

野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース

運用報告書(全体版)

第102期(決算日2018年1月25日) 第103期(決算日2018年2月26日) 第104期(決算日2018年3月26日)
第105期(決算日2018年4月25日) 第106期(決算日2018年5月25日) 第107期(決算日2018年6月25日)

作成対象期間(2017年12月26日～2018年6月25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。
なお、当ファンドは、運用開始以来永らくご愛顧いただきましたが、2019年6月25日に信託期間満了となります。
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	2009年6月26日から2019年6月25日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるPIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged) 受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品を実質的な主要投資対象とし、インカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行います。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged) 受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged) 受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。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。
	PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged)	世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品を主要投資対象とします。派生商品については、オプション取引、先物取引、スワップ取引などを活用します。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への直接投資は行いません。
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
	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30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税金 込 分 配	み 金 騰 落	中 率	参 考 指 数	期 騰 落	中 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 比 率	純 資 産 額
78期(2016年1月25日)	9,416	30	△1.1	122.64	△0.5	0.0	—	98.3	1,051			
79期(2016年2月25日)	9,441	10	0.4	124.22	1.3	0.1	—	98.3	1,048			
80期(2016年3月25日)	9,637	10	2.2	126.25	1.6	0.0	—	98.3	1,055			
81期(2016年4月25日)	9,732	10	1.1	127.48	1.0	0.0	—	98.3	1,065			
82期(2016年5月25日)	9,619	10	△1.1	126.34	△0.9	0.1	—	98.3	1,050			
83期(2016年6月27日)	9,706	10	1.0	127.70	1.1	0.1	—	98.3	1,048			
84期(2016年7月25日)	9,923	10	2.3	129.28	1.2	0.1	—	98.3	1,063			
85期(2016年8月25日)	9,995	10	0.8	130.31	0.8	0.1	—	98.3	1,056			
86期(2016年9月26日)	9,995	10	0.1	129.98	△0.3	0.1	—	98.3	1,044			
87期(2016年10月25日)	9,974	10	△0.1	129.35	△0.5	0.1	—	98.3	1,045			
88期(2016年11月25日)	9,605	10	△3.6	124.49	△3.8	0.1	—	98.2	988			
89期(2016年12月26日)	9,624	10	0.3	124.52	0.0	0.1	—	98.2	986			
90期(2017年1月25日)	9,679	10	0.7	125.41	0.7	0.0	—	98.7	1,478			
91期(2017年2月27日)	9,825	10	1.6	126.95	1.2	0.0	—	98.8	1,490			
92期(2017年3月27日)	9,849	10	0.3	127.43	0.4	0.0	—	98.8	1,492			
93期(2017年4月25日)	9,889	10	0.5	128.18	0.6	0.1	—	98.8	1,499			
94期(2017年5月25日)	9,902	10	0.2	128.74	0.4	0.1	—	98.7	1,476			
95期(2017年6月26日)	9,946	10	0.5	129.60	0.7	0.0	—	98.1	1,483			
96期(2017年7月25日)	9,965	10	0.3	129.72	0.1	0.0	—	98.7	1,476			
97期(2017年8月25日)	10,005	10	0.5	130.31	0.5	0.0	—	98.7	1,472			
98期(2017年9月25日)	10,034	10	0.4	130.44	0.1	0.0	—	98.7	1,475			
99期(2017年10月25日)	9,973	10	△0.5	129.69	△0.6	0.0	—	98.7	1,466			
100期(2017年11月27日)	10,010	10	0.5	130.45	0.6	0.0	—	98.7	1,471			
101期(2017年12月25日)	9,982	10	△0.2	130.40	△0.0	0.0	—	98.6	1,464			
102期(2018年1月25日)	10,061	10	0.9	130.80	0.3	0.0	—	98.7	1,470			
103期(2018年2月26日)	9,946	10	△1.0	129.79	△0.8	0.0	—	98.7	1,453			
104期(2018年3月26日)	9,942	10	0.1	129.84	0.0	0.0	—	98.1	939			
105期(2018年4月25日)	9,851	10	△0.8	128.83	△0.8	0.0	—	98.7	1,424			
106期(2018年5月25日)	9,758	10	△0.8	127.99	△0.6	0.0	—	98.7	1,411			
107期(2018年6月25日)	9,725	10	△0.2	127.78	△0.2	0.0	—	98.7	1,402			

* 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PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス (カスタムヘッジ・円ベース) とします。なお、設定時=100として指数化しています。

* PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス (GLADI) の一部の特長については、特許取得済みです (米国特許番号: 8,306,892)。「GLOBAL ADVANTAGE (グローバル・アドバンテージ)」と「GLADI」はPIMCO (パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー) の商標です。

* GLADIはPIMCOとは独立したグローバルなインデックスであり、プロバイダーであるBofAメリルリンチ社 (Bank of America Merrill Lynch) によって管理、計算されています。BofAメリルリンチ社は、インデックスの構築方法に基づいたインデックスの作成、インデックス構成銘柄の確認、その他のインデックス・データの計算に関わる全ての技術的な事柄に対応します。

○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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第102期	(期 首) 2017年12月25日	円 9,982	% —	130.40	% —	% 0.0	% —	% 98.6
	12月末	9,996	0.1	130.52	0.1	0.0	—	98.8
	(期 末) 2018年1月25日	10,071	0.9	130.80	0.3	0.0	—	98.7
第103期	(期 首) 2018年1月25日	10,061	—	130.80	—	0.0	—	98.7
	1月末	10,023	△0.4	130.42	△0.3	0.0	—	98.9
	(期 末) 2018年2月26日	9,956	△1.0	129.79	△0.8	0.0	—	98.7
第104期	(期 首) 2018年2月26日	9,946	—	129.79	—	0.0	—	98.7
	2月末	9,937	△0.1	129.69	△0.1	0.0	—	98.8
	(期 末) 2018年3月26日	9,952	0.1	129.84	0.0	0.0	—	98.1
第105期	(期 首) 2018年3月26日	9,942	—	129.84	—	0.0	—	98.1
	3月末	9,969	0.3	130.23	0.3	0.0	—	98.2
	(期 末) 2018年4月25日	9,861	△0.8	128.83	△0.8	0.0	—	98.7
第106期	(期 首) 2018年4月25日	9,851	—	128.83	—	0.0	—	98.7
	4月末	9,835	△0.2	128.66	△0.1	0.0	—	98.8
	(期 末) 2018年5月25日	9,768	△0.8	127.99	△0.6	0.0	—	98.7
第107期	(期 首) 2018年5月25日	9,758	—	127.99	—	0.0	—	98.7
	5月末	9,771	0.1	128.31	0.2	0.0	—	98.8
	(期 末) 2018年6月25日	9,735	△0.2	127.78	△0.2	0.0	—	98.7

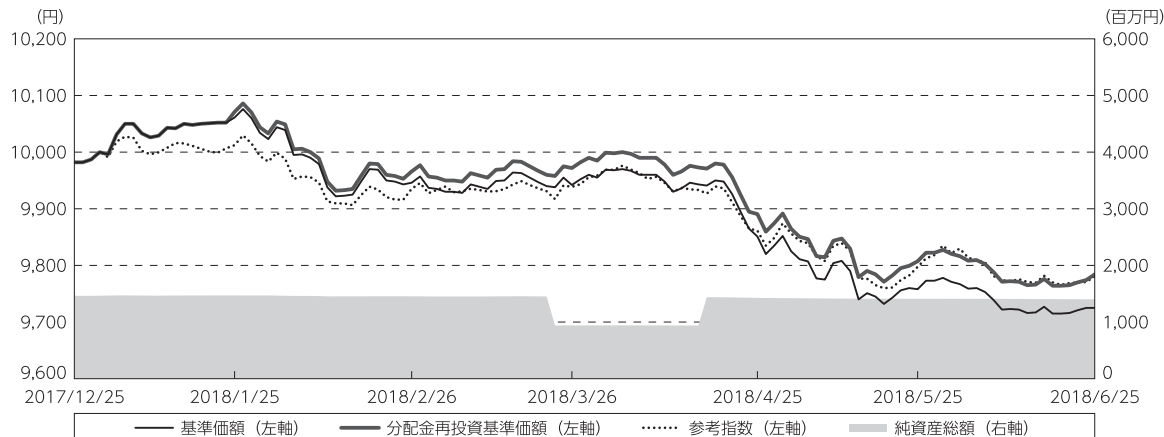
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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

○作成期間中の基準価額等の推移



第102期首：9,982円

第107期末：9,725円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：△ 2.0% (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(2017年12月25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、PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス(カスタムヘッジ・円ベース)です。参考指数は、作成期首(2017年12月25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

- ・ 当作成期を通じて、保有している利付債からのクーポン収入がプラスに寄与したこと
- ・ 当作成期を通じて、投資している債券の価格が下落したことがマイナスに寄与したこと

○投資環境

・先進国国債

米国債券市場は、当作成期間では、利回りは上昇(価格は下落)しました。原油価格の上昇を背景としたインフレ懸念に対する高まりや堅調な国内経済指標などに左右されました。

欧州債券市場は、当作成期間では、利回りは低下(価格は上昇)しました。米国との貿易戦争が発展するとの警戒感やECB(欧州中央銀行)による金融政策の発表などに左右されました。

