

# 米欧債券・インカムオープン (毎月分配型)

## 償還運用報告書(全体版)

第210期(決算日2021年7月5日) 第211期(決算日2021年8月5日) 第212期(決算日2021年9月6日)  
第213期(決算日2021年10月5日) 第214期(決算日2021年11月5日) 第215期(償還日2021年12月6日)

作成対象期間(2021年6月8日～2021年12月6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。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行ない、償還価額が決定いたしました。

ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

### ●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/海外/債券	
信託期間	2021年12月6日をもちまして繰上償還いたします。(設定日2003年12月19日)	
運用方針	米ドル建ておよびユーロ建ての公社債(国債、政府機関債、社債、MBS、CMBS、ABS等)を実質的な主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。 米ドル建て資産およびユーロ建て資産への配分は50%:50%程度を基本とします。実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	米欧債券・インカムオープン	米欧債券総合マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	米欧債券総合マザーファンド	米ドル建ておよびユーロ建ての公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	米欧債券・インカムオープン	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。株式への投資は転換社債を転換したもの等に限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。
	米欧債券総合マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行ないます。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合があります。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。	

## 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30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配率)	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産額	
		税金	期騰落	期騰落	期騰落				
186期(2019年7月5日)	8,541	円	15	2.0	185.09	1.9	98.0	3.5	1,833
187期(2019年8月5日)	8,405		15	△1.4	182.50	△1.4	95.6	△5.6	1,789
188期(2019年9月5日)	8,494		15	1.2	185.14	1.4	95.8	1.5	1,804
189期(2019年10月7日)	8,450		15	△0.3	184.85	△0.2	92.1	10.0	1,787
190期(2019年11月5日)	8,556		15	1.4	187.66	1.5	95.8	10.8	1,800
191期(2019年12月5日)	8,518		15	△0.3	187.33	△0.2	95.5	22.1	1,787
192期(2020年1月6日)	8,493		15	△0.1	187.14	△0.1	95.7	16.0	1,772
193期(2020年2月5日)	8,617		15	1.6	190.54	1.8	95.2	13.8	1,791
194期(2020年3月5日)	8,620		15	0.2	191.45	0.5	94.2	9.7	1,790
195期(2020年4月6日)	8,278		15	△3.8	186.64	△2.5	93.8	14.1	1,674
196期(2020年5月7日)	8,174		15	△1.1	183.15	△1.9	94.1	10.3	1,614
197期(2020年6月5日)	8,659		15	6.1	194.03	5.9	94.9	10.9	1,702
198期(2020年7月6日)	8,608		15	△0.4	193.03	△0.5	92.3	0.3	1,679
199期(2020年8月5日)	8,768		15	2.0	196.74	1.9	90.3	10.1	1,691
200期(2020年9月7日)	8,755		15	0.0	197.08	0.2	92.1	5.6	1,680
201期(2020年10月5日)	8,663		15	△0.9	195.40	△0.9	92.8	△2.9	1,654
202期(2020年11月5日)	8,581		15	△0.8	194.03	△0.7	93.6	2.4	1,632
203期(2020年12月7日)	8,680		15	1.3	196.78	1.4	89.7	△1.2	1,633
204期(2021年1月5日)	8,666		15	0.0	197.02	0.1	90.9	6.9	1,622
205期(2021年2月5日)	8,659		15	0.1	197.50	0.2	94.4	9.1	1,612
206期(2021年3月5日)	8,699		15	0.6	198.85	0.7	91.7	9.9	1,597
207期(2021年4月5日)	8,813		15	1.5	201.83	1.5	93.8	3.1	1,617
208期(2021年5月6日)	8,769		15	△0.3	201.63	△0.1	95.2	7.5	1,596
209期(2021年6月7日)	8,828		15	0.8	203.61	1.0	96.2	3.4	1,601
210期(2021年7月5日)	8,876		15	0.7	205.10	0.7	95.3	3.3	1,602
211期(2021年8月5日)	8,835		15	△0.3	204.96	△0.1	95.0	△3.2	1,592
212期(2021年9月6日)	8,789		15	△0.4	204.32	△0.3	93.8	0.9	1,571
213期(2021年10月5日)	8,697		15	△0.9	202.53	△0.9	94.1	△4.8	1,390
214期(2021年11月5日)	8,888		0	2.2	207.43	2.4	86.6	0.1	1,353
(償還時)	(償還価額)								
215期(2021年12月6日)	8,773.09		—	△1.3	204.85	△1.2	—	—	1,327

\* 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。

\* 債券組入比率は売付債券の比率を差引いておりません。

\* ベンチマーク＝ブルームバーグ・米国総合インデックス<sup>※①</sup>(円換算ベース)およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス<sup>※②</sup>(円換算ベース)を50%:50%の比率で当社が独自に合成した指数

\* ブルームバーグ・米国総合インデックス(円換算ベース)はブルームバーグ・米国総合インデックス(米ドルベース)をもとに、ブルームバーグ・ユーロ総合インデックス(円換算ベース)はブルームバーグ・ユーロ総合インデックス(ユーロベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。

\* ベンチマークの算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。なお、設定時を100としています。

\* 「Bloomberg®」およびブルームバーグ・米国総合インデックス、ブルームバーグ・ユーロ総合インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited(以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグは野村アセットマネジメント株式会社とは提携しておらず、また、米欧債券・インカムオープンを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、米欧債券・インカムオープンに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

※①名称変更しております(旧名称はブルームバーグ・バークレイズ・米国総合インデックス)。

※②名称変更しております(旧名称はブルームバーグ・バークレイズ・ユーロ総合インデックス)。

(出所:ブルームバーグ)

