

# 野村グローバル・ファンズ・プレミアム (3ヵ月決算型)

## 償還運用報告書(全体版)

第66期(決算日2023年4月17日) 第67期(償還日2023年7月18日)

作成対象期間(2023年1月18日～2023年7月18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/内外/資産複合
信託期間	2023年7月18日をもちまして繰上償還いたします。(設定日2006年8月25日)
運用方針	主として、国内・米国・欧州・新興国の株式・債券、ならびにハイ・イールド債の各資産を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資し、インカムゲインと中長期的な値上がり益の獲得によるトータル・リターンを追求を目指して運用を行ないます。投資する投資信託証券で、外国の株式もしくは外国の債券を実質的な投資対象とする投資信託証券については、実質的な外貨建資産について為替ヘッジを行わないことを基本とするもの、もしくはこれらに類するものに限定することを基本とします。
主な投資対象	主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
主な投資制限	投資信託証券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、原則として繰越分を含めた利子・配当等収益と売益等から、利子・配当等収益等の水準および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、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10期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			参考指数		投資信託 組入比率	純資産額
		税金	分配金	期中騰落率	期中騰落率	中率		
	円 銭	円	%		%	%	百万円	
58期(2021年4月19日)	11,345	300	7.2	183.51	5.5	90.8	2,681	
59期(2021年7月19日)	11,209	300	1.4	187.04	1.9	97.4	2,583	
60期(2021年10月18日)	11,278	200	2.4	192.55	2.9	96.6	2,528	
61期(2022年1月17日)	10,622	150	△4.5	193.00	0.2	97.1	2,334	
62期(2022年4月18日)	10,308	50	△2.5	192.49	△0.3	98.9	2,240	
63期(2022年7月19日)	9,914	0	△3.8	190.90	△0.8	96.7	2,126	
64期(2022年10月17日)	9,891	0	△0.2	189.57	△0.7	98.9	2,054	
65期(2023年1月17日)	9,657	0	△2.4	186.36	△1.7	98.0	1,979	
66期(2023年4月17日)	10,164	0	5.3	196.71	5.6	98.6	2,035	
(償還時)	(償還価額)							
67期(2023年7月18日)	11,142.61	-	9.6	210.35	6.9	-	2,044	

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

<p>* 参考指数は、下記の資産クラスもしくは債券種別等毎の代表的な指数を、基本投資割合をもとに、当社が独自に円換算した指数(円換算ベース)から合成したもので、設定時を100として指数化しております。</p> <p>なお、算出にあたっては、組入資産・為替の評価時点に合わせて計算しているため、各社が公表する数値とは異なります。</p> <p>【国内株式】 東証株価指数 (TOPIX) : 20%</p> <p>【米国株式】 S&amp;P500種株価指数 : 16%</p> <p>【欧州株式】 MSCI欧州株価指数 : 9%</p> <p>【新興国株式】 MSCIエマージング・マーケット・インデックス : 5%</p> <p>【国内債券】 NOMURA-BPI総合 : 10%</p> <p>【米国債券】 ブルームバーグ・米国総合インデックス : 18%</p> <p>【欧州債券】 ブルームバーグ・汎欧州総合インデックス : 17%</p> <p>【新興国債券】 JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル : 2%</p> <p>【ハイ・イールド債】 ICE BofA US High Yield Constrained Index : 3%</p> <p>・ 東証株価指数 (TOPIX) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) に係る標準又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数 (TOPIX) の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。</p> <p>・ S&amp;P500株価指数 (S&amp;P500種株価指数) は、スタンダード&amp;プアーズが公表している株価指数で、米国の主要500社によって構成されており、当該指数に関する一切の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&amp;プアーズ ファイナンシャル サービスズ エルエルシーに帰属しております。</p> <p>・ MSCI欧州株価指数およびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> <p>・ NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&amp;コンサルティング株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> <p>・ 「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・汎欧州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、野村グローバル・ファンズ・プレミアム (3ヵ月決算型) 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、野村グローバル・ファンズ・プレミアム (3ヵ月決算型) 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。</p> <p>・ JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル (J.P.Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Global) は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング・マーケット債を対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。</p> <p>・ ICE BofA US High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLCが算出する、米国のハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表す代表的な指数です。</p> <p>「ICE BofA US High Yield Constrained Index SM/®」は、ICE Data Indices, LLCまたはその関連会社 (「ICEデータ」) の登録商標です。当ファンドは、ICEデータによって支持・推奨・販売・販売促進されるものではなく、また、ICEデータは当ファンドに関して一切の責任を負いません。</p> <p>(出所) 株式会社 J P X 総研、スタンダード&amp;プアーズ、MSCI、為替レート (対顧客電信売買相場仲値)、J.P.Morgan Securities LLC、ブルームバーグ、FactSet</p> <p>(出所及び許可) ICE Data Indices, LLC</p>
--