・新興国国債

新興国国債は先進国の金融政策の動向や新興国の主要経済指標などに左右され、当作成期間では利回りは上昇しました。

・投資適格社債

米国の投資適格社債は、米国の主要経済指標、金融政策ならびにトランプ政権の動向などに左右され、利回りは上昇基調で推移しました。

・モーゲージ債

エージェンシー・モーゲージ債は、米国債に対して割高の水準との見方が嫌気され、パフォーマンスは軟調となりました。

・為替市場

ドル・円相場は、トランプ米大統領の政権運営や米中貿易摩擦をめぐる不透明感が高まったことなどを背景にドルに対して円高となりました。

ユーロ・円相場は、米国との貿易摩擦の発展やイタリア政局をめぐる不透明感、ECBによる金融政策維持の姿勢などを受けてユーロに対して円高となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース]

[野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース] は、当作成期を通じて、[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J (JPY, Hedged)] 受益証券を概ね高位に組み入れ、また [野村マネー マザーファンド] 受益証券への投資も行いました。

[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J (JPY, Hedged)]

<国・地域別比率（純資産比）>

国・地域別配分については、'18年5月末で米国40.2%、ユーロ圏27.4%、ブラジル5.9%、スウェーデン5.4%、中国5.1%、ロシア4.2%、メキシコ3.9%、その他の国・地域26.7%としました。

<セクター別比率（純資産比）>

セクター別配分については、'18年5月末で先進国国債等27.2%、新興国国債等9.4%、社債26.5%、モーゲージ債35.0%、新興国通貨20.6%としました。

<信用格付け別比率（純資産比）>

信用格付け配分については、'18年5月末でAAA格49.3%、AA格4.7%、A格18.1%、BBB格21.0%、BB格6.5%、B格以下8.0%、新興国通貨20.6%としました。

[野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

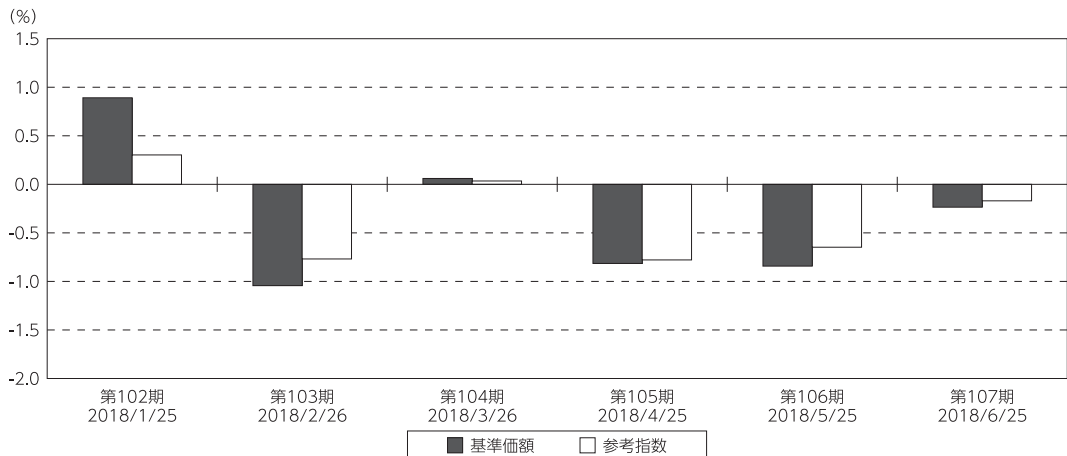
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

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。

当作成期の中に、基準価額の騰落率が -2.0% *となったのに対し、参考指数であるPIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス（カスタムヘッジ・円ベース）は -2.0% となりました。保有している利付債からのクーポン収入がプラスに寄与した一方、投資している債券の価格が下落したことがマイナスに寄与しました。

※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（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、PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス（カスタムヘッジ・円ベース）です。

◎分配金

収益分配金については、各期の利子・配当収入や基準価額水準等を勘案し、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す。

◎分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項 目	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期
	2017年12月26日～ 2018年1月25日	2018年1月26日～ 2018年2月26日	2018年2月27日～ 2018年3月26日	2018年3月27日～ 2018年4月25日	2018年4月26日～ 2018年5月25日	2018年5月26日～ 2018年6月25日
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	0.099%	0.100%	0.100%	0.101%	0.102%	0.103%
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,937	1,947	1,953	1,967	1,978	1,989

(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

[野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース]

ファンドの商品性に従い、[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンダーJ (JPY, Hedged)] 受益証券への投資比率を引き続き高位に維持する方針です。

[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンダーJ (JPY, Hedged)]

主要国経済は堅調な成長を継続しています。一方で、主要国における金融政策、通商政策の動向や、各国の政治イベントなど、リスクシナリオの実現により市場の価格変動性が高まる可能性には留意する必要があります。米国では過去最低水準の失業率に加え賃金の上昇が観測される等、労働市場の回復が続いていることに加え、トランプ政権による景気刺激策の実施も追い風となり、経済回復が続くとみられます。ただし、景気良好な局面での財政拡大がインフレを加速させるリスクがあることや、保護主義への傾斜による貿易摩擦の深刻化には注意が必要とみています。金融政策については、FRB(米連邦準備制度理事会)は、これまでの政策スタンスを維持し、経済動向を見つつ緩やかなペースでの利上げを維持するとみられますが、インフレが加速する局面では過去の様に利上げペースを速める可能性もあると考えられます。ユーロ圏では、ポピュリズム(大衆迎合主義)政党の台頭などに注意する必要性はあるものの好調な景況感や内需の回復を背景に、ECBによる金融緩和の正常化に向けた議論が進むとみていま

す。また中国については足元で経済の安定がみられるも、貿易や知的財産の分野における米国との間での緊張感の高まりには注意が必要とみています。

金利戦略に関しては、ポートフォリオ全体では市場変動に応じて機動的に調整する方針とします。米国では足元のバリュエーション（企業価値評価）改善を受けて、金利リスクについてはややオーバーウェイト（ベンチマークに比べ高めの投資比率）としつつ、金利水準を見つつ機動的に調整する方針をとります。欧州では今後の金融政策の動向を鑑み金利リスクはアンダーウェイト（ベンチマークに比べ低めの投資比率）とします。クレジット戦略では流動性を注視しつつ、リスク調整後のバリュエーションに魅力のある銘柄を選別して投資を行いません。具体的には、米国における住宅市場の回復の恩恵を受ける非政府系モーゲージ債券を組み入れ、米国の財政拡大に伴いインフレが進行するとの見方から米国の物価連動国債をオーバーウェイトとします。また社債においては財務健全性の高さや景気回復の恩恵を受けるとみられる金融機関の社債をオーバーウェイトします。新興国市場については、国ごとの景気に温度差が広がる中、各国の財政状況や対外収支状況などファンダメンタルズ（基礎的諸条件）の分析に主軸を置きつつ、政治的要因についても配慮し、投資対象国を選別します。通貨に関しては、ユーロやシンガポールドルをアンダーウェイトとする一方、中国元、ロシア・ルーブル、英ポンドをオーバーウェイトとします。

【野村マネー マザーファンド】

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図って運用いたします。日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

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。

※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受け、当該金融取引を行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

(2017年12月26日～2018年6月25日)

項 目	第102期～第107期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 67	% 0.673	(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)	(44)	(0.442)	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)	(21)	(0.215)	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	0	0.001	(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)	(0.001)	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
合 計	67	0.674	
作成期間の平均基準価額は、9,921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。

*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。

○売買及び取引の状況

(2017年12月26日～2018年6月25日)

投資信託証券

銘 柄	第102期～第107期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	口	千円	口	千円
PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J (JPY, Hedged)	55,111	508,417	56,634	522,310

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2017年12月26日～2018年6月25日)

利害関係人との取引状況

<野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース>
該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区 分	第102期～第107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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 8,824	百万円 703	% 8.0	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

※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。

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

(2018年6月25日現在)

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101期末		第107期末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J (JPV, Hedged)	口	口	千円	%
	155,645	154,122	1,383,553	98.7
合 計	155,645	154,122	1,383,553	98.7

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘 柄	第101期末		第107期末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口	千口	千円	千円
	982	982	1,002	1,002

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年6月25日現在)

項 目	第107期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 1,383,553	% 98.5
野村マネー マザーファンド	1,002	0.1
コール・ローン等、その他	20,751	1.4
投資信託財産総額	1,405,306	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