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		ベンチ マ ーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		円 銭	騰 落 率		騰 落 率		
第210期	(期 首) 2021年6月7日	8,828	—	203.61	—	96.2	3.4
	6月末	8,831	0.0	203.70	0.0	94.0	4.2
	(期 末) 2021年7月5日	8,891	0.7	205.10	0.7	95.3	3.3
第211期	(期 首) 2021年7月5日	8,876	—	205.10	—	95.3	3.3
	7月末	8,830	△0.5	204.38	△0.4	93.3	△3.2
	(期 末) 2021年8月5日	8,850	△0.3	204.96	△0.1	95.0	△3.2
第212期	(期 首) 2021年8月5日	8,835	—	204.96	—	95.0	△3.2
	8月末	8,810	△0.3	204.34	△0.3	94.9	0.4
	(期 末) 2021年9月6日	8,804	△0.4	204.32	△0.3	93.8	0.9
第213期	(期 首) 2021年9月6日	8,789	—	204.32	—	93.8	0.9
	9月末	8,779	△0.1	204.14	△0.1	94.7	△1.5
	(期 末) 2021年10月5日	8,712	△0.9	202.53	△0.9	94.1	△4.8
第214期	(期 首) 2021年10月5日	8,697	—	202.53	—	94.1	△4.8
	10月末	8,915	2.5	207.64	2.5	94.4	1.8
	(期 末) 2021年11月5日	8,888	2.2	207.43	2.4	86.6	0.1
第215期	(期 首) 2021年11月5日	8,888	—	207.43	—	86.6	0.1
	11月末	8,779	△1.2	204.90	△1.2	—	—
	(償還時) 2021年12月6日	(償還価額) 8,773.09	△1.3	204.85	△1.2	—	—

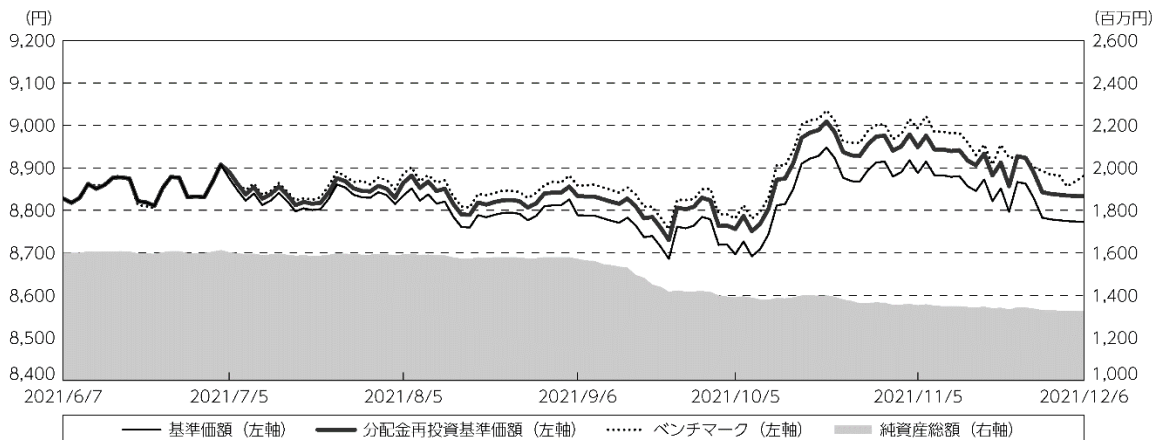
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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

### ○作成期間中の基準価額等の推移



- (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6月7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、ブルームバーグ・米国総合インデックス(円換算ベース)およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス(円換算ベース)を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月7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

米ドル建て債券とユーロ建て債券に、約50%程度ずつの比率で投資しました。このためファンドの基準価額は、円/ドルと円/ユーロの為替レート、及び米欧債券市場の動向の影響を受けて推移しました。当作成期においては、保有していた債券のインカム収入や、円がドルに対して円安方向へ推移したことなどが基準価額へのプラス要因となりました。

## ○投資環境

米国債券市場は、当作成期間では、利回りは低下（価格は上昇）しました。変異株による新型コロナウイルスの感染拡大などを受け、今後の景気回復鈍化への警戒から、利回りは低下しました。

欧州債券市場は、当作成期間では、利回りは低下しました。新型コロナウイルスのデルタ型による感染拡大に懸念が高まったことや、ECB（欧州中央銀行）理事会で、これまでの見通しよりも長い間、金融緩和を維持する方針が示されたことなどから、利回りは低下しました。

為替市場は、ドルについては、原油価格等のエネルギー価格の高騰によるインフレへの警戒などから米長期金利が上昇したことなどから、当作成期間では対円で上昇しました。

ユーロについては、欧州での新型コロナウイルスの感染再拡大や、南アフリカで新型コロナウイルスの新たな変異株が発見されたことで円高が進行したことなどから、当作成期間では対円で下落しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [米欧債券・インカムオープン]

[米欧債券総合マザーファンド] 受益証券の組み入れを高位に維持しました。11月に、償還対応のため、[米欧債券総合マザーファンド] を全売却しました。

### [米欧債券総合マザーファンド]

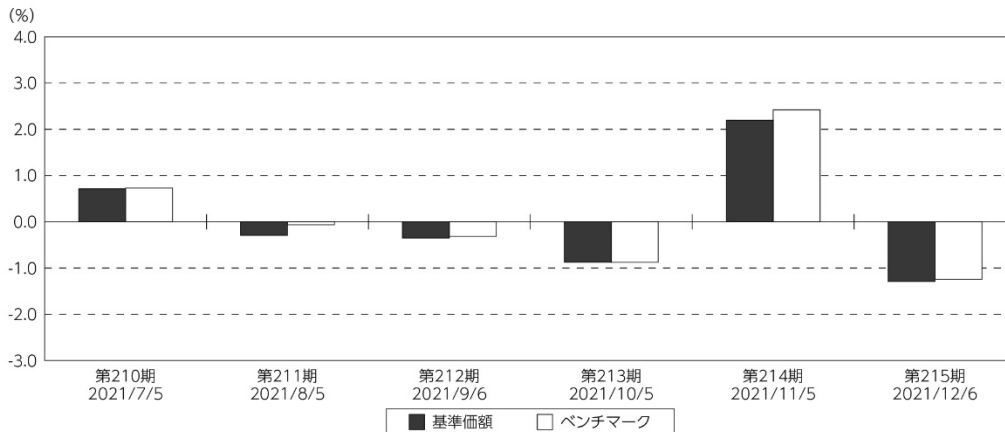
- ・ 為替については、当作成期を通じ、ドルとユーロの通貨比率を50%程度ずつに維持しました。
- ・ 債券については、米欧の主要債券セクター（国債・政府機関債、資産担保証券、社債など）にバランスよく分散した投資を行ないました。
- ・ 11月に、償還対応のため、債券などを全売却しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率※は+0.1%となり、ベンチマークの+0.6%を0.5ポイント下回りました。基準価額とベンチマークとの主な差異要因は、米国のデュレーション（金利感応度）をベンチマークより短期化していたことなどでした。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

