

トヨタグループ世界債券ファンド (年2回分配型)

運用報告書(全体版)

第19期(決算日2016年12月20日)

作成対象期間(2016年6月21日~2016年12月20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/内外/債券	
信託期間	2007年7月6日から2022年6月20日(当初、2017年6月20日)までです。	
運用方針	トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、主として国内外のトヨタグループ企業*が発行する債券(MTN(ミディアム・ターム・ノート)、普通社債等)に実質的に投資し、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。 ※トヨタグループ企業とは、トヨタ自動車株式会社の、国内外の連結子会社および持分法適用関連会社をいいます。	
主な投資対象	トヨタグループ世界債券ファンド(年2回分配型)	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	国内外のトヨタグループ企業が発行する債券を主要投資対象とします。
主な投資制限	トヨタグループ世界債券ファンド(年2回分配型)	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建て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、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(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、特に制限を設けず、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			参考指数		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税金	み騰	期騰	中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
15期(2014年12月22日)	11,739	50	10.5	130.57	10.6	97.0	—	6,446
16期(2015年6月22日)	11,695	50	0.1	131.79	0.9	97.7	—	5,925
17期(2015年12月21日)	10,844	50	△6.8	123.62	△6.2	97.2	—	5,582
18期(2016年6月20日)	9,850	50	△8.7	112.23	△9.2	98.1	—	5,193
19期(2016年12月20日)	10,187	50	3.9	117.13	4.4	97.7	—	5,523

* 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。

* 参考指数は、シティ世界国債インデックスのうち、アメリカ、EMU圏、イギリス、オーストラリア、カナダの5つの国または地域の残存期間別インデックス（3-5年）を20%ずつ合成した指数をベースに、基準価額への反映を考慮し、前営業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たものです。なお、設定日の応当日を100として指数化しています。

* シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債券組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2016年6月20日	9,850	—	112.23	—	98.1	—
6月末	9,499	△3.6	108.45	△3.4	97.5	—
7月末	9,604	△2.5	109.49	△2.4	98.5	—
8月末	9,497	△3.6	108.30	△3.5	98.2	—
9月末	9,335	△5.2	106.40	△5.2	98.0	—
10月末	9,422	△4.3	107.26	△4.4	98.1	—
11月末	9,971	1.2	113.94	1.5	98.5	—
(期末) 2016年12月20日	10,237	3.9	117.13	4.4	97.7	—

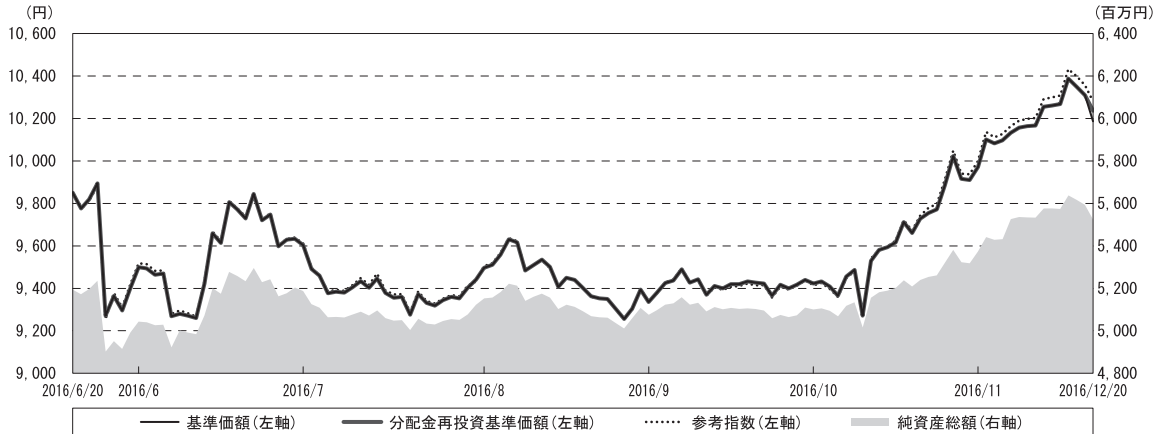
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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：9,850円