項 目	第102期末	第103期末	第104期末	第105期末	第106期末	第107期末
	2018年1月25日現在	2018年2月26日現在	2018年3月26日現在	2018年4月25日現在	2018年5月25日現在	2018年6月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,474,109,640	1,457,441,861	1,455,693,209	1,427,459,020	1,414,503,796	1,405,306,412
コール・ローン等	20,761,348	21,735,486	533,032,734	20,731,658	20,751,911	20,750,271
投資信託受益証券(評価額)	1,452,345,246	1,434,703,428	921,657,528	1,405,724,415	1,392,748,938	1,383,553,194
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,046	1,002,947	1,002,947	1,002,947	1,002,947	1,002,947
(B) 負債	3,147,481	4,166,214	516,320,098	2,638,431	3,021,239	3,058,881
未払金	—	—	782,765	—	—	—
未払収益分配金	1,462,075	1,461,121	944,889	1,446,427	1,446,456	1,441,865
未払解約金	—	974,340	513,160,486	—	—	—
未払信託報酬	1,682,704	1,727,970	1,428,685	1,190,069	1,572,238	1,614,401
未払利息	24	29	997	43	40	44
その他未払費用	2,678	2,754	2,276	1,892	2,505	2,571
(C) 純資産総額(A-B)	1,470,962,159	1,453,275,647	939,373,111	1,424,820,589	1,411,482,557	1,402,247,531
元本	1,462,075,556	1,461,121,559	944,889,272	1,446,427,264	1,446,456,305	1,441,865,180
次期繰越損益金	8,886,603	△ 7,845,912	△ 5,516,161	△ 21,606,675	△ 34,973,748	△ 39,617,649
(D) 受益権総口数	1,462,075,556口	1,461,121,559口	944,889,272口	1,446,427,264口	1,446,456,305口	1,441,865,180口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,061円	9,946円	9,942円	9,851円	9,758円	9,725円

(注) 第102期首元本額は1,467,182,707円、第102～107期中追加設定元本額は501,675,285円、第102～107期中一部解約元本額は526,992,812円、1口当たり純資産額は、第102期1.0061円、第103期0.9946円、第104期0.9942円、第105期0.9851円、第106期0.9758円、第107期0.9725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3,963,882円。(野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース/Bコースの合計額)

○損益の状況

項 目	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期
	2017年12月26日～ 2018年1月25日	2018年1月26日～ 2018年2月26日	2018年2月27日～ 2018年3月26日	2018年3月27日～ 2018年4月25日	2018年4月26日～ 2018年5月25日	2018年5月26日～ 2018年6月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	4,664,819	4,667,626	2,996,133	4,623,123	4,632,364	4,622,579
受取配当金	4,665,420	4,668,249	3,000,570	4,626,630	4,633,230	4,623,660
支払利息	△ 601	△ 623	△ 4,437	△ 3,507	△ 866	△ 1,081
(B) 有価証券売買損益	9,954,200	△ 18,202,388	△ 1,062,488	△ 15,216,486	△ 14,977,697	△ 6,318,604
売買益	9,973,961	13,098	111,729	—	—	15,763
売買損	△ 19,761	△ 18,215,486	△ 1,174,217	△ 15,216,486	△ 14,977,697	△ 6,334,367
(C) 信託報酬等	△ 1,685,382	△ 1,730,724	△ 1,430,961	△ 1,191,961	△ 1,574,743	△ 1,616,972
(D) 当期損益金(A+B+C)	12,933,637	△ 15,265,486	502,684	△ 11,785,324	△ 11,920,076	△ 3,312,997
(E) 前期繰越損益金	△ 32,630,850	△ 21,145,115	△ 24,491,105	△ 24,933,310	△ 38,165,061	△ 51,366,993
(F) 追加信託差損益金	30,045,891	30,025,810	19,417,149	16,558,386	16,557,845	16,504,206
(配当等相当額)	(138,319,221)	(138,231,491)	(89,396,259)	(187,379,218)	(187,384,929)	(186,792,286)
(売買損益相当額)	(△108,273,330)	(△108,205,681)	(△ 69,979,110)	(△170,820,832)	(△170,827,084)	(△170,288,080)
(G) 計(D+E+F)	10,348,678	△ 6,384,791	△ 4,571,272	△ 20,160,248	△ 33,527,292	△ 38,175,784
(H) 収益分配金	△ 1,462,075	△ 1,461,121	△ 944,889	△ 1,446,427	△ 1,446,456	△ 1,441,865
次期繰越損益金(G+H)	8,886,603	△ 7,845,912	△ 5,516,161	△ 21,606,675	△ 34,973,748	△ 39,617,649
追加信託差損益金	30,045,891	30,025,810	19,417,149	16,558,386	16,557,845	16,504,206
(配当等相当額)	(138,319,221)	(138,231,491)	(89,396,259)	(187,379,218)	(187,385,039)	(186,792,286)
(売買損益相当額)	(△108,273,330)	(△108,205,681)	(△ 69,979,110)	(△170,820,832)	(△170,827,194)	(△170,288,080)
分配準備積立金	144,889,108	146,268,099	95,209,972	97,195,029	98,806,513	100,055,066
繰越損益金	△166,048,396	△184,139,821	△120,143,282	△135,360,090	△150,338,106	△156,176,921

* 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(2017年12月26日～2018年6月25日)は以下の通りです。

項 目	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期
	2017年12月26日～ 2018年1月25日	2018年1月26日～ 2018年2月26日	2018年2月27日～ 2018年3月26日	2018年3月27日～ 2018年4月25日	2018年4月26日～ 2018年5月25日	2018年5月26日～ 2018年6月25日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,127,319円	2,937,169円	1,565,360円	3,431,484円	3,057,940円	3,006,019円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大引金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	138,319,221円	138,231,491円	89,396,259円	187,379,218円	187,385,039円	186,792,286円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	142,223,864円	144,792,051円	94,589,501円	95,209,972円	97,195,029円	98,490,912円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	284,670,404円	285,960,711円	185,551,120円	286,020,674円	287,638,008円	288,289,217円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,947円	1,957円	1,963円	1,977円	1,988円	1,999円
g. 分配金	1,462,075円	1,461,121円	944,889円	1,446,427円	1,446,456円	1,441,865円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期
1万口当たり分配金(税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10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。

○(参考情報)親投資信託の組入資産の明細

(2018年6月25日現在)

<野村マネー マザーファンド>

下記は、野村マネー マザーファンド全体(14,918,045千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第107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	%	%	%	%	%
地方債証券	980,000 (980,000)	980,445 (980,445)	6.4 (6.4)	— (—)	— (—)	— (—)	6.4 (6.4)
特殊債券 (除く金融債)	500,000 (500,000)	500,149 (500,149)	3.3 (3.3)	— (—)	— (—)	— (—)	3.3 (3.3)
金融債券	750,000 (750,000)	750,524 (750,524)	4.9 (4.9)	— (—)	— (—)	— (—)	4.9 (4.9)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,500,000 (1,500,000)	1,506,272 (1,506,272)	9.9 (9.9)	— (—)	— (—)	— (—)	9.9 (9.9)
合 計	3,730,000 (3,730,000)	3,737,391 (3,737,391)	24.5 (24.5)	— (—)	— (—)	— (—)	24.5 (24.5)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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	第107期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
神奈川県 公募第158回		1.53	30,000	30,218	2018/12/20
大阪府 公募第315回		1.95	450,000	450,063	2018/6/27
大阪府 公募(5年)第96回		0.318	500,000	500,163	2018/7/30
小 計			980,000	980,445	
特殊債券(除く金融債)					
地方公共団体金融機構債券 F39回		0.808	100,000	100,145	2018/8/28
日本政策金融公庫社債 第55回財投機関債		0.001	400,000	400,004	2018/8/9
小 計			500,000	500,149	
金融債券					
商工債券 利付第758回い号		0.4	100,000	100,035	2018/7/27
農林債券 利付第757回い号		0.35	100,000	100,009	2018/6/27
しんきん中金債券 利付第287回		0.3	450,000	450,459	2018/10/26
商工債券 利付(3年)第186回		0.16	100,000	100,020	2018/7/27
小 計			750,000	750,524	
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力 第469回		1.7	300,000	301,683	2018/10/25
トヨタ自動車 第8回社債間限定同等特約付		2.01	100,000	100,967	2018/12/20
三菱東京UFJ銀行 第146回特定社債間限定同順位特約付		0.355	300,000	300,095	2018/7/24
三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付		0.442	300,000	300,152	2018/8/6
NTTドコモ 第17回社債間限定同順位特約付		1.77	200,000	200,836	2018/9/20
NTTデータ 第22回社債間限定同順位特約付		1.78	300,000	302,537	2018/12/20
小 計			1,500,000	1,506,272	
合 計			3,730,000	3,737,391	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区 分	第107期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 5,400,000	% 35.5

*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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。

PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドー
 インスティテューショナル FC (JPY, ヘッジド)/
 インスティテューショナル FD (JPY)/J (JPY)/J (JPY, Hedged)

2018年2月28日決算

(計算期間:2017年3月1日～2018年2月28日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	英領ケイマン諸島籍外国投資信託
運 用 方 針	世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品(オプション取引、先物取引、スワップ取引等)を主要投資対象とし、トータルリターンの最大化を目指します。
投 資 対 象	世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品
投 資 顧 問 会 社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受 託 会 社	メイプルズエフエス・ピーシーティー・リミテッド
保 管 受 託 銀 行 管 理 事 務 代 行 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
名義書換事務受託会社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・(ルクセンブルグ)・エス・シー・エー

