

野村DC運用戦略ファンド 愛称:ネクスト10

◆ファンドの特色

元本確保型の商品ではありません

|            |  |
|------------|--|
| ・主な投資対象    | 「国内株式マザーファンド」受益証券、「国内債券マザーファンド」受益証券<br>「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」受益証券、「外国債券マザーファンド」受益証券<br>「新興国株式マザーファンド」受益証券、「新興国債券マザーファンド」受益証券<br>「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックス マザーファンド」受益証券<br>「海外REITインデックス マザーファンド」受益証券、「野村マネー マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 |
| ・目標とする運用成果 | 国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)を実質的な投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。   |

◆基準価額、純資産総額

|       |          |
|-------|----------|
| 基準価額  | 10,815 円 |
| 純資産総額 | 184.7億円  |

◆資産構成

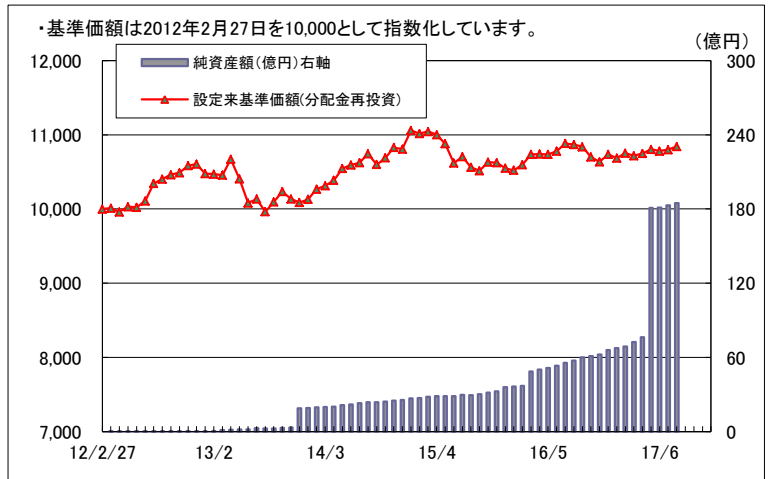
|               | 各マザーへの投資比率 |
|---------------|------------|
| 国内株式          | 7.08%      |
| 国内債券          | 14.76%     |
| 先進国株式         | 7.51%      |
| 先進国債券         | 37.80%     |
| 新興国株式         | 0.00%      |
| 新興国債券(米ドル建て)  | 5.77%      |
| 新興国債券(現地通貨建て) | 3.68%      |
| 国内REIT        | 6.01%      |
| 先進国REIT       | 6.35%      |
| 現金・その他*       | 11.04%     |
| 合計            | 100.00%    |

◆通貨別配分

| 通貨          | 実質通貨比率 |
|-------------|--------|
| 1 日本・円      | 90.71% |
| 2 アメリカ・ドル   | 2.54%  |
| 3 ユーロ       | 1.56%  |
| 4 メキシコ・ペソ   | 0.70%  |
| 5 ポーランド・ズロチ | 0.58%  |
| その他の外貨      | 3.92%  |