期 末：10,187円(既払分配金(税込み)：50円)

騰落率： 3.9%(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(2016年6月20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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、シティ世界国債インデックスのうち、アメリカ、EMU圏、イギリス、オーストラリア、カナダの5つの国または地域の残存期間別インデックス(3-5年)を20%ずつ合成した指数をベースに、基準価額への反映を考慮し、前営業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たものです。作成期首(2016年6月20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)・保有する債券からの利息収入。

(上昇要因)・投資通貨である米ドルやユーロ、カナダドル、豪ドルが対円で上昇したこと。

(下落要因)・保有する債券の価格が下落したこと。

(下落要因)・投資通貨である英ポンドが対円で下落したこと。

○投資環境

通貨については、米大統領選挙においてトランプ氏が勝利したことで、トランプ氏の政策に対する期待から市場のリスク選好の動きが強まったことから、米ドルは円に対して上昇しました。また、12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが決定されたことも米ドルの上昇要因となりました。トランプ氏の政策への期待やOPEC（石油輸出国機構）が減産で合意したことなどを背景にユーロやカナダドル、豪ドルも対円で上昇となりました。英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票で離脱派が多数となったことを受けて英ポンドは対円で下落となりました。

債券については、トランプ氏の拡張的な財政政策やインフレ率の上昇が警戒されたことなどを背景に米国国債の利回りは上昇しました。また、FOMCが利上げを決定し、今後の利上げペースの見通しも引き上げられたことも、債券利回りの上昇要因となりました。保有するトヨタグループ企業の債券については、株式市場が上昇するなかで対国債スプレッド（利回り格差）は安定的に推移し、一部の銘柄では対国債スプレッドは前期末から縮小となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド]

組み入れ通貨について

設定時において選定した5カ国の通貨に原則として均等投資いたしました。

組み入れ債券の資産配分について

追加的な資金の流出入に応じてトヨタグループ企業の債券を売買し、債券組入比率を高位に維持しながら、ポートフォリオの債券はすべてトヨタグループ企業の債券としました。

組み入れ債券の信用格付け配分について

期を通じてAA格以上の格付けを持つ債券のみを保有しました。

[トヨタグループ世界債券ファンド（年2回分配型）]

追加的な資金の流出入に応じて、主要投資対象であるトヨタグループ世界債券ファンド マザーファンドの組入を高位に維持し、トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンドの投資成果を享受するよう努めました。

○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。

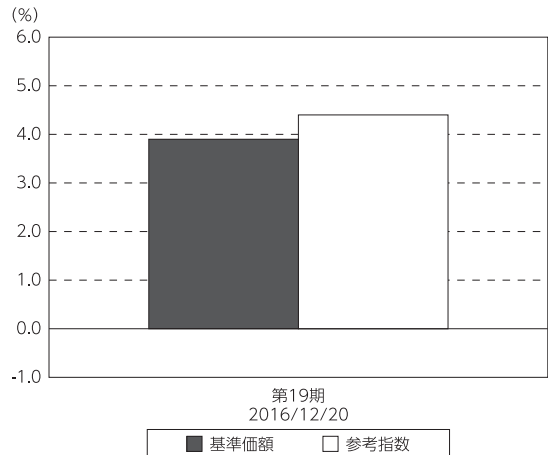
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数が4.37%の上昇となったのに対し、基準価額は3.93%*上昇しました。

* 基準価額の騰落率は、期末の分配金（税込み）を考慮して算出したものです。

差異の要因については、信託報酬等の効果がマイナスに寄与しました。

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、シティ世界国債インデックスのうち、アメリカ、EMU圏、イギリス、オーストラリア、カナダの5つの国または地域の残存期間別インデックス（3～5年）を20%ずつ合成した指数をベースに、基準価額への反映を考慮し、前営業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たものです。