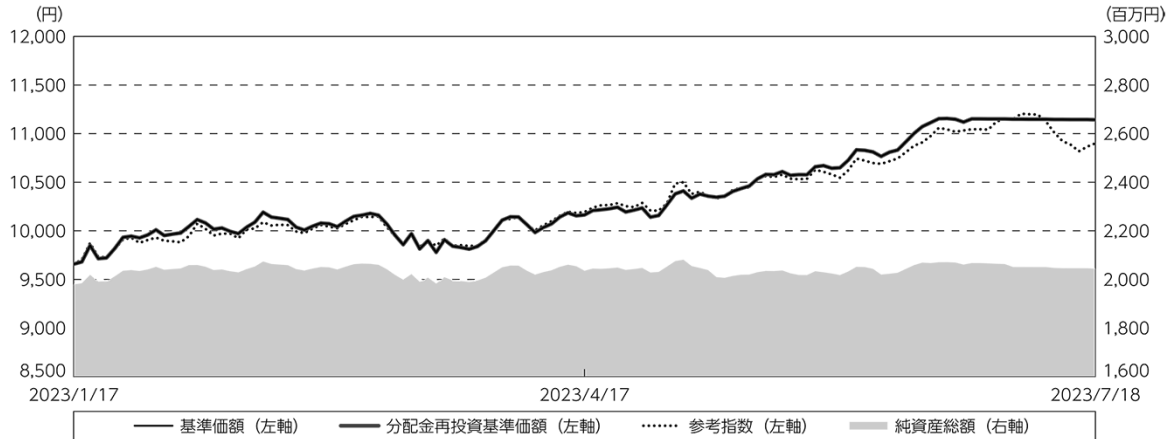
## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		投 資 信 託 証 入 比 率
		円 銭	騰 落 率		騰 落 率	
第66期	(期 首) 2023年 1月17日	9,657	—	186.36	—	98.0
	1月末	10,010	3.7	191.63	2.8	97.7
	2月末	10,047	4.0	193.41	3.8	97.7
	3月末	10,003	3.6	192.95	3.5	98.0
	(期 末) 2023年 4月17日	10,164	5.3	196.71	5.6	98.6
第67期	(期 首) 2023年 4月17日	10,164	—	196.71	—	98.6
	4月末	10,158	△0.1	196.97	0.1	98.6
	5月末	10,671	5.0	204.70	4.1	98.8
	6月末	11,151	9.7	215.15	9.4	17.2
	(償還時) 2023年 7月18日	(償還価額) 11,142.61	9.6	210.35	6.9	—

\*騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第 66 期 首： 9,657円

第67期末 (償還日)：11,142円61銭 (既払分配金 (税込み)：0円)

騰 落 率： 15.4% (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 (2023年1月17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) 参考指数は、各資産クラスもしくは債券種別等毎の代表的な指数を、基本投資割合をもとに、当社が独自に円換算した指数 (円換算ベース) から合成したものです。参考指数は、作成期首 (2023年1月17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