\*実質通貨比率は為替予約等を含めた実質的な比率をいいます。

◆基準価額の推移グラフ



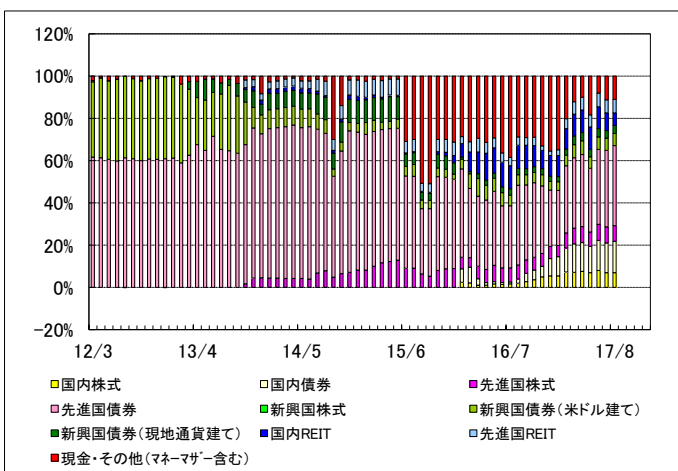
※国内株式:「国内株式マザーファンド」、国内債券:「国内債券マザーファンド」、先進国株式:「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、先進国債券:「外国債券マザーファンド」、新興国株式:「新興国株式マザーファンド」、新興国債券(米ドル建て):「新興国債券マザーファンド」、新興国債券(現地通貨建て):「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、国内REIT:「J-REITインデックス マザーファンド」、先進国REIT:「海外REITインデックス マザーファンド」  
\*野村マネー マザーファンドは現金・その他に含まれます。

◆ファンド(分配金再投資)の収益率とリスク(標準偏差)

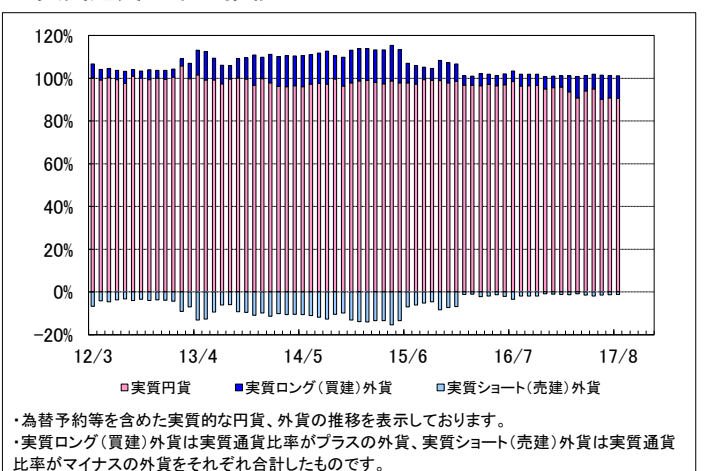
|                 | 3ヶ月間  | 6ヶ月間  | 1年間    | 3年間   | 5年間   | 10年間 | 設定月末来 |
|-----------------|-------|-------|--------|-------|-------|------|-------|
| ファンド収益率(分配金再投資) | 0.35% | 0.82% | -0.24% | 0.30% | 0.83% | —    | 1.46% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | —     | —     | 2.12%  | 3.14% | 3.66% | —    | 3.65% |

\*ファンド(分配金再投資)の収益率とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。  
\*収益率・リスクともに月次収益率より算出。なお設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。  
\*収益率は期間が1年以上の場合は年率、期間が1年未満のものについては年率換算してありません。

◆各資産(マザーファンド)組入比率の推移(対純資産総額)



◆実質通貨比率の推移



■当資料は、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、加入者のみなさまに対して、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、株式や公社債等値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、野村アセットマネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。

