,496
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	30,000	42,212
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	60,000	84,867
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	75,000	106,599
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	60,000	82,515
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	90,000	121,943
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	40,000	52,219
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	70,000	85,517
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	110,000	100,894
国庫債券	利付(40年)第10回	0.9	70,000	75,198
国庫債券	利付(40年)第11回	0.8	80,000	83,444
国庫債券	利付(40年)第12回	0.5	130,000	122,584
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	80,000	75,342
国庫債券	利付(10年)第324回	0.8	100,000	101,027
国庫債券	利付(10年)第325回	0.8	330,000	334,161
国庫債券	利付(10年)第326回	0.7	240,000	243,194
国庫債券	利付(10年)第327回	0.8	230,000	233,433
国庫債券	利付(10年)第328回	0.6	230,000	233,125
国庫債券	利付(10年)第329回	0.8	350,000	356,923
国庫債券	利付(10年)第330回	0.8	220,000	224,899
国庫債券	利付(10年)第331回	0.6	90,000	91,577
国庫債券	利付(10年)第332回	0.6	350,000	356,786
国庫債券	利付(10年)第333回	0.6	250,000	255,342
国庫債券	利付(10年)第334回	0.6	340,000	347,857
国庫債券	利付(10年)第335回	0.5	200,000	204,288
国庫債券	利付(10年)第336回	0.5	120,000	122,742
国庫債券	利付(10年)第337回	0.3	100,000	101,560
国庫債券	利付(10年)第338回	0.4	300,000	306,162

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339回	0.4	100,000	102,189	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	330,000	337,596	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	300,000	305,769	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	390,000	393,806	2026/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	250,000	252,437	2026/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	300,000	302,988	2026/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	560,000	565,678	2026/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第346回	0.1	170,000	171,749	2027/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第347回	0.1	170,000	171,773	2027/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第348回	0.1	290,000	293,056	2027/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第349回	0.1	250,000	252,652	2027/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第350回	0.1	470,000	475,010	2028/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第351回	0.1	340,000	343,393	2028/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第352回	0.1	460,000	464,411	2028/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第353回	0.1	150,000	151,371	2028/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第354回	0.1	200,000	201,730	2029/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第355回	0.1	50,000	50,405	2029/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第356回	0.1	60,000	60,450	2029/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第357回	0.1	130,000	130,893	2029/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第358回	0.1	70,000	70,432	2030/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第359回	0.1	300,000	301,494	2030/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第360回	0.1	20,000	20,083	2030/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第361回	0.1	210,000	210,600	2030/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	40,000	48,150	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	10,000	12,108	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	10,000	12,396	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	15,000	18,568	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	20,000	23,782	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	20,000	22,879	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	30,000	33,300	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	10,000	11,836	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	10,000	12,351	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	10,000	12,259	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	30,000	38,393	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	70,000	90,799	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	10,000	13,010	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	20,000	25,830	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	120,000	153,771	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	10,000	12,846	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	60,000	77,502	2035/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	40,000	52,968	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	40,000	53,103	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	80,000	106,470	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	80,000	105,831	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	100,000	134,521	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	30,000	40,557	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	120,000	160,921	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	40,000	52,676	2039/9/20

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32回	2.3	110,000	147,423	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	80,000	103,186	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	110,000	146,558	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	122,000	158,602	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	130,000	169,552	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	130,000	167,550	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	80,000	101,796	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	80,000	103,638	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	100,000	125,653	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	110,000	138,353	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	90,000	113,311	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	110,000	138,626	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	90,000	109,584	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	150,000	182,751	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	110,000	136,621	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	110,000	131,641	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	120,000	143,666	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	50,000	52,907	2046/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第51回	0.3	130,000	122,289	2046/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第52回	0.5	90,000	88,702	2046/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第53回	0.6	100,000	100,783	2046/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第55回	0.8	80,000	84,372	2047/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第56回	0.8	80,000	84,312	2047/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第57回	0.8	110,000	115,845	2047/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第58回	0.8	120,000	126,280	2048/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第59回	0.7	110,000	112,959	2048/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第60回	0.9	100,000	107,556	2048/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第61回	0.7	100,000	102,368	2048/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第62回	0.5	80,000	77,719	2049/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第63回	0.4	60,000	56,636	2049/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第64回	0.4	60,000	56,542	2049/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第65回	0.4	50,000	47,041	2049/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第66回	0.4	50,000	46,962	2050/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第67回	0.6	70,000	69,312	2050/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第68回	0.6	60,000	59,333	2050/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第69回	0.7	60,000	60,895	2050/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	10,000	10,276	2022/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	30,000	30,883	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	10,000	10,246	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	10,000	10,210	2023/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	80,000	81,573	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	10,000	10,408	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	10,000	10,482	2023/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	10,000	10,533	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	20,000	21,014	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	10,000	10,583	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	10,000	10,669	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	30,000	31,923	2024/3/20