#### (上昇要因)

- ・米欧でインフレに対する過度な懸念が和らいだことや、米国の利上げ打ち止め期待が高まったこと

## ○指定投資信託証券の騰落率（分配金込み）

指定投資信託証券名	第66期	第67期	第66期～第67期
ストラテジック・バリュ・オープンF	7.8%	14.0%	22.9%
ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドFB	9.4%	27.6%	39.6%
MFS欧州株ファンドFB	8.4%	5.6%	14.5%
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅢ－新興国株式FD	－0.4%	9.7%	9.3%
ノムラ日本債券オープンF	2.3%	0.3%	2.6%
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国債券FD	3.3%	4.2%	7.6%
ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD	5.0%	6.7%	12.0%
野村エマージング債券ファンドFD	3.9%	5.9%	10.0%
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ－米国ハイ・イールド・ボンドFD	4.0%	6.5%	10.8%

（注）騰落率は当ファンドにおける指定投資信託証券の評価時点に合わせて計算（分配金を再投資して算出）を行なっております。

（注）当ファンドで投資をしていない期間についても騰落率の計算に含んでおります。

（注）当作成期間の途中で除外を行なった指定投資信託については、表から省略しております。

## ○投資環境

### ・国内株式

日銀による大規模な金融緩和策継続や相対的に底堅い景気動向などが好感されたことや、米著名投資家の日本株への追加投資検討の報道が好感されたことなどから上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

### ・米国株式

米欧でインフレに対する過度な懸念が和らいだことや、米国の利上げ打ち止め期待が高まったことなどから上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

### ・欧州株式

ECB（欧州中央銀行）の利上げ幅が市場予想通りであったことなどが好感された一方、スイスの大手金融グループの経営不安が広がったことなどから下落し、当作成期間では、概ね横ばいとなりました。

### ・新興国株式

RBI（インド準備銀行）が追加利上げを休止したことや、中国の景気回復期待などを背景に上昇する局面もありましたが、米中対立激化懸念が高まったことや中国の大手インターネット企業が価格競争激化への懸念から下落したことなどを背景に下落し、当作成期間では、概ね横ばいとなりました。

### ・国内債券

日銀が金融政策決定会合で緩和的な金融政策の維持を決定したことなどから上昇し、当作成期間で値上がりとなりました。

・ **米国債券**

FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め長期化観測は市場の下押し要因となる中、市場の一部による今後の景気後退懸念が市場の下支え要因となり、当作成期間で概ね横ばいとなりました。

・ **欧州債券**

複数のECB高官が更なる金融引き締めの必要性に言及したことなどから下落し、当作成期間では値下がりとなりました。

・ **新興国債券**

米国の利上げ見送り観測や中国政府による景気刺激策への期待などを背景に上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

・ **ハイ・イールド債**

FRBによる追加利上げ観測が後退したことを背景に上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

・ **為替市場**

**米ドル・ユーロ**

海外の中央銀行による金融引き締め継続と日銀の大規模な金融緩和策の維持が示されたことなどから、当作成期間では、米ドル、ユーロとも円に対して上昇（円安）となりました。（主要通貨のみについて記述しております。）

○ **当ファンドのポートフォリオ**

・ **投資信託証券組入比率**

資産配分アドバイザーからの助言に基づき、各指定投資信託証券の投資比率を決定しました。投資信託証券組入比率は、高水準の組入比率を保ちました。

・ **指定投資信託証券（投資対象ファンド）の見直し**

当作成期間においては、指定投資信託証券（投資対象ファンド）の見直しを行いませんでした。

繰上げ償還方針決定後、保有していた受益証券を全売却し、その後の償還日まで実質的に円預金を用いて運用を行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数の騰落率が+12.9%となったのに対して、基準価額の騰落率は+15.4%となりました。

### 【主な差異要因】

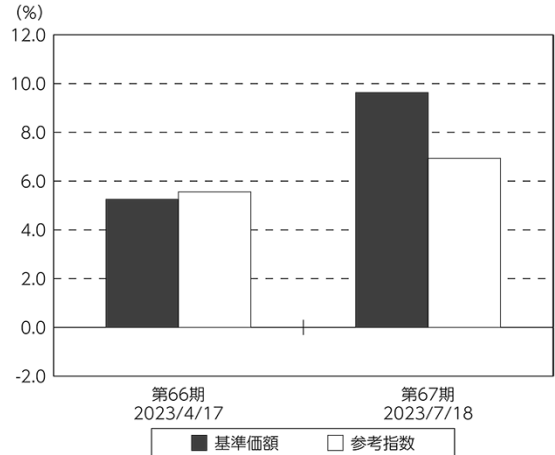
#### (プラス要因)