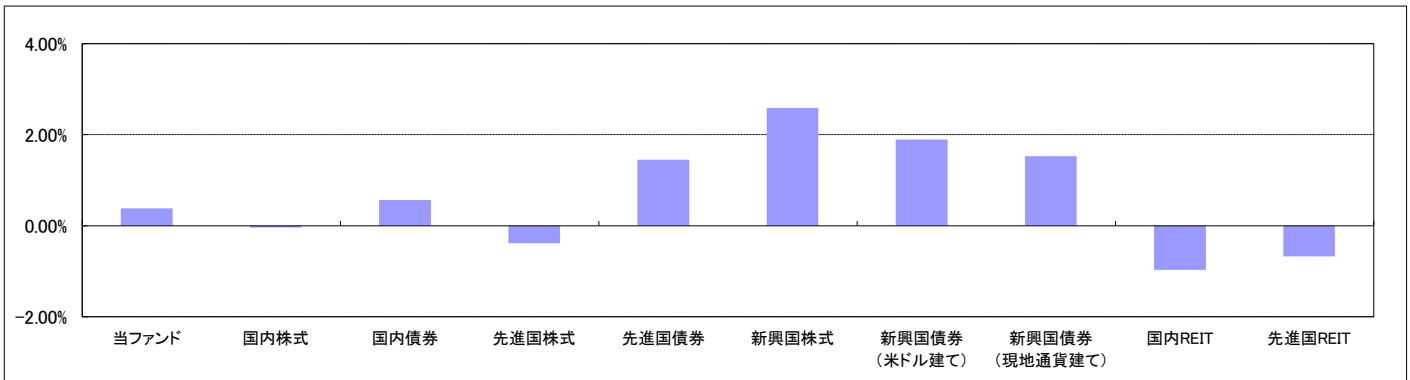
野村DC運用戦略ファンド 愛称:ネクスト10

◆基準価額変動の要因分解(概算)

|         | 合計    | 小計    | 資産要因     |          |           |           |           |                      |                       |            |             | 為替<br>要因等 | 信託<br>報酬等 | 分配金 |
|---------|-------|-------|----------|----------|-----------|-----------|-----------|----------------------|-----------------------|------------|-------------|-----------|-----------|-----|
|         |       |       | 国内<br>株式 | 国内<br>債券 | 先進国<br>株式 | 先進国<br>債券 | 新興国<br>株式 | 新興国債<br>券(米ドル<br>建て) | 新興国債<br>券(現地<br>通貨建て) | 国内<br>REIT | 先進国<br>REIT |           |           |     |
| 2017年6月 | -22 円 | -21 円 | 22 円     | -5 円     | -2 円      | -14 円     | 0 円       | -2 円                 | 4 円                   | -32 円      | 8 円         | 7 円       | -8 円      | 0 円 |
| 2017年7月 | 19 円  | 35 円  | 4 円      | 0 円      | 13 円      | -1 円      | 0 円       | 3 円                  | 2 円                   | 10 円       | 5 円         | -8 円      | -8 円      | 0 円 |
| 2017年8月 | 41 円  | 45 円  | -0 円     | 9 円      | -4 円      | 38 円      | 0 円       | 11 円                 | 3 円                   | -8 円       | -4 円        | 4 円       | -8 円      | 0 円 |
| 3ヵ月累計   | 38 円  | 59 円  | 25 円     | 4 円      | 7 円       | 23 円      | 0 円       | 12 円                 | 9 円                   | -30 円      | 9 円         | 3 円       | -24 円     | 0 円 |

・上記の基準価額変動の要因分解は、一定の仮定のもとに委託会社が試算したものであり、直近3ヵ月の基準価額騰落額の要因を円貨にて表示しております。

◆当ファンドと各マザーファンドの騰落率(月間)



※国内株式:「国内株式マザーファンド」、国内債券:「国内債券マザーファンド」、先進国株式:「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、先進国債券:「外国債券マザーファンド」、新興国株式:「新興国株式マザーファンド」、新興国債券(米ドル建て):「新興国債券マザーファンド」、新興国債券(現地通貨建て):「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、国内REIT:「J-REITインデックス マザーファンド」、先進国REIT:「海外REITインデックス マザーファンド」

◆先月の運用経過

基準価額は前月末41円の上昇となりました。  
先進国債券や新興国債券への投資などがプラスに寄与しました。一方で、国内REITへの投資などがマイナスに影響しました。

(資産構成)

先進国債券への投資を中心とし、国内と先進国の株式やREITおよび新興国債券(米ドル建て、現地通貨建て)にもバランスよく投資をしました。ポートフォリオ全体のバランスを考慮し、一部資産の投資比率の調整を行ないました。

(通貨構成)