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70回	2.4	40,000	43,166	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	10,000	10,729	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	20,000	21,509	2024/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	10,000	10,772	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	10,000	10,809	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	40,000	43,449	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	17,000	18,334	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	15,000	16,235	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	10,000	10,836	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	10,000	10,877	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	10,000	10,919	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	10,000	10,929	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	15,000	16,459	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	15,000	16,536	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	50,000	54,889	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	13,000	14,392	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	10,000	11,168	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	20,000	22,453	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	20,000	22,461	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	10,000	11,284	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	30,000	33,686	2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	70,000	78,545	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	20,000	22,559	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	10,000	11,454	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	15,000	16,997	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	50,000	57,234	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	30,000	34,300	2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	20,000	23,104	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	20,000	23,379	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	20,000	23,479	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	25,000	29,170	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	10,000	11,525	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	70,000	81,000	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	100,000	116,452	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	100,000	116,159	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	80,000	91,708	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	30,000	34,505	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	90,000	104,932	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	10,000	11,784	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	85,000	99,475	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	160,000	187,937	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	50,000	59,369	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	110,000	131,085	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	60,000	70,971	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	40,000	47,115	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	50,000	57,987	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	110,000	125,574	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	70,000	82,066	2030/9/20

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122回	1.8	130,000	151,197	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	100,000	119,436	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	100,000	118,481	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	100,000	120,793	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	30,000	35,650	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	100,000	118,192	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	50,000	58,595	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	90,000	105,744	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	35,000	40,763	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	60,000	70,042	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	120,000	141,344	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	70,000	82,648	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	60,000	70,197	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	30,000	34,777	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	40,000	46,902	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	50,000	57,533	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	60,000	69,697	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	140,000	164,609	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	100,000	117,823	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	100,000	118,965	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	130,000	151,959	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	80,000	92,581	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	190,000	224,891	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	140,000	166,033	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	150,000	176,373	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	170,000	198,199	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	100,000	116,756	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	60,000	69,369	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	170,000	192,270	2034/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第152回	1.2	300,000	339,534	2035/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	120,000	137,546	2035/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第154回	1.2	160,000	181,323	2035/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	160,000	176,915	2035/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	110,000	112,041	2036/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第157回	0.2	120,000	118,521	2036/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第158回	0.5	60,000	61,852	2036/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第159回	0.6	100,000	104,551	2036/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第160回	0.7	10,000	10,597	2037/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第161回	0.6	100,000	104,369	2037/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第162回	0.6	40,000	41,708	2037/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第163回	0.6	100,000	104,169	2037/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第164回	0.5	240,000	245,925	2038/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第165回	0.5	160,000	163,740	2038/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第166回	0.7	60,000	63,333	2038/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第168回	0.4	70,000	70,175	2039/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第169回	0.3	100,000	98,311	2039/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第170回	0.3	120,000	117,745	2039/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第172回	0.4	90,000	89,606	2040/3/20

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173回	0.4	70,000	69,567	2040/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第174回	0.4	130,000	129,071	2040/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第175回	0.5	120,000	121,299	2040/12/20
合 計		26,247,000	28,240,164	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	28,240,164	99.1
コール・ローン等、その他	258,653	0.9
投資信託財産総額	28,498,817	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 (2021年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	28,498,817,528
コール・ローン等	205,399,456
公社債(評価額)	28,240,164,800
未収利息	52,517,204
前払費用	736,068
(B) 負債	10,947,442
未払解約金	10,947,340
未払利息	102
(C) 純資産総額(A-B)	28,487,870,086
元本	20,882,177,477
次期繰越損益金	7,605,692,609
(D) 受益権総口数	20,882,177,477口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,642円

(注) 期首元本額は23,138,175,064円、期中追加設定元本額は6,667,576,378円、期中一部解約元本額は8,923,573,965円、1口当たり純資産額は1.3642円です。

○損益の状況 (2020年5月12日～2021年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	230,640,730
受取利息	230,763,155
支払利息	△ 122,425
(B) 有価証券売買損益	△ 421,473,190
売買益	9,216,700
売買損	△ 430,689,890
(C) 先物取引等取引損益	1,585,200
取引益	1,778,400
取引損	△ 193,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 189,247,260
(E) 前期繰越損益金	8,598,787,886
(F) 追加信託差損益金	2,433,860,103
(G) 解約差損益金	△ 3,237,708,120
(H) 計(D+E+F+G)	7,605,692,609
次期繰越損益金(H)	7,605,692,609

* 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	6,602,425,241
野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）	5,263,043,944
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）	4,469,606,551
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）	1,538,587,690
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	924,811,122
バランスセレクト50	615,442,950
バランスセレクト30	567,540,450
ネクストコア	337,680,237
バランスセレクト70	288,094,501
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	173,821,506
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	53,840,606
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	24,336,233
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	22,946,446

○お知らせ

該当事項はございません。