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、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。

## ◎分配金

収益分配金については、各期の利子・配当収入などから信託報酬などの諸経費を差し引いた額をベースに決定しました。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せん。

第215期は、償還のため分配は行ないませんでした。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第210期	第211期	第212期	第213期	第214期
	2021年6月8日～ 2021年7月5日	2021年7月6日～ 2021年8月5日	2021年8月6日～ 2021年9月6日	2021年9月7日～ 2021年10月5日	2021年10月6日～ 2021年11月5日
当期分配金	15	15	15	15	—
(対基準価額比率)	0.169%	0.169%	0.170%	0.172%	—%
当期の収益	10	3	3	4	—
当期の収益以外	5	11	11	10	—
翌期繰越分配対象額	360	349	337	327	340

(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。

## ◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から償還時8,773.09円となりました。

設定来お支払いした分配金は、1万口当たり5,770円となりました。

#### 【第1期～第47期（2003年12月19日～2007年12月5日）】

- ・設定時から第47期にかけては、基準価額※は上昇しました。
- ・保有していた債券の価格が上昇したことやインカム収入、また円がドルとユーロに対して円安方向へ推移したことなどが、基準価額へのプラス要因となりました。

#### 【第48期～第95期（2007年12月6日～2011年12月5日）】

- ・第48期から第95期にかけては、基準価額※は下落しました。
- ・円がドルとユーロに対して円高方向へ推移したことなどが、基準価額へのマイナス要因となりました。

#### 【第96期～第143期（2011年12月6日～2015年12月7日）】

- ・第96期から第143期にかけては、基準価額※は上昇しました。
- ・保有していた債券のインカム収入、また円がドルとユーロに対して円安方向へ推移したことなどが、基準価額へのプラス要因となりました。

#### 【第144期～第215期（2015年12月8日～2021年12月6日）】

- ・第144期から第215期にかけては、基準価額※は上昇しました。
- ・保有していた債券のインカム収入などが、基準価額へのプラス要因となりました。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

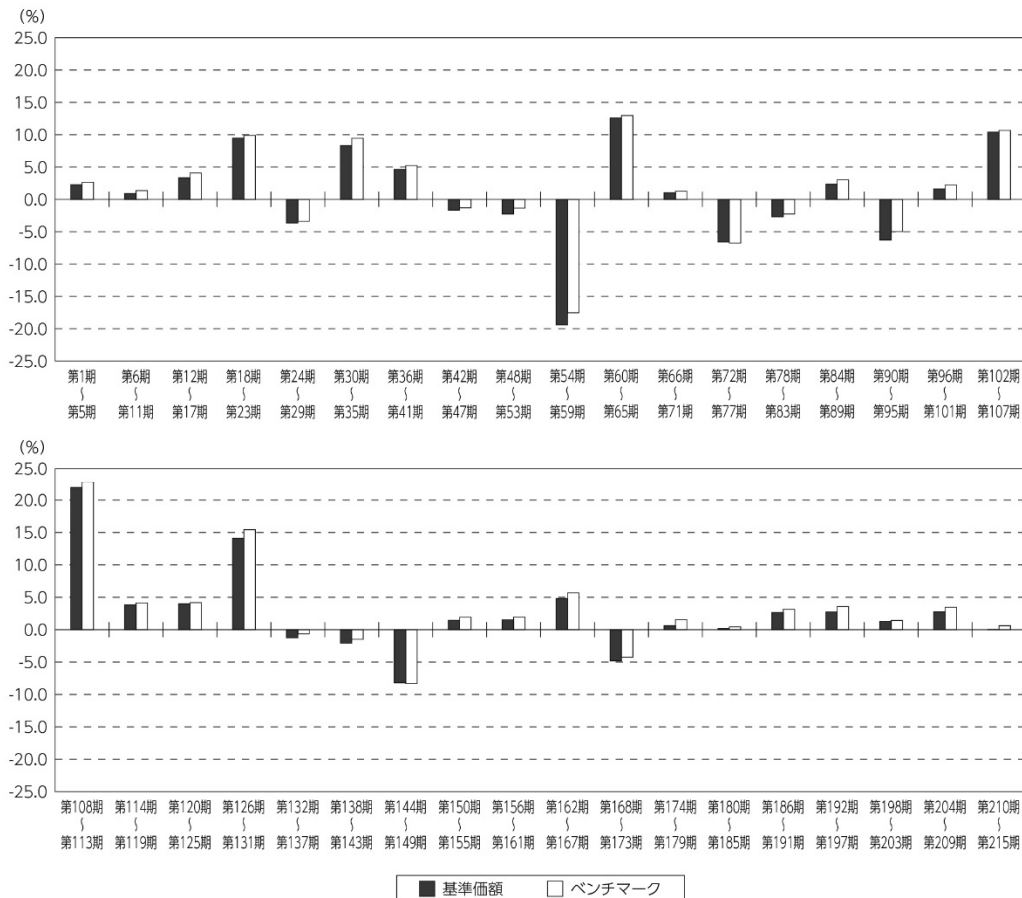


## ○ベンチマークとの対比

設定来では、ベンチマークは+104.9%となったのに対し、基準価額の騰落率※は、+66.6%となりました。主なプラス要因は、保有銘柄の銘柄選択効果によるものでした。主なマイナス要因は、信託報酬を中心としたファンドの諸費用などでした。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

< 基準価額とベンチマークの対比（騰落率） >



(注) 基準価額の騰落率は、分配金を再投資して算出しております。

(注) ベンチマークは、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50% : 50%の比率で当社が独自に合成した指数です。

(注) 騰落率は作成期毎に算出しております。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月8日～2021年12月6日)

項 目	第210期～第215期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	53	0.603	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(27)	(0.302)	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 ）	(24)	(0.274)	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 ）	( 2 )	(0.027)	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	0.004	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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 )	(0.004)	
(c) そ の 他 費 用	3	0.032	(c) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 2 )	(0.025)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.001)	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
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.005)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	56	0.639	
作成期間の平均基準価額は、8,824円です。			