- ・米国株式などの運用において、ファンドの収益率が各資産クラスの市場指数を上回ったこと

#### (マイナス要因)

- ・米国債券などの運用において、ファンドの収益率が各資産クラスの市場指数を下回ったこと

基準価額と参考指数の対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、各資産クラスもしくは債券種別等毎の代表的な指数を、基本投資割合をもとに、当社が独自に円換算した指数(円換算ベース)から合成したものです。

## ◎分配金

収益分配金は、経費控除後の利子・配当等収益と売買益等から基準価額水準も勘案して決定いたしました。

なお、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した。第67期は償還のため、分配金をお支払いしておりません。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第66期
	2023年1月18日～ 2023年4月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,229

(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、設定時の10,000円が償還時11,142.61円となりました。  
設定来お支払した分配金は1万口当たり4,050円となりました。

#### 第1期（2006年8月25日～2007年1月17日）

（上昇要因）新興国株式や米国株式などが値上がりしたこと

#### 第2期、第3期（2007年1月18日～2007年7月17日）

（上昇要因）新興国株式や米国株式などが値上がりしたこと

#### 第4期、第5期（2007年7月18日～2008年1月17日）

（下落要因）国内株式に加え、欧州株式や米国株式が値下がりしたこと

#### 第6期、第7期（2008年1月18日～2008年7月17日）

（下落要因）欧州株式や新興国株式などが値下がりしたこと

#### 第8期、第9期（2008年7月18日～2009年1月19日）

（下落要因）新興国株式や国内株式を中心に、全ての株式が大きく値下がりしたこと

#### 第10期、第11期（2009年1月20日～2009年7月17日）

（上昇要因）新興国株式や米国株式、ハイ・イールド債などが値上がりしたこと



**第12期、第13期 (2009年7月18日～2010年1月18日)**

(上昇要因) 新興国株式や欧州株式などが値上がりしたこと

**第14期、第15期 (2010年1月19日～2010年7月20日)**

(上昇要因) 新興国債券や米国債券などが値上がりしたこと

(下落要因) 国内株式や欧州株式などが値下がりしたこと

**第16期、第17期 (2010年7月21日～2011年1月17日)**

(上昇要因) 米国株式や新興国株式を中心に、全ての株式が値上がりしたこと

**第18期、第19期 (2011年1月18日～2011年7月19日)**

(上昇要因) ハイ・イールド債や米国債券などが値上がりしたこと

(下落要因) 国内株式や欧州株式、新興国株式などが値下がりしたこと

**第20期、第21期 (2011年7月20日～2012年1月17日)**

(下落要因) 国内株式を中心に、全ての株式が値下がりしたこと

**第22期、第23期 (2012年1月18日～2012年7月17日)**

(上昇要因) ハイ・イールド債を中心に、全ての債券が値上がりしたこと