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

運用計算書

2018年2月28日に終了した期間

	(単位:千)	
収益:		
受取利息(外国税額控除後)	\$	1,023
関連投資からの配当金		0
雑収入		3
収益合計		1,026
費用:		
管理費用-Institutional FC (JPY, Hedged)		1
管理費用-Institutional FD (JPY)		128
支払利息		32
法務費用		0
雑費用		2
費用合計		163
純投資損益		863
当期実現損益:		
投資有価証券		40
関連投資		0
上場金融デリバティブ商品		38
店頭金融デリバティブ商品		1,362
外貨通貨		(90)
当期実現損益		1,350
当期末実現評価損益:		
投資有価証券		1,582
関連投資		0
上場金融デリバティブ商品		(74)
店頭金融デリバティブ商品		(397)
外貨建資産および負債		(83)
当期末実現評価損益		1,028
当期実現および未実現評価損益		2,378
運用の結果による純資産の増減額	\$	3,241
外国源泉徴収課税額	\$	2

	(単位:千)	
期末純資産総額		
Institutional FC (JPY, Hedged)	\$	324
Institutional FD (JPY)		23,489
J (JPY)		943
J (JPY, Hedged)		13,445
期末現在発行済受益証券数		(単位:千)
Institutional FC (JPY, Hedged)		4
Institutional FD (JPY)		256
J (JPY)		10
J (JPY, Hedged)		156
期末1口当たり純資産価格		
Institutional FC (JPY, Hedged)		78.90
Institutional FD (JPY)		91.94
J (JPY)		95.09
J (JPY, Hedged)		86.33

※PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドの期末純資産額は38,201千米ドル。

組入資産の明細

2018年2月28日現在

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 125.0%		
アルゼンチン 0.4%		
ソブリン債 0.4%		
Argentina Government International Bond		
3.375% due 01/15/2023 EUR	100	\$ 121
24.918% due 04/03/2022 ARS	170	10
Argentina POM Politica Monetaria		
27.835% due 06/21/2020	390	22
アルゼンチン合計		153
(取得原価 \$150)		
ブラジル 1.2%		
社債・約束手形 1.2%		
Petrobras Global Finance BV		
4.375% due 05/20/2023 \$	200	195
6.250% due 03/17/2024	100	105
7.250% due 03/17/2044	100	102
7.375% due 01/17/2027	60	65
ブラジル合計		467
(取得原価 \$437)		
カナダ 6.1%		
社債・約束手形 0.3%		
Enbridge, Inc.		
2.288% due 06/15/2020	100	101
モーゲージ担保証券 0.1%		
Canadian Mortgage Pools		
1.878% due 07/01/2020 CAD	66	52
ソブリン債 5.7%		
Canada Government Bond		
1.500% due 12/01/2044 (a)	170	162
Canada Housing Trust No.1		
2.400% due 12/15/2022	1,000	784
Province of Alberta		
1.250% due 06/01/2020	100	77
2.350% due 06/01/2025	100	76
Province of Ontario		
2.400% due 06/02/2026	500	380
2.500% due 09/10/2021 \$	700	693
		2,172
カナダ合計		2,325
(取得原価 \$2,482)		
ケイマン諸島 1.3%		
社債・約束手形 1.3%		
Park Aerospace Holdings Ltd.		
4.500% due 03/15/2023	100	97
QNB Finance Ltd.		
3.143% due 02/07/2020	200	201

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.161% due 02/12/2020	200	200
ケイマン諸島合計		498
(取得原価 \$500)		
コロンビア 0.1%		
社債・約束手形 0.1%		
Ecopetrol S.A.		
5.875% due 05/28/2045	50	50
コロンビア合計		50
(取得原価 \$47)		
チェコ共和国 0.1%		
ソブリン債 0.1%		
Czech Republic Government Bond		
0.950% due 05/15/2030 CZK	600	25
チェコ共和国合計		25
(取得原価 \$24)		
デンマーク 3.3%		
社債・約束手形 3.3%		
BRFkredit A/S		
2.000% due 10/01/2047 DKK	875	141
3.000% due 10/01/2047	56	10
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
2.000% due 10/01/2047	1,958	315
2.500% due 10/01/2047	7	1
3.000% due 10/01/2047	6	1
Nykredit Realkredit A/S		
2.000% due 10/01/2047	819	131
2.500% due 10/01/2037	788	135
2.500% due 10/01/2047	39	7
3.000% due 10/01/2047	39	7
Realkredit Danmark A/S		
2.000% due 10/01/2047	2,541	409
2.000% due 10/01/2050	300	47
2.500% due 10/01/2037	286	49
2.500% due 07/01/2047	19	3
デンマーク合計		1,256
(取得原価 \$1,161)		
フランス 3.5%		
社債・約束手形 2.5%		
Credit Agricole S.A.		
8.125% due 09/19/2033** \$	200	206
Dexia Credit Local S.A.		
0.750% due 01/25/2023 EUR	200	249
1.875% due 09/15/2021 \$	250	241
RCI Banque S.A.		
0.750% due 09/26/2022 EUR	100	123
SFR Group S.A.		
5.625% due 05/15/2024	100	124

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
		943
ソブリン債 1.0%		
France Government Bond		
0.250% due 07/25/2024 (a)	208	275
2.000% due 05/25/2048	100	129
		404
フランス合計		1,347
(取得原価 \$1,283)		
ドイツ 2.5%		
資産担保証券 0.6%		
Driver Multi-Compartment S.A.		
0.000% due 12/21/2025	100	123
SC Germany Auto UG Haftungsbeschaenkt		
0.030% due 12/13/2026	79	96
		219
社債・約束手形 1.9%		
Aareal Bank AG		
1.875% due 09/15/2020	\$ 100	97
Deutsche Bank AG		
3.150% due 01/22/2021	100	99
4.250% due 10/14/2021	200	204
Deutsche Pfandbriefbank AG		
2.250% due 05/04/2020	200	198
IHO Verwaltungs GmbH		
3.750% due 09/15/2026 (b)	EUR 100	129
		727
ドイツ合計		946
(取得原価 \$925)		
ガーンジー島 0.3%		
社債・約束手形 0.3%		
Globalworth Real Estate Investments Ltd.		
2.875% due 06/20/2022	100	126
ガーンジー島合計		126
(取得原価 \$111)		
インドネシア 3.7%		
ソブリン債 3.7%		
Indonesia Government International Bond		
2.625% due 06/14/2023	500	650
4.350% due 01/11/2048	\$ 200	191
6.625% due 05/15/2033	IDR 46,000	3
8.250% due 05/15/2036	2,005,000	158
8.375% due 03/15/2034	2,611,000	208
9.000% due 03/15/2029	2,495,000	211
インドネシア合計		1,421
(取得原価 \$1,387)		
アイルランド 0.7%		
社債・約束手形 0.6%		
PartnerRe Ireland Finance DAC		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
1.250% due 09/15/2026	EUR 100	119
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC		
2.400% due 09/23/2021	\$ 100	97
		216
モーゲージ担保証券 0.1%		
Bluestep Mortgage Securities No.3 DAC		
1.056% due 05/10/2063	SEK 378	46
アイルランド合計		262
(取得原価 \$259)		
イスラエル 0.2%		
ソブリン債 0.2%		
Israel Government Bond		
1.750% due 08/31/2025	ILS 200	59
イスラエル合計		59
(取得原価 \$57)		
イタリア 3.8%		
社債・約束手形 0.6%		
Intesa Sanpaolo SpA		
6.625% due 05/08/2018	EUR 100	124
Wind Tre SpA		
3.125% due 01/20/2025	100	109
		233
ソブリン債 3.2%		
Italy Buoni Poliennali del Tesoro		
1.450% due 11/15/2024	300	367
1.650% due 04/23/2020 (a)	299	385
2.350% due 09/15/2024 (a)	309	430
2.700% due 03/01/2047	25	29
		1,211
イタリア合計		1,444
(取得原価 \$1,375)		
日本 6.1%		
社債・約束手形 1.3%		
Central Nippon Expressway Co. Ltd.		
2.567% due 11/02/2021	\$ 300	294
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
3.216% due 03/09/2021	200	206
		500
ソブリン債 4.8%		
Japan Bank for International Cooperation		
2.375% due 07/21/2022	200	195
Japan Finance Organization for Municipalities		
2.125% due 04/13/2021	200	195
Japan Government CPI-Linked Bond		
0.100% due 03/10/2026 (a)	¥ 100,609	996
Japan Government International Bond		
0.500% due 09/20/2046	30,000	264
Tokyo Metropolitan Government		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
2.500% due 06/08/2022	\$ 200	196
		<u>1,846</u>
日本合計 (取得原価 \$2,378)		2,346
クウェート 1.8% ソブリン債 1.8%		
Kuwait Government International Bond		
2.750% due 03/20/2022	200	196
3.500% due 03/20/2027	500	490
クウェート合計 (取得原価 \$695)		686
ルクセンブルグ 1.8% 資産担保証券 0.8%		
Red & Black Auto Lease Germany 2 S.A.		
0.031% due 11/15/2027 EUR	185	226
Silver Arrow S.A. Compartment 8		
0.081% due 03/17/2025	74	91
		<u>317</u>
社債・約束手形 1.0% Aroundtown S.A.		
1.500% due 07/15/2024	100	122
Commerzbank Finance & Covered Bond S.A.		
4.250% due 06/04/2018	150	185
Emerald Bay S.A.		
0.000% due 10/08/2020	50	57
		<u>364</u>
ルクセンブルグ合計 (取得原価 \$597)		681
マレーシア 0.1% ソブリン債 0.1%		
Malaysia Government International Bond		
4.232% due 06/30/2031 MYR	200	50
マレーシア合計 (取得原価 \$52)		50
メキシコ 0.5% ソブリン債 0.5%		
Mexico Government International Bond		
4.350% due 01/15/2047	\$ 200	182
メキシコ合計 (取得原価 \$200)		182
オランダ 1.6% 社債・約束手形 1.6%		
Cooperatieve Rabobank UA		
6.875% due 03/19/2020 EUR	100	138
ING Bank NV		
2.625% due 12/05/2022	\$ 500	490
オランダ合計 (取得原価 \$635)		628