\* 作成期間の費用（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。

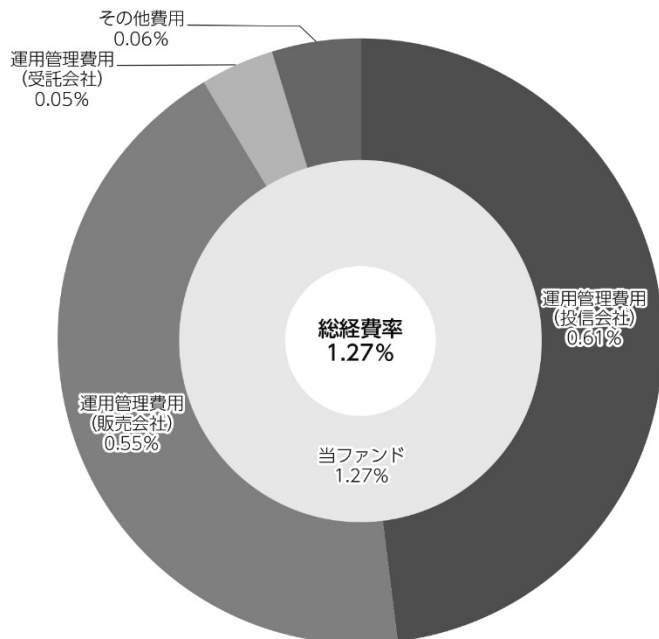
\* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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）を作成期間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

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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1.27%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6月8日～2021年12月6日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第210期～第215期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
米欧債券総合マザーファンド		922	1,900	770,169	1,597,934

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年6月8日～2021年12月6日)

該当事項はございません。

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す。

## ○組入資産の明細

(2021年12月6日現在)

2021年12月6日現在、有価証券等の組入れはございません。

## 親投資信託残高

銘	柄	第209期末	
		口 数	金 額
		千口	千円
米欧債券総合マザーファンド		769,247	

\*単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年12月6日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	1,329,251	100.0
投資信託財産総額	1,329,251	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び償還(基準)価額の状況

項 目	第210期末	第211期末	第212期末	第213期末	第214期末	償 還 時
	2021年7月5日現在	2021年8月5日現在	2021年9月6日現在	2021年10月5日現在	2021年11月5日現在	2021年12月6日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,611,154,577	1,597,079,571	1,579,823,936	1,399,934,545	1,357,489,702	1,329,251,495
コール・ローン等	15,773,165	14,827,822	15,323,451	13,943,669	13,511,727	1,329,251,495
米欧債券総合マザーファンド(評価額)	1,590,981,412	1,576,851,749	1,556,400,485	1,376,790,876	1,341,277,975	—
未収入金	4,400,000	5,400,000	8,100,000	9,200,000	2,700,000	—
(B) 負債	8,327,419	4,343,015	8,129,393	9,212,959	3,815,187	1,864,426
未払収益分配金	2,708,809	2,704,015	2,682,351	2,398,622	—	—
未払解約金	4,127,098	—	3,765,487	5,402,036	2,394,333	438,700
未払信託報酬	1,488,806	1,636,020	1,678,500	1,409,737	1,418,273	1,422,275
未払利息	11	15	12	9	14	875
その他未払費用	2,695	2,965	3,043	2,555	2,567	2,576
(C) 純資産総額(A-B)	1,602,827,158	1,592,736,556	1,571,694,543	1,390,721,586	1,353,674,515	1,327,387,069
元本	1,805,873,041	1,802,677,285	1,788,234,425	1,599,081,801	1,523,100,188	1,513,021,697
次期繰越損益金	△ 203,045,883	△ 209,940,729	△ 216,539,882	△ 208,360,215	△ 169,425,673	—
償還差損金	—	—	—	—	—	△ 185,634,628
(D) 受益権総口数	1,805,873,041口	1,802,677,285口	1,788,234,425口	1,599,081,801口	1,523,100,188口	1,513,021,697口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,876円	8,835円	8,789円	8,697円	8,888円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	8,773円09銭

(注) 第210期首元本額は1,813,730,533円、第210～215期中追加設定元本額は4,165,155円、第210～215期中一部解約元本額は304,873,991円、1口当たり純資産額は、第210期0.8876円、第211期0.8835円、第212期0.8789円、第213期0.8697円、第214期0.8888円、第215期0.877309円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額1,986,216円。(‘21年6月8日～’21年12月3日、米欧債券総合マザーファンド)

## ○損益の状況

項 目	第210期	第211期	第212期	第213期	第214期	第215期
	2021年6月8日～ 2021年7月5日	2021年7月6日～ 2021年8月5日	2021年8月6日～ 2021年9月6日	2021年9月7日～ 2021年10月5日	2021年10月6日～ 2021年11月5日	2021年11月6日～ 2021年12月6日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 367	△ 390	△ 413	△ 272	△ 319	△ 1,209
支払利息	△ 367	△ 390	△ 413	△ 272	△ 319	△ 1,209
(B) 有価証券売買損益	12,804,467	△ 2,910,027	△ 3,916,377	△ 10,912,943	30,455,327	△ 15,904,009
売買益	12,927,568	18,902	27,276	520,752	31,492,164	41,709
売買損	△ 123,101	△ 2,928,929	△ 3,943,653	△ 11,433,695	△ 1,036,837	△ 15,945,718
(C) 信託報酬等	△ 1,491,501	△ 1,638,985	△ 1,681,543	△ 1,412,292	△ 1,420,840	△ 1,424,851
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	11,312,599	△ 4,549,402	△ 5,598,333	△ 12,325,507	29,034,168	△ 17,330,069
(E) 前期繰越損益金	△169,032,221	△159,202,213	△164,189,500	△152,592,793	△157,817,758	△127,931,412
(F) 追加信託差損益金	△ 42,617,452	△ 43,485,099	△ 44,069,698	△ 41,043,293	△ 40,642,083	△ 40,373,147
(配当等相当額)	( 63,086,007)	( 62,078,476)	( 60,687,987)	( 52,670,383)	( 48,645,413)	( 48,323,867)
(売買損益相当額)	(△105,703,459)	(△105,563,575)	(△104,757,685)	(△ 93,713,676)	(△ 89,287,496)	(△ 88,697,014)
(G) 計 (D+E+F)	△200,337,074	△207,236,714	△213,857,531	△205,961,593	△169,425,673	—
(H) 収益分配金	△ 2,708,809	△ 2,704,015	△ 2,682,351	△ 2,398,622	0	—
次期繰越損益金 (G+H)	△203,045,883	△209,940,729	△216,539,882	△208,360,215	△169,425,673	—
償還差損金 (D+E+F)	—	—	—	—	—	△185,634,628
追加信託差損益金	△ 43,520,388	△ 44,386,437	△ 45,857,932	△ 42,642,375	△ 40,642,083	—
(配当等相当額)	( 62,187,773)	( 61,177,720)	( 58,900,240)	( 51,071,921)	( 48,645,763)	( —)
(売買損益相当額)	(△105,708,161)	(△105,564,157)	(△104,758,172)	(△ 93,714,296)	(△ 89,287,846)	( —)
分配準備積立金	2,936,323	1,748,594	1,542,199	1,339,220	3,216,427	—
繰越損益金	△162,461,818	△167,302,886	△172,224,149	△167,057,060	△132,000,017	—