(下落要因) 新興国株式や欧州株式が値下がりしたこと

**第24期、第25期 (2012年7月18日～2013年1月17日)**

(上昇要因) 国内株式を中心に、全ての株式が値上がりしたこと

ハイ・イールド債を中心に、全ての債券が値上がりしたこと

**第26期、第27期 (2013年1月18日～2013年7月17日)**

(上昇要因) 国内株式や米国株式、ハイ・イールド債などが値上がりしたこと

**第28期、第29期 (2013年7月18日～2014年1月17日)**

(上昇要因) 米国株式や欧州株式などが値上がりしたこと

**第30期、第31期 (2014年1月18日～2014年7月17日)**

(上昇要因) 米国株式や新興国株式、新興国債券などが値上がりしたこと

**第32期、第33期 (2014年7月18日～2015年1月19日)**

(上昇要因) 国内株式や欧州債券などが値上がりしたこと

**第34期、第35期 (2015年1月20日～2015年7月17日)**

(上昇要因) 国内株式や米国株式、欧州株式などが値上がりしたこと

**第36期、第37期 (2015年7月18日～2016年1月18日)**

(下落要因) 米国株式や新興国株式、欧州株式などが値下がりしたこと

**第38期、第39期 (2016年1月19日～2016年7月19日)**

(下落要因) 国内株式や欧州株式などが値下がりしたこと

**第40期、第41期 (2016年7月20日～2017年1月17日)**

(上昇要因) 国内株式や米国株式、新興国株式などが値上がりしたこと

**第42期、第43期 (2017年1月18日～2017年7月18日)**

(上昇要因) 新興国株式や欧州株など全ての株式が値上がりしたこと

**第44期、第45期 (2017年7月19日～2018年1月17日)**

(上昇要因) 国内株式や新興国株式など全ての株式が値上がりしたこと

**第46期、第47期 (2018年1月18日～2018年7月17日)**

(下落要因) 国内株式や新興国株式などが値下がりしたこと

**第48期、第49期 (2018年7月18日～2019年1月17日)**

(下落要因) 国内株式や米国株式、欧州株式などが値下がりしたこと

**第50期、第51期 (2019年1月18日～2019年7月17日)**

(上昇要因) 米国株式や欧州株式、新興国債券などが値上がりしたこと

**第52期、第53期 (2019年7月18日～2020年1月17日)**

(上昇要因) 米国株式や欧州株式、新興国株式などが値上がりしたこと

**第54期、第55期 (2020年1月18日～2020年7月17日)**

(下落要因) 国内株式や新興国株式などが値下がりしたこと

**第56期、第57期 (2020年7月18日～2021年1月18日)**

(上昇要因) 国内株式や米国株式、新興国株式などが値上がりしたこと

**第58期、第59期（2021年1月19日～2021年7月19日）**

（上昇要因）国内株式や米国株式、欧州株式などが値上がりしたこと

**第60期、第61期（2021年7月20日～2022年1月17日）**

（下落要因）米国株式、新興国株式などが値下がりしたこと

**第62期、第63期（2022年1月18日～2022年7月19日）**

（下落要因）米国株式、欧州株式、新興国株式などが値下がりしたこと