○分配金

分配金については、基準価額水準等を勘案し、期末に1万口当たり50円を分配いたしました。

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す。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第19期
	2016年6月21日～ 2016年12月20日
当期分配金	50
(対基準価額比率)	0.488%
当期の収益	50
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,842

(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

[トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド]

引き続きトヨタグループ企業の債券を中心としたポートフォリオ構成とします。投資にあたっては、発行体の信用状況や同一通貨建ての国債とのスプレッド等を考慮します。また、流動性リスクに配慮し、ポートフォリオの一部に国債を組み入れる場合があります。

組入れ通貨については、設定時に選定した5カ国の通貨（米ドル、ユーロ、英ポンド、カナダドル、豪ドル）に均等投資します。通貨比率の調整のために為替予約取引を活用します。

ポートフォリオ全体のデュレーションは3～5年程度を維持します。デュレーション調整のために、債券先物を利用する場合があります。

[トヨタグループ世界債券ファンド（年2回分配型）]

主要投資対象であるトヨタグループ世界債券ファンド マザーファンドの高位組入比率を維持し、トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンドの投資成果を享受するよう努めます。

今後とも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

(2016年6月21日～2016年12月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 51	% 0.531	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(23)	(0.244)	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 ）	(26)	(0.271)	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)	(0.016)	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	1	0.006	(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 ）	(0)	(0.005)	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)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	52	0.537	
期中の平均基準価額は、9,554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

(2016年6月21日～2016年12月20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
トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド	千口 216,009	千円 250,500	千口 130,634	千円 156,700

* 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年6月21日～2016年12月20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

(2016年12月20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
トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド	千口 4,342,548	千口 4,427,923	千円 5,514,535

*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

(2016年12月20日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド	千円 5,514,535	% 98.8
コール・ローン等、その他	69,110	1.2
投資信託財産総額	5,583,645	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（7,887,059千円）の投資信託財産総額（8,002,366千円）に対する比率は98.6%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=117.18円、1カナダドル=87.45円、1英ポンド=145.35円、1ユーロ=121.98円、1豪ドル=85.03円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年12月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,583,645,163
コール・ローン等	4,309,192
トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド(評価額)	5,514,535,971
未収入金	64,800,000
(B) 負債	59,944,428
未払収益分配金	27,111,505
未払解約金	5,446,613
未払信託報酬	27,330,583
未払利息	5
その他未払費用	55,722
(C) 純資産総額(A-B)	5,523,700,735
元本	5,422,301,143
次期繰越損益金	101,399,592
(D) 受益権総口数	5,422,301,143口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,187円

(注) 期首元本額は5,272,896,922円、期中追加設定元本額は380,165,345円、期中一部解約元本額は230,761,124円、1口当たり純資産額は1.0187円です。

○損益の状況（2016年6月21日～2016年12月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 5,056
支払利息	△ 5,056
(B) 有価証券売買損益	246,789,545
売買益	251,983,189
売買損	△ 5,193,644
(C) 信託報酬等	△ 27,386,305
(D) 当期損益金(A+B+C)	219,398,184
(E) 前期繰越損益金	69,213,565
(F) 追加信託差損益金	△ 160,100,652
(配当等相当額)	(441,571,284)
(売買損益相当額)	(△ 601,671,936)
(G) 計(D+E+F)	128,511,097
(H) 収益分配金	△ 27,111,505
次期繰越損益金(G+H)	101,399,592
追加信託差損益金	△ 160,100,652
(配当等相当額)	(442,016,554)
(売買損益相当額)	(△ 602,117,206)
分配準備積立金	1,099,030,100
繰越損益金	△ 837,529,856

* 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（2016年6月21日～2016年12月20日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月21日～ 2016年12月20日
a. 配当等収益(経費控除後)	68,437,434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	442,016,554円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,057,704,171円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,568,158,159円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	2,892円
g. 分配金	27,111,505円
h. 分配金(1万円当たり)	50円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	50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。