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ノルウェー 1.2% 社債・約束手形 0.5%		
DNB Boligkreditt A/S		
2.500% due 03/28/2022	200	196
ソブリン債 0.7% Kommunalbanken A/S		
2.250% due 01/25/2022	200	196
Norway Government Bond		
3.750% due 05/25/2021 NOK	500	68
		<u>264</u>
ノルウェー合計 (取得原価 \$471)		460
ペルー 1.5% ソブリン債 1.5%		
Peru Government International Bond		
6.150% due 08/12/2032 PEN	800	270
8.200% due 08/12/2026	800	306
ペルー合計 (取得原価 \$533)		576
ポルトガル 0.1% 社債・約束手形 0.1%		
Banco Espirito Santo S.A.		
4.750% due 01/15/2018 (c) EUR	100	36
ポルトガル合計 (取得原価 \$111)		36
カタール 0.5% ソブリン債 0.5%		
Qatar Government International Bond		
4.500% due 01/20/2022	\$ 200	206
カタール合計 (取得原価 \$210)		206
ルーマニア 0.1% ソブリン債 0.1%		
Romania Government International Bond		
5.850% due 04/26/2023 RON	100	28
ルーマニア合計 (取得原価 \$29)		28
サウジアラビア 3.5% ソブリン債 3.5%		
Saudi Government International Bond		
2.375% due 10/26/2021	\$ 1,200	1,158
3.625% due 03/04/2028	200	191
サウジアラビア合計 (取得原価 \$1,386)		1,349
シンガポール 0.3% ソブリン債 0.3%		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Singapore Government Bond		
2.125% due 06/01/2026	SGD 150	112
シンガポール合計		112
(取得原価 \$108)		
スロベニア 0.8%		
ソブリン債 0.8%		
Slovenia Government Bond		
1.000% due 03/06/2028	EUR 100	118
Slovenia Government International Bond		
4.125% due 02/18/2019	\$ 200	203
スロベニア合計		321
(取得原価 \$322)		
スペイン 2.0%		
社債・約束手形 0.6%		
CaixaBank S.A.		
5.000% due 11/14/2023	EUR 100	126
Merlin Properties Socimi S.A.		
1.875% due 11/02/2026	100	122
		248
ソブリン債 1.4%		
Autonomous Community of Catalonia		
4.750% due 06/04/2018	100	123
4.900% due 09/15/2021	100	131
Spain Government Bond		
2.900% due 10/31/2046	200	261
		515
スペイン合計		763
(取得原価 \$682)		
スウェーデン 6.0%		
社債・約束手形 6.0%		
Landshypotek Bank AB		
0.700% due 05/09/2022	SEK 2,000	242
Lansforsakringar Hypotek AB		
1.250% due 09/20/2023	1,200	147
2.250% due 09/21/2022	2,200	284
Nordea Hypotek AB		
1.000% due 04/08/2022	2,200	271
PZU Finance AB		
1.375% due 07/03/2019	EUR 150	186
Skandinaviska Enskilda Banken AB		
1.500% due 12/15/2021	SEK 2,500	314
Stadshypotek AB		
4.500% due 09/21/2022	1,000	142
Sveriges Sakerstallda Obligationer AB		
1.250% due 06/15/2022	1,000	124
Swedbank Hypotek AB		
1.000% due 09/15/2021	2,700	334
1.000% due 06/15/2022	1,900	233
スウェーデン合計		2,277
(取得原価 \$2,112)		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
スイス 1.3%		
社債・約束手形 1.3%		
UBS AG		
2.103% due 06/08/2020	\$ 200	201
7.625% due 08/17/2022**	250	285
スイス合計		486
(取得原価 \$478)		
アラブ首長国連邦 1.0%		
社債・約束手形 0.5%		
First Abu Dhabi Bank PJSC		
3.000% due 03/30/2022	200	196
ソブリン債 0.5%		
Abu Dhabi Government International Bond		
2.500% due 10/11/2022	200	193
アラブ首長国連邦合計		389
(取得原価 \$399)		
イギリス 9.9%		
社債・約束手形 4.6%		
Barclays Bank PLC**		
7.625% due 11/21/2022	200	223
7.750% due 04/10/2023	200	201
Barclays PLC		
2.375% due 10/06/2023	GBP 100	138
FCE Bank PLC		
1.615% due 05/11/2023	EUR 100	125
Lloyds Bank PLC		
4.875% due 03/30/2027	GBP 100	170
6.500% due 03/24/2020	EUR 100	138
Lloyds Banking Group PLC		
7.000% due 06/27/2019** (d)	GBP 200	291
Santander UK Group Holdings PLC		
2.875% due 08/05/2021	\$ 200	196
Santander UK PLC		
3.054% due 03/14/2019	200	203
Tesco Property Finance 3 PLC		
5.744% due 04/13/2040	GBP 49	77
		1,762
モーゲージ担保証券 3.9%		
Aggregator of Loans Backed by Assets PLC		
0.770% due 11/25/2042	65	86
Eurosail-UK PLC		
1.470% due 06/13/2045	93	129
Hawksmoor Mortgages PLC		
1.987% due 05/25/2053	79	111
Holmes Master Issuer PLC		
0.802% due 10/15/2054	100	138
Ludgate Funding PLC		
0.710% due 12/01/2060	71	95
1.119% due 01/01/2061	91	125

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Oncilla Mortgage Funding PLC		
1.922% due 12/12/2043	80	112
Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC		
0.692% due 06/12/2044	63	85
Residential Mortgage Securities 30 PLC		
1.316% due 03/20/2050	92	127
Ripon Mortgages PLC		
1.326% due 08/20/2056	275	381
Rochester Financing No.2 PLC		
1.813% due 06/20/2045	74	104
		<u>1,493</u>

ソブリン債 1.4%		
United Kingdom Gilt Inflation-Linked		
0.125% due 03/22/2024 (a)	344	529
イギリス合計		<u>3,784</u>
(取得原価 \$3,732)		

アメリカ 40.3%		
資産担保証券 0.3%		
Massachusetts Educational Financing Authority		
2.695% due 04/25/2038 \$	17	16
SLM Private Credit Student Loan Trust		
1.828% due 12/16/2041	100	95
		<u>111</u>

社債・約束手形 5.8%		
Ally Financial, Inc.		
3.600% due 05/21/2018	100	100
Alphabet, Inc.		
1.998% due 08/15/2026	200	182
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.		
3.300% due 02/01/2023	200	200
Bank of New York Mellon Corp.		
2.200% due 08/16/2023	100	95
BAT Capital Corp.		
3.557% due 08/15/2027	100	96
Charter Communications Operating LLC		
4.464% due 07/23/2022	200	205
6.384% due 10/23/2035	100	113
Dell International LLC		
4.420% due 06/15/2021	100	102
Goldman Sachs Group, Inc.		
2.904% due 04/23/2020	100	102
JPMorgan Chase & Co.		
2.645% due 04/25/2023	100	101
Morgan Stanley		
2.294% due 02/10/2021	100	100
Navient Corp.		
5.500% due 01/15/2019	200	203
Spectra Energy Partners LP		
2.195% due 06/05/2020	100	101
UIL Holdings Corp.		
4.625% due 10/01/2020	100	104

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
UnitedHealth Group, Inc.		
3.750% due 07/15/2025	100	101
Verizon Communications, Inc.		
3.376% due 02/15/2025	99	97
Wells Fargo & Co.		
3.002% due 10/31/2023	100	103
Zimmer Biomet Holdings, Inc.		
3.150% due 04/01/2022	100	98
		<u>2,203</u>

モーゲージ担保証券 7.7%		
Alternative Loan Trust		
2.071% due 09/25/2035 (c)	75	61
2.321% due 05/25/2036	281	167
American Home Mortgage Investment Trust		
3.606% due 10/25/2034	10	10
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
3.808% due 01/25/2034	8	8
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		
1.821% due 12/25/2036	102	102
Chase Mortgage Finance Trust		
3.142% due 07/25/2037 (c)	5	4
Citigroup Mortgage Loan Trust		
1.781% due 12/25/2036	93	62
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
3.259% due 05/25/2035	30	30
Countrywide Asset-Backed Certificates		
1.751% due 12/25/2036 (c)	70	64
1.761% due 06/25/2047 (c)	82	75
1.911% due 07/25/2036	74	72
2.271% due 01/25/2036	100	89
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust		
2.871% due 07/25/2035	100	100
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
3.421% due 04/20/2036	45	42
6.500% due 11/25/2047	71	63
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust		
1.771% due 02/25/2047	82	69
1.801% due 06/25/2037 (c)	18	17
1.811% due 08/25/2047	141	127
GSR Mortgage Loan Trust		
3.484% due 11/25/2035	112	112
HarborView Mortgage Loan Trust		
1.934% due 06/20/2035	73	71
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust		
1.861% due 04/25/2037	80	57
Impac CMB Trust		
2.621% due 07/25/2033	8	8
JPMorgan Alternative Loan Trust		
3.507% due 12/25/2035 (c)	66	61
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		
1.891% due 08/25/2036	100	78
JPMorgan Mortgage Trust		
3.590% due 10/25/2036 (c)	25	23