**第64期、第65期（2022年7月20日～2023年1月17日）**

（下落要因）米国債券、米国株式などが値下がりしたこと

**第66期、第67期（2023年1月18日～2023年7月18日）**

（上昇要因）国内株式、米国株式などが値上がりしたこと

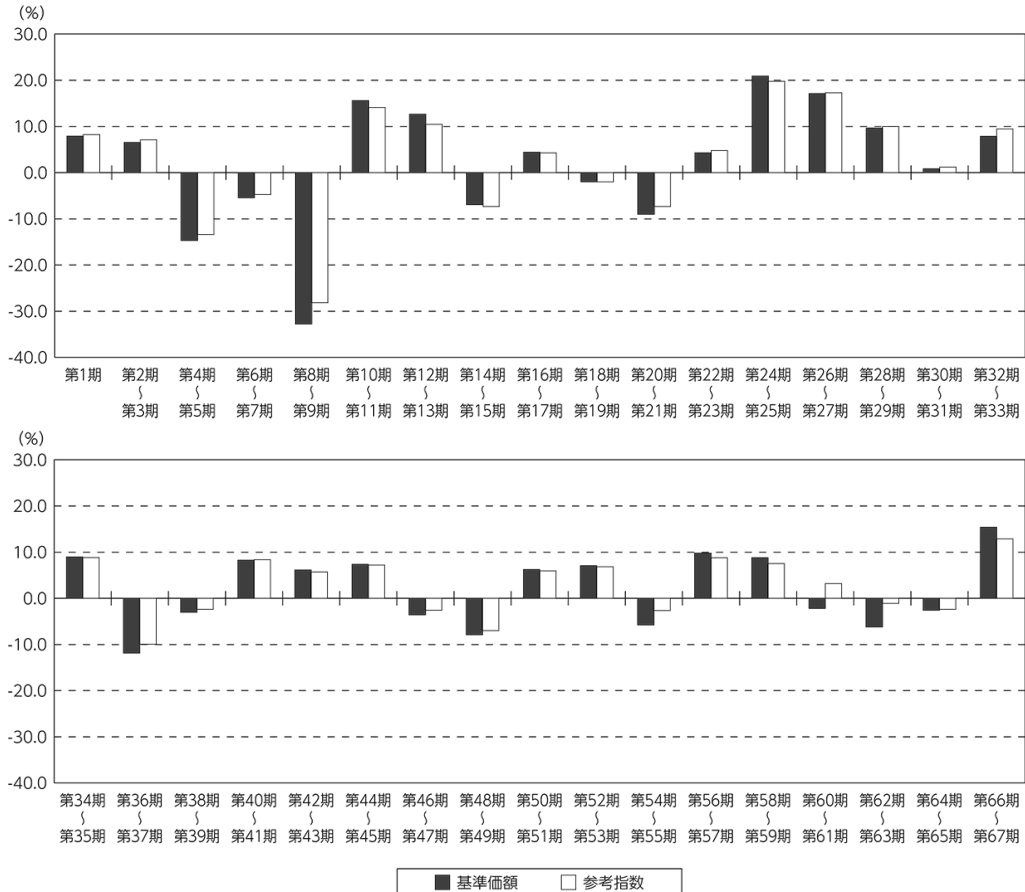
当ファンドは、2023年7月18日をもちまして繰上償還となりました。皆様のご愛顧に心より御礼を申し上げます。

## ○参考指数との対比

設定来では、参考指数の110.3%の上昇に対し、基準価額の騰落率は、66.9%※の上昇になりました。

※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。

＜基準価額と参考指数の対比（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) 参考指数は、各資産クラスもしくは債券種別等毎の代表的な指数を、基本投資割合をもとに、当社が独自に円換算した指数（円換算ベース）から合成したものです。

(注) 騰落率は作成期毎に算出しております。

### ※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年1月18日～2023年7月18日)

項 目	第66期～第67期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 68	% 0.658	(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 )	(34)	(0.329)	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 )	(31)	(0.302)	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 )	( 3 )	(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) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) 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
( 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	68	0.660	
作成期間の平均基準価額は、10,340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。

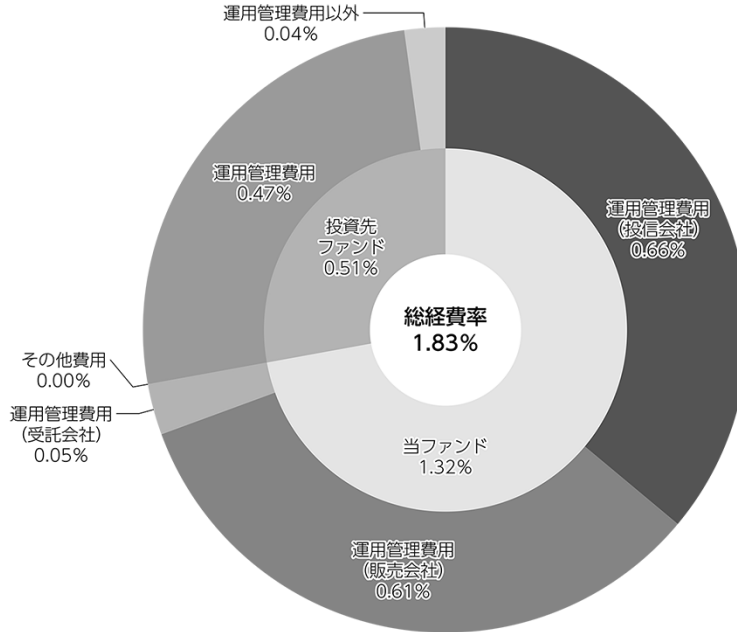
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 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1.83%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	1.83
①当ファンドの費用の比率	1.32
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.47
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04