○お知らせ

該当事項はございません。

トヨタグループ世界債券ファンド マザーファンド

運用報告書

第10期（決算日2016年12月20日）

作成対象期間（2015年12月22日～2016年12月20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	主として国内外のトヨタグループ企業*が発行する債券（MTN（ミディアム・ターム・ノート）、普通社債等）に投資し、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。投資を行う債券は、原則としてA格以上の格付けを有する信用度の高いものとします。（格付けのない場合には、委託者が同等の信用度を有すると判断したものを含みます。） ※トヨタグループ企業とは、トヨタ自動車株式会社、国内外の連結子会社および持分法適用関連会社をいいます。
主な投資対象	国内外のトヨタグループ企業が発行する債券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		参考指数	債券先物比率		純資産額
	騰落率	中率		組入比率	券率	
6期(2012年12月20日)	円 10,119	% 17.7	97.02	% 15.1	% 96.6	百万円 9,899
7期(2013年12月20日)	12,198	20.5	116.66	20.2	91.7	8,114
8期(2014年12月22日)	13,810	13.2	130.57	11.9	97.3	8,110
9期(2015年12月21日)	12,997	△ 5.9	123.62	△ 5.3	97.6	8,036
10期(2016年12月20日)	12,454	△ 4.2	117.13	△ 5.3	97.8	7,907

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*参考指数は、シティ世界国債インデックスのうち、アメリカ、EMU圏、イギリス、オーストラリア、カナダの5つの国または地域の残存期間別インデックス（3-5年）を20%ずつ合成した指数をベースに、基準価額への反映を考慮し、前営業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たものです。なお、設定日の応当日を100として指数化しています。
*シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

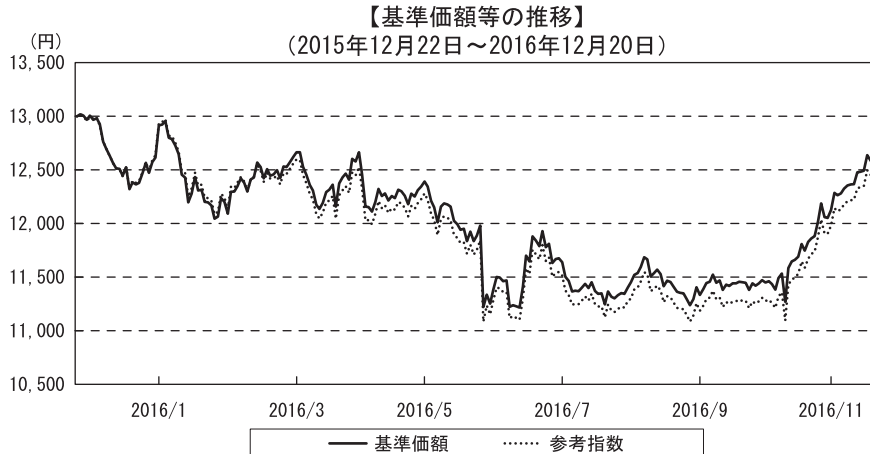
年月日	基準価額		参考指数	債券先物比率	
	騰落率	率		組入比率	券率
(期首) 2015年12月21日	円 12,997	% -	123.62	% -	% 97.6
12月末	12,979	△ 0.1	123.52	△ 0.1	97.3
2016年1月末	12,914	△ 0.6	123.02	△ 0.5	98.4
2月末	12,202	△ 6.1	116.41	△ 5.8	98.1
3月末	12,662	△ 2.6	119.80	△ 3.1	98.6
4月末	12,454	△ 4.2	117.19	△ 5.2	98.2
5月末	12,390	△ 4.7	116.79	△ 5.5	98.1
6月末	11,501	△ 11.5	108.45	△ 12.3	98.3
7月末	11,638	△ 10.5	109.49	△ 11.4	98.6
8月末	11,519	△ 11.4	108.30	△ 12.4	98.3
9月末	11,333	△ 12.8	106.40	△ 13.9	98.2
10月末	11,449	△ 11.9	107.26	△ 13.2	98.2
11月末	12,125	△ 6.7	113.94	△ 7.8	98.4
(期末) 2016年12月20日	12,454	△ 4.2	117.13	△ 5.3	97.8