外貨建て資産に対して対円で為替ヘッジを行なうことで、実質的な外貨比率を一定範囲内に抑えました。新興国通貨等、一部の通貨に対しては、先進国通貨等による代替ヘッジを行ないました。

◆今後の運用方針 (2017年8月31日 現在)

(以下の内容は当資料作成日時点のものであり、予告なく変更する場合があります。)

債券、株式、REITなどの投資比率や実質的な外貨比率を適宜調整しつつ、ポートフォリオ全体のバランスをとることを目指します。

(資産構成)

先進国債券への投資を中心に、株式やREIT等の幅広い資産にバランスよく分散投資を行なう予定です。キャッシュ比率は、投資環境の不確実性の度合いに応じて、適宜変更していく予定です。

(通貨構成)

外貨建て資産に対して対円で為替ヘッジ(代替ヘッジを含みます)を行なうことで、実質的な外貨比率を一定範囲内に抑えた状態を維持する方針です。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、加入者のみなさまに対して、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、株式や公社債等値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、野村アセットマネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。

野村DC運用戦略ファンド 愛称:ネクスト10

〈リターン実績表〉

単位%

設定日 2012年2月28日

| リターン           | リターン           | リターン | リターン |
|----------------|----------------|------|------|
| 2017年8月 0.38   | 2014年8月 1.12   |      |      |
| 2017年7月 0.18   | 2014年7月 0.28   |      |      |
| 2017年6月 -0.20  | 2014年6月 0.44   |      |      |
| 2017年5月 0.49   | 2014年5月 1.56   |      |      |
| 2017年4月 0.30   | 2014年4月 0.72   |      |      |
| 2017年3月 -0.33  | 2014年3月 0.42   |      |      |
| 2017年2月 0.62   | 2014年2月 1.37   |      |      |
| 2017年1月 -0.46  | 2014年1月 0.41   |      |      |
| 2016年12月 0.93  | 2013年12月 -0.47 |      |      |
| 2016年11月 -0.61 | 2013年11月 -0.97 |      |      |
| 2016年10月 -1.25 | 2013年10月 1.40  |      |      |
| 2016年9月 -0.28  | 2013年9月 1.32   |      |      |
| 2016年8月 -0.14  | 2013年8月 -1.68  |      |      |
| 2016年7月 0.95   | 2013年7月 0.51   |      |      |
| 2016年6月 0.40   | 2013年6月 -3.12  |      |      |
| 2016年5月 -0.04  | 2013年5月 -2.47  |      |      |
| 2016年4月 0.04   | 2013年4月 2.04   |      |      |
| 2016年3月 1.32   | 2013年3月 -0.13  |      |      |
| 2016年2月 0.71   | 2013年2月 -0.04  |      |      |
| 2016年1月 -0.28  | 2013年1月 -1.23  |      |      |
| 2015年12月 -0.69 | 2012年12月 0.17  |      |      |
| 2015年11月 -0.08 | 2012年11月 0.93  |      |      |
| 2015年10月 1.10  | 2012年10月 0.26  |      |      |
| 2015年9月 -0.45  | 2012年9月 0.58   |      |      |
| 2015年8月 -1.33  | 2012年8月 0.55   |      |      |
| 2015年7月 0.80   | 2012年7月 2.33   |      |      |
| 2015年6月 -2.38  | 2012年6月 0.85   |      |      |
| 2015年5月 -1.12  | 2012年5月 -0.08  |      |      |
| 2015年4月 -0.38  | 2012年4月 0.70   |      |      |
| 2015年3月 0.25   | 2012年3月 -0.51  |      |      |
| 2015年2月 -0.39  |                |      |      |
| 2015年1月 2.32   |                |      |      |
| 2014年12月 -0.18 |                |      |      |
| 2014年11月 1.29  |                |      |      |
| 2014年10月 0.86  |                |      |      |
| 2014年9月 -1.34  |                |      |      |

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、加入者のみなさまに対して、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、株式や公社債等値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、野村アセットマネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。