(注) 当ファンドの費用は1万円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) 当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。

(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

(2023年1月18日～2023年7月18日)

## 投資信託証券

銘柄		第66期～第67期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ日本債券オープンF	101	1,334	15,111	202,447
	MFS欧州株ファンドFB	2,277	45,631	10,012	221,797
	野村エマージング債券ファンドFD	3,484	42,287	6,851	88,198
	ストラテジック・バリュー・オープンF	—	—	20,182	504,389
	ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD	—	—	1,785	20,640
	ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドFB	5,762	37,398	(29,085)	(354,966)
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ-米国ハイ・イールド・ボンドFD	135	1,703	4,832	394,831
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅢ-新興国株式FD	56	1,298	5,455	62,030
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅡ-米国債券FD	2,845	42,095	27,441	133,564	
合 計	14,660	171,749	150,550	2,050,929	
			(29,085)	(354,966)	

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年1月18日～2023年7月18日)

## 利害関係人との取引状況

区分	第66期～第67期					
	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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 171	百万円 126	% 73.7	百万円 2,050	百万円 1,432	% 69.9

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2023年7月18日現在)

2023年7月18日現在、有価証券等の組入れはございません。

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第65期末	
		口	数
			口
ノムラ日本債券オープンF			15,010
MFS欧州株ファンドFB			7,735
野村エマージング債券ファンドFD			3,367
ストラテジック・バリュー・オープンF			20,182
ノムラーインサイト欧州債券ファンドFD			30,870
ベイリー・ギフォード米国成長株ファンドFB			53,119
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII-米国ハイ・イールド・ボンドFD			4,697
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドIII-新興国株式FD			5,399
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドII-米国債券FD			24,596
合	計		164,975

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○投資信託財産の構成

(2023年7月18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	2,052,211	100.0
	投資信託財産総額	2,052,211	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66期末	償 還 時
	2023年4月17日現在	2023年7月18日現在
	円	円
(A) 資産	2,062,725,736	2,052,211,209
コール・ローン等	41,337,212	2,052,211,209
投資信託受益証券(評価額)	2,007,392,178	-
未収入金	13,996,346	-
(B) 負債	27,200,052	8,181,618
未払解約金	20,566,734	1,287,579
未払信託報酬	6,616,794	6,874,393
未払利息	13	2,491
その他未払費用	16,511	17,155
(C) 純資産総額(A-B)	2,035,525,684	2,044,029,591
元本	2,002,629,617	1,834,425,624
次期繰越損益金	32,896,067	-
償還差益金	-	209,603,967
(D) 受益権総口数	2,002,629,617口	1,834,425,624口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,164円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	11,142円61銭

(注) 第66期首元本額は2,049,554,708円、第66～67期中追加設定元本額は0円、第66～67期中一部解約元本額は215,129,084円、1口当たり純資産額は、第66期1.0164円、第67期1.114261円です。

## ○損益の状況

項 目	第66期	第67期
	2023年1月18日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年7月18日
	円	円
(A) 配当等収益	5,202,588	3,986,032
受取配当金	5,204,356	4,032,761
受取利息	32	-
支払利息	△ 1,800	△ 46,729
(B) 有価証券売買損益	102,924,088	182,376,424
売買益	105,453,748	188,376,953
売買損	△ 2,529,660	△ 6,000,529
(C) 信託報酬等	△ 6,633,305	△ 6,891,548
(D) 当期損益金(A+B+C)	101,493,371	179,470,908
(E) 前期繰越損益金	△ 62,993,869	35,265,851
(F) 追加信託差損益金	△ 5,603,435	△ 5,132,792
(配当等相当額)	( 20,359,780)	( 18,649,721)
(売買損益相当額)	(△ 25,963,215)	(△ 23,782,513)
(G) 計(D+E+F)	32,896,067	-
(H) 収益分配金	0	-
次期繰越損益金(G+H)	32,896,067	-
償還差益金(D+E+F)	-	209,603,967
追加信託差損益金	△ 5,603,435	-
(配当等相当額)	( 20,359,780)	( -)
(売買損益相当額)	(△ 25,963,215)	( -)
分配準備積立金	225,782,750	-
繰越損益金	△187,283,248	-