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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6月8日～2021年11月5日) は以下の通りです。

項 目	第210期	第211期	第212期	第213期	第214期
	2021年6月8日～ 2021年7月5日	2021年7月6日～ 2021年8月5日	2021年8月6日～ 2021年9月6日	2021年9月7日～ 2021年10月5日	2021年10月6日～ 2021年11月5日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,995,276円	620,899円	702,137円	760,004円	1,941,050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	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	63,090,709円	62,079,058円	60,688,474円	52,671,003円	48,645,763円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,746,920円	2,930,372円	1,734,179円	1,378,756円	1,275,377円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	67,832,905円	65,630,329円	63,124,790円	54,809,763円	51,862,190円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	375円	364円	352円	342円	340円
g. 分配金	2,708,809円	2,704,015円	2,682,351円	2,398,622円	0円
h. 分配金(1万口当たり)	15円	15円	15円	15円	0円

## ○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2003年12月19日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年12月6日			資産総額	1,329,251,495円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	1,864,426円	
受益権口数	5,063,816,758口	1,513,021,697口	△3,550,795,061口	純資産総額	1,327,387,069円	
元本額	5,063,816,758円	1,513,021,697円	△3,550,795,061円	受益権口数	1,513,021,697口	
				1万円当たり償還金	8,773円09銭	
最近10年の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金		
				金額	分配率	
第96期	9,095,068,857円	6,019,389,920円	6,618円	35円	0.35%	
第97期	8,748,239,234	5,892,482,080	6,736	35	0.35	
第98期	8,562,517,335	6,199,560,224	7,240	35	0.35	
第99期	8,371,870,265	6,044,691,024	7,220	25	0.25	
第100期	8,215,328,111	5,757,066,918	7,008	25	0.25	
第101期	8,050,011,948	5,429,980,023	6,745	25	0.25	
第102期	7,893,608,133	5,409,743,020	6,853	25	0.25	
第103期	7,707,833,673	5,202,402,461	6,750	25	0.25	
第104期	7,482,455,551	5,083,119,958	6,793	25	0.25	
第105期	7,302,253,990	5,071,820,758	6,946	25	0.25	
第106期	7,157,169,553	5,053,139,289	7,060	25	0.25	
第107期	7,026,248,089	5,120,975,670	7,288	25	0.25	
第108期	6,860,232,566	5,338,369,408	7,782	25	0.25	
第109期	6,676,890,739	5,487,530,027	8,219	25	0.25	
第110期	6,516,935,591	5,336,569,603	8,189	25	0.25	
第111期	6,330,260,857	5,372,457,862	8,487	25	0.25	
第112期	6,105,768,589	5,365,115,260	8,787	25	0.25	
第113期	5,906,842,098	5,157,651,311	8,732	25	0.25	
第114期	5,777,379,966	4,937,932,404	8,547	25	0.25	
第115期	5,707,457,785	4,888,248,846	8,565	25	0.25	
第116期	5,614,907,163	4,756,329,523	8,471	25	0.25	
第117期	5,553,060,792	4,696,791,335	8,458	25	0.25	
第118期	5,453,474,513	4,697,450,038	8,614	25	0.25	
第119期	5,327,447,298	4,746,397,741	8,909	25	0.25	
第120期	5,098,494,347	4,630,959,274	9,083	25	0.25	
第121期	4,999,468,037	4,444,259,283	8,889	25	0.25	
第122期	4,941,548,646	4,467,574,840	9,041	25	0.25	
第123期	4,880,238,767	4,458,559,853	9,136	25	0.25	
第124期	4,819,466,487	4,397,640,158	9,125	25	0.25	
第125期	4,734,420,170	4,314,357,119	9,113	25	0.25	
第126期	4,674,206,345	4,249,246,255	9,091	25	0.25	
第127期	4,602,030,977	4,187,625,050	9,100	25	0.25	
第128期	4,548,352,710	4,198,345,024	9,230	25	0.25	