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
MASTR Asset Securitization Trust		
6.000% due 06/25/2036 (c)	16	16
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
1.721% due 04/25/2037	118	78
New Century Home Equity Loan Trust		
4.079% due 06/20/2031 (c)	153	143
Residential Asset Mortgage Products Trust		
1.841% due 12/25/2035	78	69
1.961% due 12/25/2035	118	100
Saxon Asset Securities Trust		
3.421% due 05/25/2031	97	88
Sequoia Mortgage Trust		
3.375% due 02/20/2047 (c)	15	14
SG Mortgage Securities Trust		
1.771% due 10/25/2036	200	162
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
1.941% due 10/25/2035	84	83
Structured Asset Investment Loan Trust		
1.751% due 07/25/2036	97	70
3.346% due 10/25/2034	87	86
Terwin Mortgage Trust		
2.561% due 11/25/2033	2	2
Thornburg Mortgage Securities Trust		
3.047% due 10/25/2043	108	106
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
1.901% due 11/25/2045	32	30
3.217% due 03/25/2037 (c)	94	88
3.338% due 03/25/2035	56	57
3.351% due 09/25/2033	51	52
3.385% due 07/25/2037 (c)	43	40
3.590% due 03/25/2034	64	65
		<u>2,921</u>
地方債・約束手形 0.3%		
Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2010		
7.334% due 02/15/2028	100	126
米国政府機関債 19.9%		
Fannie Mae		
2.500% due 08/01/2028	56	55
4.500% due 06/01/2038	15	16
4.500% due 05/01/2041	180	190
4.500% due 07/01/2041	35	37
Fannie Mae, TBA (e)		
3.500% due 04/01/2048	3,600	3,588
4.000% due 05/01/2048	2,900	2,960
Freddie Mac		
1.384% due 01/15/2038 (f)	63	3
1.918% due 01/15/2038	63	63
Freddie Mac, TBA		
3.500% due 04/01/2048 (e)	200	199
Ginnie Mae		
2.312% due 01/20/2066	173	175
Ginnie Mae, TBA (e)		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.500% due 03/01/2048	100	101
4.000% due 04/01/2048	200	205
		<u>7,592</u>

国庫債券 6.3%

Treasury Inflation Protected Securities (a)		
0.125% due 04/15/2022	203	200
2.375% due 01/15/2025	1,988	2,220
		<u>2,420</u>

アメリカ合計**(取得原価 \$15,184)****短期金融商品 17.4%****定期預金 2.1%**

ANZ National Bank			
0.630% due 03/01/2018	AUD	16	12
0.930% due 03/01/2018	\$	122	122
1.050% due 03/01/2018	NZD	10	7
Bank of Nova Scotia			
0.930% due 03/01/2018	\$	175	175
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.			
(0.310%) due 03/01/2018	¥	1,900	18
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.910%) due 03/01/2018	SEK	33	4
(0.550%) due 03/01/2018	DKK	48	8
(0.310%) due 03/01/2018	¥	1	0
0.200% due 03/01/2018	NOK	3	0
0.230% due 03/01/2018	GBP	0	1
5.950% due 03/01/2018	ZAR	8	1
Citibank N.A.			
0.930% due 03/01/2018	\$	63	63
DBS Bank Ltd.			
0.930% due 03/01/2018		1	1
Deutsche Bank AG			
0.550% due 03/01/2018	CAD	1	1
0.930% due 03/01/2018	\$	62	62
DnB NORBank ASA			
0.930% due 03/01/2018		117	117
HSBC Bank			
(0.580%) due 03/01/2018	EUR	9	11
0.230% due 03/01/2018	GBP	20	28
5.950% due 03/01/2018	ZAR	97	8
JPMorgan Chase & Co.			
0.930% due 03/01/2018	\$	122	122
National Australia Bank Ltd.			
0.630% due 03/01/2018	AUD	41	32
0.930% due 03/01/2018	\$	5	5
Royal Bank of Canada			
0.930% due 03/01/2018		2	2
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
(0.580%) due 03/01/2018	EUR	5	6
(0.310%) due 03/01/2018	¥	262	2
			<u>808</u>

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
アルゼンチン短期国債 0.8%		
(0.270%) due 12/14/2018	\$ 200	195
24.872% due 03/21/2018 (g)	ARS 700	34
25.700% due 06/15/2018	100	5
26.100% due 05/16/2018 (g)	200	9
26.275% due 03/16/2018 (g)	200	10
26.420% due 04/18/2018 (g)	1,000	48
		301

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
イタリア短期国債 4.2%		
(0.435%) due 04/30/2018 (g)	EUR 1,300	1,587

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
日本短期国債 10.3%		
(0.160%) due 05/07/2018	¥ 100,000	938
(0.155%) due 05/01/2018	210,000	1,969
(0.152%) due 03/19/2018	20,000	187

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
(0.150%) due 03/12/2018	10,000	94
(0.145%) due 04/09/2018	80,000	750
		3,938

短期金融商品合計
(取得原価 \$6,467) **6,634**

投資有価証券合計125.0%
(取得原価 \$46,979) **\$ 47,746**

金融デリバティブ商品0.5%
(取得原価またはプレミアム \$(125)) **207**

その他の資産および負債(25.5%) **(9,752)**

純資産100.0% **\$ 38,201**

** 偶発転換証券。

- (a) 証券の元本金額はインフレにより調整される。
 (b) 現物払い有価証券。
 (c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
 (d) 永久債:記載の日付(該当する場合は)は次回の償還日である。
 (e) 発行日取引による有価証券。
 (f) インタレスト・オンリー有価証券。
 (g) クーボンは加重平均レートを表す。

◎借入およびその他の金融取引

2018年2月28日現在

●リバース・レポ取引

単位:千
リバース・レポ取引に
係る未払金

取引相手	借入金利	借入日	満期日	借入額	係る未払金
IND	1.600%	01/17/2018	04/17/2018	\$ (1,364)	\$ (1,367)
IND	1.620%	02/07/2018	04/09/2018	(147)	(147)
IND	1.630%	02/08/2018	04/10/2018	(734)	(734)
SCX	(0.480%)	01/18/2018	04/19/2018	EUR (334)	(407)
SCX	0.550%	12/14/2017	03/15/2018	GBP (389)	(536)
リバース・レポ取引合計					\$ (3,191)

●担保付借入として会計処理される取引

単位:千

	残存期間					合計
	翌日物および継続	30日以下	31日-90日	90日超		
リバース・レポ取引						
Non-U.S. Government Debt	\$ 0	\$ (536)	\$ (407)	\$ 0	\$ (943)	
U.S. Government Debt	0	0	(2,248)	0	(2,248)	
リバース・レポ取引合計	\$ 0	\$ (536)	\$ (2,655)	\$ 0	\$ (3,191)	
借入合計	\$ 0	\$ (536)	\$ (2,655)	\$ 0	\$ (3,191)	
リバース・レポ取引に係る未払金					\$ (3,191)	

◎上場金融デリバティブ商品

2018年2月28日現在

●先物契約

単位:千(契約数を除く)

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現 評価損益	変動証拠金	
					資産	負債
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03/2019	38	\$ (9)	\$ 1	\$ 0
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2020	38	4	0	(3)
90-Day Eurodollar September Futures	Long	09/2018	31	(27)	0	0
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2019	31	38	0	(2)
90-Day Sterling December Futures	Long	12/2018	41	(9)	2	0
90-Day Sterling December Futures	Short	12/2019	41	15	0	0
90-Day Sterling June Futures	Long	06/2018	29	(17)	2	0
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03/2018	5	(9)	0	(1)
Canada Government 10-Year Bond June Futures	Short	06/2018	2	(1)	0	0
Euro-Bobl 5-Year Note March Futures	Short	03/2018	2	3	0	0
Euro-OAT 10-Year Bond March Futures	Short	03/2018	7	30	0	(1)
Euro-Schatz 2-Year Note March Futures	Short	03/2018	9	1	0	0
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03/2018	1	1	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2018	7	0	1	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2018	13	5	3	0
U.S. Treasury 20-Year Bond June Futures	Short	06/2018	5	(6)	0	(5)
U.S. Treasury 30-Year Bond June Futures	Long	06/2018	17	3	21	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Long	06/2018	1	0	0	0
先物契約合計				\$ 22	\$ 30	\$ (12)