\* 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(2023年1月18日～2023年4月17日)は以下の通りです。

項 目	第66期
	2023年1月18日～ 2023年4月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,883,526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	20,359,780円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	220,899,224円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	246,142,530円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,229円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	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	2006年8月25日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年7月18日			資産総額	2,052,211,209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	8,181,618円	
受益権口数	3,861,922,103口	1,834,425,624口	△2,027,496,479口	純資産総額	2,044,029,591円	
元本額	3,861,922,103円	1,834,425,624円	△2,027,496,479円	受益権口数	1,834,425,624口	
				1万円当たり償還金	11,142円61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28期	9,774,966,387円	8,601,245,417円	8,799円	0円	0.0%	
第29期	8,835,028,335	8,381,631,588	9,487	0	0.0	
第30期	8,334,470,210	7,715,509,588	9,257	0	0.0	
第31期	7,795,137,282	7,455,732,033	9,565	0	0.0	
第32期	7,149,692,014	6,667,677,921	9,326	0	0.0	
第33期	6,332,749,447	6,501,666,428	10,267	50	0.5	
第34期	5,855,216,917	6,327,796,403	10,807	150	1.5	
第35期	5,412,633,839	5,889,903,747	10,882	150	1.5	
第36期	5,181,720,179	5,299,099,079	10,227	50	0.5	
第37期	4,880,806,275	4,657,719,022	9,543	0	0.0	
第38期	4,751,543,334	4,475,675,617	9,419	0	0.0	
第39期	4,566,165,591	4,226,988,326	9,257	0	0.0	
第40期	4,375,424,079	4,020,314,880	9,188	0	0.0	
第41期	4,061,159,303	4,066,295,280	10,013	10	0.1	
第42期	3,850,563,494	3,763,444,612	9,774	0	0.0	
第43期	3,596,862,898	3,786,630,809	10,528	100	1.0	
第44期	3,456,711,100	3,685,515,644	10,662	150	1.5	
第45期	3,239,402,095	3,546,361,686	10,948	200	2.0	
第46期	3,180,870,065	3,285,256,628	10,328	50	0.5	
第47期	3,079,810,319	3,219,573,078	10,454	50	0.5	
第48期	2,978,690,113	3,014,508,188	10,120	0	0.0	
第49期	2,901,845,145	2,794,811,052	9,631	0	0.0	
第50期	2,875,476,968	2,975,181,512	10,347	50	0.5	
第51期	2,799,633,496	2,850,700,662	10,182	0	0.0	
第52期	2,712,277,085	2,807,704,742	10,352	0	0.0	
第53期	2,622,068,846	2,818,842,578	10,750	150	1.5	
第54期	2,569,407,393	2,400,484,744	9,343	0	0.0	
第55期	2,535,431,014	2,566,198,274	10,121	10	0.1	
第56期	2,474,694,639	2,546,827,073	10,291	50	0.5	
第57期	2,412,808,064	2,619,745,028	10,858	200	2.0	
第58期	2,363,323,493	2,681,306,880	11,345	300	3.0	
第59期	2,304,641,746	2,583,365,056	11,209	300	3.0	

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60期	2,242,470,883円	2,528,983,635円	11,278円	200円	2.0%
第61期	2,198,193,516	2,334,931,122	10,622	150	1.5
第62期	2,173,254,711	2,240,209,784	10,308	50	0.5
第63期	2,144,857,876	2,126,496,930	9,914	0	0.0
第64期	2,076,877,979	2,054,299,774	9,891	0	0.0
第65期	2,049,554,708	1,979,350,046	9,657	0	0.0
第66期	2,002,629,617	2,035,525,684	10,164	0	0.0

## ○分配金のお知らせ

	第66期
1 万口当たり分配金 (税込み)	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)	11,142円61銭

## ○お知らせ

該当事項はございません。