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第129期	4,481,913,115円	4,221,897,222円	9,420円	25円	0.25%
第130期	4,415,771,054	4,313,390,851	9,768	25	0.25
第131期	4,299,426,837	4,401,558,971	10,238	25	0.25
第132期	4,221,024,363	4,288,468,787	10,160	25	0.25
第133期	4,127,895,979	4,022,566,732	9,745	25	0.25
第134期	4,037,791,577	3,957,815,983	9,802	25	0.25
第135期	3,934,401,150	3,846,816,130	9,777	25	0.25
第136期	3,828,323,876	3,716,118,814	9,707	25	0.25
第137期	3,799,733,492	3,783,397,364	9,957	25	0.25
第138期	3,731,788,343	3,591,467,084	9,624	25	0.25
第139期	3,690,855,744	3,623,349,535	9,817	25	0.25
第140期	3,631,477,914	3,444,484,416	9,485	25	0.25
第141期	3,604,026,168	3,456,205,020	9,590	25	0.25
第142期	3,555,550,801	3,384,851,748	9,520	25	0.25
第143期	3,494,814,728	3,354,479,624	9,598	25	0.25
第144期	3,422,768,060	3,169,464,312	9,260	25	0.25
第145期	3,397,312,111	3,166,949,288	9,322	25	0.25
第146期	3,378,459,930	3,040,556,959	9,000	25	0.25
第147期	3,356,554,885	3,035,221,922	9,043	25	0.25
第148期	3,325,996,569	2,903,558,374	8,730	25	0.25
第149期	3,296,655,846	2,856,644,776	8,665	25	0.25
第150期	3,259,935,541	2,722,158,476	8,350	25	0.25
第151期	3,222,294,216	2,665,771,291	8,273	25	0.25
第152期	3,190,024,914	2,698,480,032	8,459	25	0.25
第153期	3,162,921,958	2,637,794,344	8,340	25	0.25
第154期	3,141,984,974	2,607,223,572	8,298	15	0.15
第155期	3,106,434,682	2,688,705,501	8,655	15	0.15
第156期	3,051,727,631	2,699,087,478	8,844	15	0.15
第157期	3,025,009,193	2,592,069,932	8,569	15	0.15
第158期	2,996,564,199	2,584,819,986	8,626	15	0.15
第159期	2,934,972,131	2,483,104,532	8,460	15	0.15
第160期	2,875,008,903	2,503,198,193	8,707	15	0.15
第161期	2,836,231,915	2,466,435,525	8,696	15	0.15
第162期	2,789,416,199	2,473,636,674	8,868	15	0.15
第163期	2,727,688,332	2,423,776,622	8,886	15	0.15
第164期	2,661,013,281	2,355,547,175	8,852	15	0.15
第165期	2,614,042,792	2,353,578,877	9,004	15	0.15
第166期	2,565,935,355	2,332,597,610	9,091	15	0.15
第167期	2,548,964,087	2,299,991,625	9,023	15	0.15
第168期	2,510,376,382	2,278,385,103	9,076	15	0.15
第169期	2,488,759,208	2,203,613,995	8,854	15	0.15
第170期	2,477,703,095	2,091,839,562	8,443	15	0.15
第171期	2,423,360,305	2,073,486,528	8,556	15	0.15



計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第172期	2,423,670,188円	2,071,898,402円	8,549円	15円	0.15%
第173期	2,416,044,468	2,053,552,929	8,500	15	0.15
第174期	2,403,336,600	2,052,371,066	8,540	15	0.15
第175期	2,392,962,324	2,039,768,680	8,524	15	0.15
第176期	2,355,187,155	2,010,439,283	8,536	15	0.15
第177期	2,319,470,268	1,993,574,703	8,595	15	0.15
第178期	2,303,196,483	1,948,421,451	8,460	15	0.15
第179期	2,248,390,729	1,902,662,115	8,462	15	0.15
第180期	2,236,437,953	1,838,815,732	8,222	15	0.15
第181期	2,224,367,494	1,865,857,845	8,388	15	0.15
第182期	2,207,949,020	1,875,431,427	8,494	15	0.15
第183期	2,194,621,760	1,875,786,444	8,547	15	0.15
第184期	2,184,057,541	1,850,291,547	8,472	15	0.15
第185期	2,176,719,923	1,825,497,044	8,386	15	0.15
第186期	2,146,378,561	1,833,318,738	8,541	15	0.15
第187期	2,128,637,472	1,789,170,128	8,405	15	0.15
第188期	2,124,685,535	1,804,799,811	8,494	15	0.15
第189期	2,115,741,929	1,787,776,539	8,450	15	0.15
第190期	2,104,476,904	1,800,550,571	8,556	15	0.15
第191期	2,098,071,529	1,787,236,545	8,518	15	0.15
第192期	2,086,695,850	1,772,167,689	8,493	15	0.15
第193期	2,078,773,310	1,791,219,454	8,617	15	0.15
第194期	2,076,855,592	1,790,257,251	8,620	15	0.15
第195期	2,023,480,776	1,674,975,794	8,278	15	0.15
第196期	1,975,568,650	1,614,900,932	8,174	15	0.15
第197期	1,965,871,081	1,702,212,190	8,659	15	0.15
第198期	1,950,724,525	1,679,136,616	8,608	15	0.15
第199期	1,928,982,580	1,691,246,782	8,768	15	0.15
第200期	1,919,238,785	1,680,355,931	8,755	15	0.15
第201期	1,909,472,702	1,654,263,819	8,663	15	0.15
第202期	1,902,428,184	1,632,478,533	8,581	15	0.15
第203期	1,882,278,594	1,633,771,651	8,680	15	0.15
第204期	1,872,354,109	1,622,560,749	8,666	15	0.15
第205期	1,862,161,054	1,612,469,590	8,659	15	0.15
第206期	1,836,462,281	1,597,580,348	8,699	15	0.15
第207期	1,834,890,373	1,617,156,739	8,813	15	0.15
第208期	1,820,437,285	1,596,254,446	8,769	15	0.15
第209期	1,813,730,533	1,601,161,408	8,828	15	0.15
第210期	1,805,873,041	1,602,827,158	8,876	15	0.15
第211期	1,802,677,285	1,592,736,556	8,835	15	0.15
第212期	1,788,234,425	1,571,694,543	8,789	15	0.15
第213期	1,599,081,801	1,390,721,586	8,697	15	0.15
第214期	1,523,100,188	1,353,674,515	8,888	0	0.00

## ○分配金のお知らせ

	第210期	第211期	第212期	第213期	第214期
1万口当たり分配金（税込み）	15円	15円	15円	15円	0円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○償還金のお知らせ

	償還時
1万口当たり償還金（税込み）	8,773円09銭

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 米欧債券総合マザーファンド

## 償還運用報告書

第18期（償還日2021年12月3日）

作成対象期間（2020年12月8日～2021年12月3日）

### 受益者のみなさまへ

米欧債券総合マザーファンドの設定日以降、償還までの運用状況をご報告申し上げます。  
ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	米ドル建ておよびユーロ建ての公社債（国債、政府機関債、社債、MBS、CMBS、ABS等）を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。米ドル建て資産およびユーロ建て資産への配分は50%：50%程度を基本とします。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	米ドル建ておよびユーロ建て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割合には制限を設けません。

**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		債権組入比率	債券先物比率	純資産額
		騰落率	騰落率			
14期(2017年12月5日)	円 銭 18,752	% 7.7	% 7.7	% 92.0	% 7.9	百万円 2,276
15期(2018年12月5日)	18,168	△3.1	△2.8	96.5	9.5	1,887
16期(2019年12月5日)	18,914	4.1	3.6	96.2	22.2	1,774
17期(2020年12月7日)	19,937	5.4	5.0	90.6	△1.3	1,618
(償還時) 18期(2021年12月3日)	(償還価額) 20,759.02	4.1	3.9	—	—	1,317