*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) 参考指数は、シティ世界国債インデックスのうち、アメリカ、EMU圏、イギリス、オーストラリア、カナダの5つの国または地域の残存期間別インデックス(3-5年)を20%ずつ合成した指数をベースに、基準価額への反映を考慮し、前営業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たものです。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12,997円から期末12,454円となりました。

(上昇要因)・保有する債券からの利息収入。

(上昇要因)・投資通貨であるカナダドルが対円で上昇したこと。

(下落要因)・投資通貨である米ドルやユーロ、英ポンド、豪ドルが対円で下落したこと。

○当ファンドのポートフォリオ 組み入れ通貨について

設定時において選定した5カ国の通貨に原則として均等投資いたしました。

組み入れ債券の資産配分について

追加的な資金の流出入に応じてトヨタグループ企業の債券を売買し、債券組入比率を高位に維持しながら、ポートフォリオの債券はすべてトヨタグループ企業の債券としました。

組み入れ債券の信用格付け配分について

期を通じてAA格以上の格付けを持つ債券のみを保有しました。

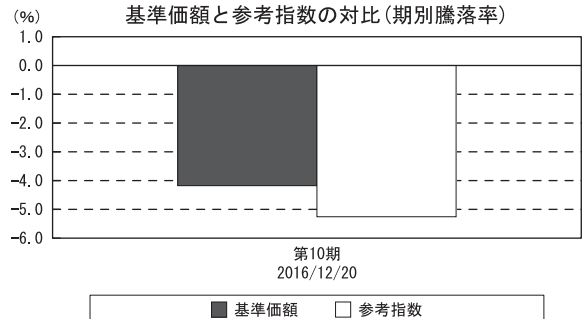
○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

参考指数が5.3%の下落となったのに対し、基準価額は4.2%下落しました。

差異の要因については、保有する一部の債券の対国債スプレッドが縮小したことがプラスに寄与しました。



(注) 参考指数は、シティ世界国債インデックスのうち、アメリカ、EMU圏、イギリス、オーストラリア、カナダの5つの国または地域の残存期間別インデックス(3-5年)を20%ずつ合成した指数をベースに、基準価額への反映を考慮し、前営業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たものです。

◎今後の運用方針

引き続きトヨタグループ企業の債券を中心としたポートフォリオ構成とします。投資にあたっては、発行体の信用状況や同一通貨建ての国債とのスプレッド等を考慮します。また、流動性リスクに配慮し、ポートフォリオの一部に国債を組み入れる場合があります。

組入れ通貨については、設定時に選定した5カ国の通貨(米ドル、ユーロ、英ポンド、カナダドル、豪ドル)に均等投資します。通貨比率の調整のために為替予約取引を活用します。

ポートフォリオ全体のデュレーションは3~5年程度を維持します。デュレーション調整のために、債券先物を利用する場合があります。

今後とも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

(2015年12月22日～2016年12月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 1	% 0.010	(a)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 ）	(1)	(0.010)	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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	1	0.010	
期中の平均基準価額は、12,097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

(2015年12月22日～2016年12月20日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券（投資法人債券を含む）	千米ドル 7,986	千米ドル 2,518
	カナダ	社債券（投資法人債券を含む）	千カナダドル 10,134	千カナダドル 11,204
	イギリス	社債券（投資法人債券を含む）	千英ポンド 4,907	千英ポンド 4,984
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	アメリカ	社債券（投資法人債券を含む）	639	638
	オーストラリア	社債券（投資法人債券を含む）	千豪ドル 6,019	千豪ドル 6,741

*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。

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年12月22日～2016年12月20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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			B A			D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	11,323	260	2.3	11,339	298	2.6
為替直物取引	1,179	207	17.6	961	161	16.8