●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債) - 買い

単位:千

参照債務	支払		2018/2/28時点の			市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
	固定金利	満期日	信用スプレッド	想定元本	資産			負債	
Altria Group, Inc.	(1.000%)	12/20/2020	0.148%	\$ 100	\$ (3)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	
Koninklijke DSM NV	(1.000%)	12/20/2020	0.140%	EUR 100	(3)	0	0	0	
Navient Corp.	(5.000%)	03/20/2019	0.519%	\$ 200	(11)	1	0	0	
Pfizer, Inc.	(1.000%)	12/20/2020	0.132%	100	(3)	0	0	0	
Reynolds American, Inc.	(1.000%)	12/20/2020	0.143%	100	(3)	0	0	0	
United Utilities PLC	(1.000%)	12/20/2020	0.353%	EUR 100	(2)	0	0	0	
					\$ (25)	\$ 1	\$ 0	\$ 0	

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－売り

単位:千

参照債務	受取		2018/2/28時点の			未実現		変動証拠金	
	固定金利	満期日	信用スプレッド	想定元本	市場価格	評価損益	資産	負債	
Tesco PLC	1.000%	06/20/2022	0.947%	EUR 100	\$ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	

クレジットデフォルトスワップ(クレジットインデックス)－買い

単位:千

インデックス/トランシェ	支払		想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
	固定金利	満期日				資産	負債
CDX.HY-29 Index	(5.000%)	12/20/2022	\$ 100	\$ (8)	\$ 0	\$ 0	\$ 0
iTraxx Europe Senior Financials Series 28 Index	(1.000%)	12/20/2022	EUR 600	(18)	(1)	0	(1)
iTraxx Europe Series 28 Index	(1.000%)	12/20/2022	900	(27)	(2)	0	0
				\$ (53)	\$ (3)	\$ 0	\$ (1)

金利スワップ

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
支払	1-Month USD-LIBOR	1.549%	06/12/2022	\$ 800	\$ 2	\$ 1	\$ 0	\$ 0
支払	1-Month USD-LIBOR	1.613%	06/19/2022	1,600	2	2	0	0
支払	3-Month Canadian Bank Bill	1.400%	09/13/2019	CAD 4,700	(38)	(2)	0	0
受取	3-Month Canadian Bank Bill	2.200%	06/16/2026	400	8	5	0	0
受取	3-Month Canadian Bank Bill	1.850%	09/15/2027	1,100	53	11	0	0
受取	3-Month Canadian Bank Bill	1.750%	12/16/2046	100	16	0	0	0
支払	3-Month GBP-LIBOR	1.000%	09/19/2019	GBP 1,900	(2)	(4)	1	0
支払	3-Month GBP-LIBOR	1.250%	12/19/2019	1,700	2	0	0	0
受取	3-Month GBP-LIBOR	1.000%	09/18/2020	1,900	9	8	0	0
受取	3-Month GBP-LIBOR	1.500%	12/18/2020	1,700	(2)	0	0	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.945%	09/19/2018	\$ 4,600	(4)	(4)	0	0
支払	3-Month USD-LIBOR	1.750%	04/01/2019	21,000	(78)	(61)	1	0
受取	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/21/2019	4,900	76	36	0	0
受取	3-Month USD-LIBOR	2.000%	04/01/2020	21,000	86	74	0	(2)
受取	3-Month USD-LIBOR	2.250%	12/16/2022	2,200	46	69	0	(3)
支払	3-Month USD-LIBOR	2.250%	12/20/2022	500	(11)	(11)	1	0
受取	3-Month USD-LIBOR	2.250%	06/20/2028	900	55	(3)	0	(3)
受取	3-Month USD-LIBOR	2.098%	07/01/2041	1,400	38	9	0	(1)
受取	3-Month USD-LIBOR	2.750%	12/20/2047	1,400	67	111	0	(12)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	03/15/2022	ZAR 1,900	4	1	0	(1)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.000%	03/15/2022	2,800	8	2	0	(1)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	03/15/2022	400	1	0	0	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	06/20/2023	8,000	(1)	(3)	0	(3)
支払	6-Month EURIBOR	0.000%	03/21/2020	EUR 300	1	0	0	0
支払	6-Month EURIBOR	0.000%	06/20/2020	800	1	0	0	0
支払	6-Month EURIBOR	0.500%	03/21/2023	1,450	2	(9)	1	0
支払	6-Month EURIBOR	1.000%	03/21/2028	1,300	(15)	(14)	1	0
支払	6-Month EURIBOR	1.000%	06/20/2028	50	(1)	0	0	0
受取	6-Month EURIBOR	1.500%	03/21/2048	300	10	(2)	0	0

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
							資産	負債	
受取	6-Month GBP-LIBOR	0.750%	03/21/2020	GBP 2,700	22	9	0	(2)	
受取	6-Month GBP-LIBOR	1.000%	03/21/2023	100	3	0	0	0	
支払	6-Month GBP-LIBOR	1.750%	03/21/2048	50	2	1	0	0	
支払	6-Month JPY-LIBOR	0.150%	03/22/2018	¥ 360,000	2	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.300%	09/20/2027	150,000	(1)	0	0	(1)	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.354%	01/18/2028	10,000	0	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.351%	02/08/2028	10,000	0	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.301%	02/13/2028	10,000	1	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.354%	02/16/2028	10,000	0	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.300%	03/20/2028	50,000	1	(2)	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.380%	06/18/2028	10,000	0	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.399%	06/18/2028	10,000	0	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.450%	03/20/2029	20,000	(1)	0	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	1.500%	12/21/2045	50,000	(77)	(8)	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	0.500%	09/20/2046	10,000	9	(1)	0	0	
受取	6-Month JPY-LIBOR	1.000%	03/21/2048	20,000	(5)	(3)	0	0	
支払	6-Month PLN-WIBOR	2.500%	03/21/2023	PLN 200	0	0	0	0	
支払	6-Month PLN-WIBOR	3.000%	03/21/2028	100	0	0	0	0	
支払	BRL-CDI-Compounded	8.860%	01/04/2021	BRL 6,300	24	22	2	0	
受取	FEDL01 Index	1.724%	09/19/2018	\$ 4,600	2	2	0	0	
支払	IBMEXID	5.715%	10/15/2021	MXN 1,500	(5)	(1)	0	0	
支払	IBMEXID	5.560%	11/11/2021	100	0	0	0	0	
支払	IBMEXID	5.795%	12/10/2021	700	(3)	(1)	0	0	
支払	IBMEXID	7.278%	03/22/2022	900	(1)	(1)	0	0	
支払	IBMEXID	6.000%	07/18/2022	800	(3)	(1)	0	0	
支払	IBMEXID	6.080%	03/10/2026	3,200	(18)	(5)	0	0	
支払	IBMEXID	7.380%	11/04/2026	900	(2)	(2)	0	0	
支払	New Zealand Bank Bill 3 Month FRA	2.500%	07/11/2019	NZD 1,400	3	1	0	(1)	
支払	New Zealand Bank Bill 3 Month FRA	2.500%	02/14/2020	5,000	5	(1)	0	(2)	
						\$ 293	\$ 225	\$ 7	\$(32)
スワップ契約合計						\$ 216	\$ 224	\$ 7	\$(33)

◎店頭金融デリバティブ商品

2018年2月28日現在

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨	未実現評価損益				
					資産	負債			
BOA	03/2018	ARS	485	\$	24	\$	0	\$	0
BOA	03/2018	CNH	2,373		376		1		0
BOA	03/2018	\$	8	ARS	161		0		0
BOA	03/2018		4	IDR	58,313		0		0
BOA	03/2018		24	KRW	25,392		0		(1)
BOA	03/2018		886	MXN	16,655		0		(6)
BOA	03/2018		114	NZD	155		0		(2)
BOA	03/2018		37	RON	140		0		0
BOA	03/2018		75	VND	1,708,125		0		0
BOA	04/2018	DKK	8,999	\$	1,425		0		(53)
BOA	04/2018	\$	19	RUB	1,136		1		0
BOA	05/2018	ARS	101	\$	5		0		0
BOA	05/2018	CAD	1,108		882		17		0
BOA	05/2018	\$	41	AUD	53		0		0
BOA	05/2018		828	EUR	672		0		(4)
BOA	05/2018		167	ZAR	2,022		2		0
BOA	06/2018		374	CNH	2,373		0		(1)
BOA	08/2018		26	AUD	33		0		0
BPS	03/2018	ARS	100	\$	5		0		0
BPS	03/2018	BRL	180		55		0		0
BPS	03/2018	JPY	20,000		179		0		(9)
BPS	03/2018	MXN	1,700		81		0		(9)
BPS	03/2018	PEN	1,901		586		3		0
BPS	03/2018	TWD	9,636		331		2		0
BPS	03/2018	\$	15	ARS	302		0		0
BPS	03/2018		55	BRL	180		0		0
BPS	03/2018		622	EUR	501		0		(11)
BPS	03/2018		125	HKD	975		0		(1)
BPS	03/2018		17	IDR	225,794		0		(1)
BPS	03/2018		57	KRW	60,283		0		(1)
BPS	03/2018		90	MXN	1,700		0		0
BPS	03/2018		5	RUB	285		0		0
BPS	03/2018	VND	1,708,125	\$	75		0		0
BPS	04/2018	EUR	300		356		0		(11)
BPS	04/2018	\$	114	CLP	68,209		1		0
BPS	04/2018		20	KRW	22,490		1		0
BPS	04/2018		199	PHP	10,404		0		(1)
BPS	04/2018		75	VND	1,708,125		0		0
BPS	06/2018		1	ARS	22		0		0
BPS	06/2018		333	TWD	9,636		0		(1)
BPS	08/2018		18	AUD	23		0		0
BRC	03/2018		348	CNH	2,312		17		0
CBK	03/2018	ARS	100	\$	5		0		0
CBK	03/2018	CNH	165		26		0		0
CBK	03/2018	GBP	103		145		3		0
CBK	03/2018	INR	5,376		83		0		0
CBK	03/2018	RUB	17,050		296		0		(7)
CBK	03/2018	SGD	459		338		0		(10)
CBK	03/2018	\$	146	COP	420,113		0		0
CBK	03/2018		16	IDR	213,520		0		(1)