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*債券組入比率は売付債券の比率を差引いておりません。

\*ベンチマーク＝ブルームバーグ・米国総合インデックス<sup>※①</sup>(円換算ベース) およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス<sup>※②</sup>(円換算ベース)を50%:50%の比率で当社が独自に合成した指数

\*ブルームバーグ・米国総合インデックス(円換算ベース)はブルームバーグ・米国総合インデックス(米ドルベース)をもとに、ブルームバーグ・ユーロ総合インデックス(円換算ベース)はブルームバーグ・ユーロ総合インデックス(ユーロベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。

\*ベンチマークの算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。なお、設定時を100としています。

\*「Bloomberg®」およびブルームバーグ・米国総合インデックス、ブルームバーグ・ユーロ総合インデックスは、Bloomberg Finance L.P. および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited (以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグは野村アセットマネジメント株式会社とは提携しておりません。また、米欧債券総合マザーファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、米欧債券総合マザーファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

※①名称変更しております(旧名称はブルームバーグ・バークレイズ・米国総合インデックス)。

※②名称変更しております(旧名称はブルームバーグ・バークレイズ・ユーロ総合インデックス)。

(出所:ブルームバーグ)

## ○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		債権組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率		
(期首) 2020年12月7日	円 銭 19,937	% —	% —	% 90.6	% △1.3
12月末	20,004	0.3	0.4	94.4	3.0
2021年1月末	19,982	0.2	0.3	95.2	6.8
2月末	19,957	0.1	△0.0	95.6	8.4
3月末	20,382	2.2	2.2	94.7	5.4
4月末	20,397	2.3	2.3	95.0	5.4
5月末	20,631	3.5	3.6	94.8	7.4
6月末	20,642	3.5	3.5	94.9	4.3
7月末	20,695	3.8	3.9	94.1	△3.2
8月末	20,706	3.9	3.8	95.7	0.4
9月末	20,690	3.8	3.7	95.4	△1.5
10月末	21,069	5.7	5.5	95.1	1.9
11月末	20,768	4.2	4.1	—	—
(償還時) 2021年12月3日	(償還価額) 20,759.02	4.1	3.9	—	—

\*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、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。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

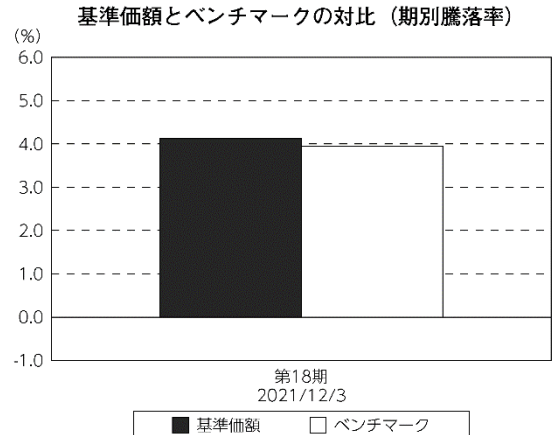
米ドル建て債券とユーロ建て債券に、約50%程度ずつの比率で投資しました。このためファンドの基準価額は、円／ドルと円／ユーロの為替レート、及び米欧債券市場の動向の影響を受けて推移しました。当期においては、保有していた債券のインカム収入や、円が米ドルやユーロに対して円安方向へ推移したことなどが基準価額のプラス要因となりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

- ・為替については、当期を通じ、ドルとユーロの通貨比率を50%程度ずつに維持しました。
- ・債券については、米欧の主要債券セクター（国債・政府機関債、資産担保証券、社債など）にバランスよく分散した投資を行ないました。
- ・11月に、償還対応のため、債券などを全売却しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

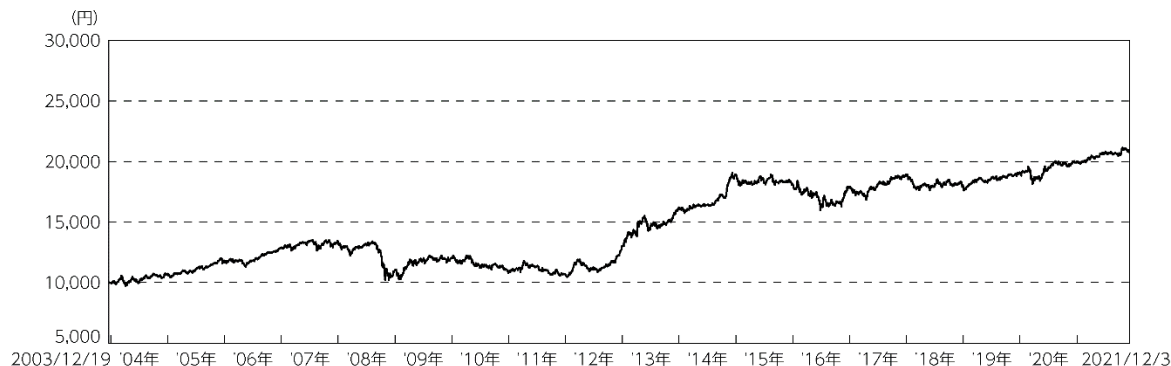
当期の基準価額の騰落率は+4.1%となり、ベンチマークの+3.9%を0.2%上回りました。



(注) ベンチマークは、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。

## ◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から償還時20,759.02円となりました。

#### 【第1期～第4期（2003年12月19日～2007年12月5日）】

- ・ 設定時から第4期にかけては、基準価額は上昇しました。
- ・ 保有していた債券の価格が上昇したことやインカム収入、また円がドルとユーロに対して円安方向へ推移したことなどが、基準価額へのプラス要因となりました。

#### 【第5期～第8期（2007年12月6日～2011年12月5日）】

- ・ 第5期から第8期にかけては、基準価額は下落しました。
- ・ 円がドルとユーロに対して円高方向へ推移したことなどが、基準価額へのマイナス要因となりました。