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

(2016年12月20日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	17,400	18,102	2,121,275	26.8	—	13.2	13.6	—
カナダ	千カナダドル 16,200	千カナダドル 16,295	1,425,011	18.0	—	—	18.0	—
イギリス	千英ポンド 9,700	千英ポンド 9,761	1,418,881	17.9	—	9.0	—	8.9
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
アメリカ	9,200	10,179	1,241,698	15.7	—	13.7	2.0	—
オーストラリア	千豪ドル 17,700	千豪ドル 17,964	1,527,497	19.3	—	—	19.3	—
合 計	—	—	7,734,364	97.8	—	36.0	52.9	8.9

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 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。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	4.5	3,000	3,213	376,584	2020/6/17
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	4.25	1,700	1,813	212,529	2021/1/11
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	3.4	4,000	4,136	484,738	2021/9/15
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	3.3	8,700	8,938	1,047,423	2022/1/12
小計					2,121,275	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
普通社債券 (含む投資法人債券)	TOYOTA CREDIT CANADA INC	2.25	1,700	1,725	150,851	2019/5/23
	TOYOTA CREDIT CANADA INC	2.05	5,500	5,525	483,245	2020/5/20
	TOYOTA CREDIT CANADA INC	2.2	9,000	9,044	790,914	2021/2/25
小計					1,425,011	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド		
普通社債券 (含む投資法人債券)	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	4.0	4,700	4,861	706,666	2017/12/7
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	1.0	5,000	4,900	712,215	2022/9/27
小計					1,418,881	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ		
アメリカ 普通社債券 (含む投資法人債券)	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	1.8	1,200	1,276	155,685	2020/7/23
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	2.375	8,000	8,903	1,086,012	2023/2/1
小計					1,241,698	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル		
普通社債券 (含む投資法人債券)	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	11,700	12,104	1,029,255	2019/5/15
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP	2.75	6,000	5,859	498,241	2021/7/26
小計					1,527,497	
合計					7,734,364	

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年12月20日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 7,734,364	% 96.7
コール・ローン等、その他	268,002	3.3
投資信託財産総額	8,002,366	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 当期末における外貨建て純資産 (7,887,059千円) の投資信託財産総額 (8,002,366千円) に対する比率は98.6%です。

* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=117.18円、1カナダドル=87.45円、1英ポンド=145.35円、1ユーロ=121.98円、1豪ドル=85.03円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,268,064,058
コール・ローン等	106,527,773
公社債(評価額)	7,734,364,480
未収入金	1,363,635,142
未収利息	59,856,855
前払費用	3,679,808
(B) 負債	1,360,688,674
未払金	1,291,488,558
未払解約金	69,200,000
未払利息	116
(C) 純資産総額(A-B)	7,907,375,384
元本	6,349,148,971
次期繰越損益金	1,558,226,413
(D) 受益権総口数	6,349,148,971口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,454円

(注) 期首元本額は6,183,495,330円、期中追加設定元本額は502,658,833円、期中一部解約元本額は337,005,192円、1口当たり純資産額は1,2454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
 ・トヨタグループ世界債券ファンド(年2回分配型) 4,427,923,536円
 ・トヨタグループ世界債券ファンド(毎月分配型) 1,921,225,435円

○損益の状況 (2015年12月22日～2016年12月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	241,072,470
受取利息	241,089,904
支払利息	△ 17,434
(B) 有価証券売買損益	△ 574,200,217
売買益	243,907,568
売買損	△ 818,107,785
(C) 保管費用等	△ 786,056
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 333,913,803
(E) 前期繰越損益金	1,853,293,857
(F) 追加信託差損益金	105,641,167
(G) 解約差損益金	△ 66,794,808
(H) 計(D+E+F+G)	1,558,226,413
次期繰越損益金(H)	1,558,226,413

* 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(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。

○お知らせ

該当事項はございません。

<お申し込み時の留意点>

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようお願いいたします。

(2016年12月20日現在)

年 月	日
2016年12月	26、27
2017年1月	16
2月	20
3月	－
4月	14、17
5月	1、29
6月	－
7月	4
8月	28
9月	4
10月	－
11月	－
12月	25、26

※2017年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご留意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。