#### 【第9期～第12期（2011年12月6日～2015年12月7日）】

- ・ 第9期から第12期にかけては、基準価額は上昇しました。
- ・ 保有していた債券のインカム収入、また円がドルとユーロに対して円安方向へ推移したことなどが、基準価額へのプラス要因となりました。

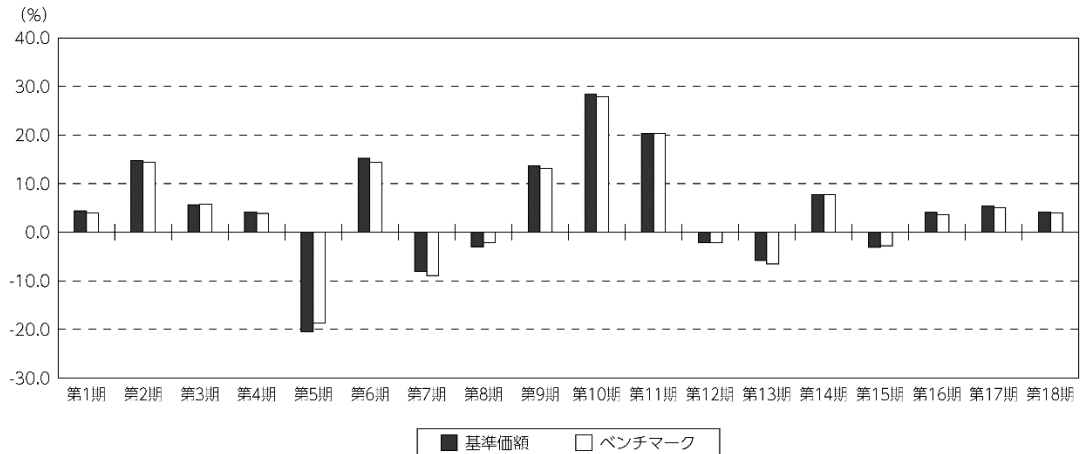
#### 【第13期～第18期（2015年12月8日～2021年12月3日）】

- ・ 第13期から第18期にかけては、基準価額は上昇しました。
- ・ 保有していた債券のインカム収入などが、基準価額へのプラス要因となりました。

## ○ベンチマークとの対比

設定来では、ベンチマークは+104.5%となったのに対し、基準価額の騰落率は+107.6%となりました。主なプラス要因は、保有銘柄の銘柄選択効果によるものでした。

<基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）>



(注) ベンチマークは、ブルームバーグ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。



## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月8日～2021年12月3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 1 (1)	% 0.007 (0.007)	(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
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	18 (15) (2)	0.086 (0.075) (0.011)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	19	0.093	
期中の平均基準価額は、20,493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12月8日～2021年12月3日)

## 公社債

		買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 8,047	千米ドル 9,618
		地方債証券	31	30
		特殊債券	43	1,389 ( 495)
		社債券 (投資法人債券を含む)	1,781	4,837 ( 127)
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
国	ドイツ	国債証券	2,086	2,180
		地方債証券	—	157
		特殊債券	20	135
		社債券 (投資法人債券を含む)	35	441 ( 50)
	イタリア	国債証券	912	1,136
		社債券 (投資法人債券を含む)	—	111
	フランス	国債証券	775	939
		特殊債券	—	41
		社債券 (投資法人債券を含む)	—	1,177
	イギリス	国債証券	—	101
		社債券 (投資法人債券を含む)	—	158
	オランダ	国債証券	10	15
		特殊債券	—	465 ( 20)
		社債券 (投資法人債券を含む)	—	532
	スペイン	国債証券	92	213
	ベルギー	国債証券	14	101
	スウェーデン	社債券 (投資法人債券を含む)	—	119
	オーストリア	国債証券	40	195
	ルクセンブルグ	特殊債券	—	45
	フィンランド	国債証券	—	101
	デンマーク	社債券 (投資法人債券を含む)	—	72
	アイルランド	国債証券	27	111
		社債券 (投資法人債券を含む)	—	10
	キプロス	国債証券	—	58
	ポルトガル	国債証券	—	15
	スロバキア	国債証券	—	12
	スロベニア	国債証券	—	782
	アメリカ	社債券 (投資法人債券を含む)	—	5
	ハンガリー	国債証券	—	21
	ポーランド	国債証券	—	49
	ルーマニア	国債証券	—	10
	リトアニア	国債証券	—	255
国際機関	特殊債券	20		

\*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。

\*( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*社債券 (投資法人債券を含む) には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれておりません。

## 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
外 国		百万円	百万円	百万円	百万円
	債券先物取引	3,022	3,340	1,656	1,981
	その他先物取引	112	112	1,829	1,877

\* 単位未満は切り捨て。

\* 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年12月8日～2021年12月3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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,160	百万円 4	% 0.1	百万円 4,827	百万円 -	% -

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2021年12月3日現在)

2021年12月3日現在、有価証券等の組入れはございません。

## ○投資信託財産の構成

(2021年12月3日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 1,317,839	% 100.0
投資信託財産総額	1,317,839	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2021年12月3日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	1,317,839,180
コール・ローン等	1,317,839,180
(B) 負債	4,297
未払利息	4,297
(C) 純資産総額(A－B)	1,317,834,883
元本	634,825,098
償還差益金	683,009,785
(D) 受益権総口数	634,825,098口
1万口当たり償還価額(C/D)	20,759円02銭

(注) 期首元本額は811,687,000円、期中追加設定元本額は922,017円、期中一部解約元本額は177,783,919円、1口当たり純資産額は2,075902円です。

(注) 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・米欧債券・インカムオープン 634,825,098円

## ○損益の状況 (2020年12月8日～2021年12月3日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	25,925,756
受取利息	26,148,573
その他収益金	61,603
支払利息	△ 284,420
(B) 有価証券売買損益	35,683,637
売買益	97,771,418
売買損	△ 62,087,781
(C) 先物取引等取引損益	3,107,646
取引益	18,730,006
取引損	△ 15,622,360
(D) 保管費用等	△ 1,317,767
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	63,399,272
(F) 前期繰越損益金	806,548,611
(G) 追加信託差損益金	977,983
(H) 解約差損益金	△187,916,081
償還差益金(E+F+G+H)	683,009,785

\* 損益の状況の中で(G)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(H)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。

## ○お知らせ

該当事項はございません。