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益		
				資産	負債	
CBK	03/2018		83 INR	5,376	0	(1)
CBK	03/2018		0	7	0	0
CBK	03/2018		20 RUB	1,142	0	0
CBK	03/2018		382 SGD	506	1	0
CBK	03/2018		322 TWD	9,636	7	0
CBK	04/2018	ARS	800 \$	40	1	0
CBK	04/2018	DKK	1,890	300	0	(10)
CBK	04/2018	JPY	80,000	711	0	(41)
CBK	04/2018	\$	26 DKK	155	0	(1)
CBK	05/2018	ARS	100 \$	5	0	0
CBK	05/2018	JPY	170,000	1,564	0	(36)
CBK	05/2018	\$	60 CAD	76	0	(1)
CBK	05/2018		554 TRY	2,176	4	0
CBK	06/2018	INR	5,376 \$	82	1	0
CBK	08/2018	\$	3 ARS	62	0	0
DUB	03/2018	BRL	3,123 \$	962	1	0
DUB	03/2018	PEN	84	26	0	0
DUB	03/2018	\$	968 BRL	3,123	0	(7)
DUB	03/2018		947 CNY	6,339	54	0
DUB	04/2018		248 EUR	200	0	(3)
DUB	04/2018		159 RUB	9,043	1	0
DUB	07/2018	BRL	260 \$	74	0	(5)
DUB	01/2019	\$	126 EUR	100	0	0
FBF	03/2018	ARS	100 \$	5	0	0
FBF	03/2018	\$	53 RUB	2,970	0	0
FBF	04/2018	ARS	100 \$	5	0	0
FBF	05/2018	\$	452 CHF	420	0	(4)
FBF	05/2018		70 RUB	3,973	0	0
GLM	03/2018	BRL	1,234 \$	381	1	0
GLM	03/2018	CNH	1,305	203	0	(3)
GLM	03/2018	CNY	122	19	0	0
GLM	03/2018	EUR	501	618	7	0
GLM	03/2018	JPY	9,473	88	0	(1)
GLM	03/2018	MYR	536	136	0	0
GLM	03/2018	\$	135 ARS	2,708	0	(2)
GLM	03/2018		379 BRL	1,234	0	0
GLM	03/2018		17 CNH	114	1	0
GLM	03/2018		96 CZK	1,984	0	(1)
GLM	03/2018		53 HUF	13,854	1	0
GLM	03/2018		84 MXN	1,559	0	(1)
GLM	03/2018		127 MYR	536	9	0
GLM	03/2018		45 PEN	146	0	0
GLM	03/2018		127 RUB	7,224	1	0
GLM	03/2018		1	57	0	0
GLM	03/2018		10 THB	325	0	0
GLM	04/2018	EUR	100 \$	119	0	(3)
GLM	04/2018	PHP	4,203	80	0	0
GLM	04/2018	\$	619 EUR	501	0	(7)
GLM	04/2018		57 KRW	64,746	3	0
GLM	05/2018	SEK	12,750 \$	1,589	40	0
GLM	05/2018	\$	1,132 AUD	1,447	0	(4)
GLM	05/2018		727 EUR	587	0	(7)
GLM	05/2018		2,053 JPY	221,233	32	0
GLM	05/2018	ZAR	308 \$	25	0	0
GLM	06/2018	\$	136 MYR	536	0	0
HUS	03/2018	ARS	400 \$	20	0	0

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益			
				資産	負債		
HUS	03/2018	CAD	22	17	0	0	
HUS	03/2018	CNY	6,217	984	3	0	
HUS	03/2018	COP	14,225	5	0	0	
HUS	03/2018	INR	4,416	69	1	0	
HUS	03/2018	JPY	4,161	39	0	0	
HUS	03/2018		1,503	14	0	0	
HUS	03/2018	KRW	72,849	67	0	0	
HUS	03/2018	PEN	158	49	1	0	
HUS	03/2018	SGD	99	74	0	0	
HUS	03/2018	\$	523	IDR	7,116,593	0	(7)
HUS	03/2018		68	INR	4,416	0	0
HUS	03/2018		50	JPY	5,462	1	0
HUS	03/2018		42	RUB	2,355	0	0
HUS	03/2018		39	SGD	52	1	0
HUS	04/2018	ARS	100	\$	5	0	0
HUS	04/2018	KRW	9,078		8	0	0
HUS	04/2018	\$	40	DKK	245	0	0
HUS	04/2018		369	EUR	300	0	(1)
HUS	05/2018		72	CAD	90	0	(1)
HUS	05/2018		829	RUB	48,059	17	0
HUS	06/2018	IDR	5,173,073	\$	375	3	0
HUS	06/2018	\$	978	CNY	6,217	0	(4)
HUS	06/2018		67	KRW	72,849	0	0
HUS	06/2018		74	SGD	99	0	0
HUS	08/2018		7	ARS	145	0	0
HUS	12/2018		103	AUD	130	0	(2)
HUS	02/2019		56		70	0	(1)
IND	03/2018	CZK	2,019	\$	99	2	0
IND	03/2018	MXN	1,739		93	1	0
JPM	03/2018	BRL	4,117		1,264	0	(4)
JPM	03/2018	IDR	162,996		12	0	0
JPM	03/2018	INR	960		15	0	0
JPM	03/2018	PEN	45		14	0	0
JPM	03/2018	\$	1,269	BRL	4,117	0	(2)
JPM	03/2018		15	INR	960	0	0
JPM	03/2018		91		5,832	0	(2)
JPM	03/2018		176	JPY	19,252	5	0
JPM	03/2018		55	PEN	178	0	0
JPM	04/2018	EUR	500	\$	598	0	(14)
JPM	04/2018	KRW	78,680		70	0	(3)
JPM	04/2018	\$	1,260	BRL	4,117	3	0
JPM	04/2018		473	DKK	2,880	4	(4)
JPM	04/2018		50	KRW	56,340	2	0
MSB	03/2018	JPY	10,000	\$	89	0	(4)
MSB	03/2018	KRW	12,826		12	0	0
MSB	03/2018	THB	8,327		266	1	0
MSB	03/2018	\$	64	RUB	3,632	0	0
MSB	03/2018		144		8,686	10	0
MSB	03/2018		242	THB	8,001	13	0
MSB	04/2018	KRW	54,470	\$	48	0	(2)
MSB	05/2018	JPY	100,000		920	0	(22)
MSB	05/2018	\$	499	NOK	3,915	0	(1)
MSB	06/2018		267	THB	8,327	0	(1)
MSB	08/2018		1	ARS	27	0	0
NGF	03/2018		27	KRW	28,650	0	(1)
RBC	04/2018	EUR	301	\$	351	0	(17)

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益	
						資産	負債
RBC	05/2018	\$	63	AUD	80	0	0
RYL	03/2018		90	CAD	113	0	(2)
SCX	03/2018	CNH	1,113	\$	174	0	(2)
SCX	03/2018	IDR	7,651,564		560	5	0
SCX	03/2018	INR	66,273		1,018	4	0
SCX	03/2018	\$	382	CNH	2,424	1	0
SCX	03/2018		242	IDR	3,262,797	0	(5)
SCX	03/2018		15		200,340	0	0
SCX	03/2018		1,207	INR	79,624	11	0
SCX	06/2018		1,006		66,273	0	(5)
SOG	03/2018	CZK	3,156	\$	152	0	0
SOG	03/2018	\$	59	CZK	1,265	2	0
SOG	03/2018		27	RUB	1,554	1	0
SOG	04/2018		234	PLN	784	0	(5)
SOG	05/2018		152	CZK	3,156	0	0
SOG	05/2018		68	ILS	231	0	(2)
SOG	06/2018	RUB	1,554	\$	27	0	(1)
SOG	08/2018	\$	1	ARS	30	0	0
SSB	03/2018		95	CZK	1,926	0	(2)
TOR	03/2018		45	KRW	47,831	0	(1)
UAG	03/2018	HKD	975	\$	125	0	0
UAG	03/2018	INR	19,190		300	6	0
UAG	03/2018	KRW	604,396		570	11	0
UAG	03/2018	\$	474	KRW	527,916	13	0
UAG	04/2018	EUR	601	\$	707	0	(30)
UAG	04/2018	KRW	1,135		1	0	0
UAG	04/2018	\$	162	DKK	1,010	4	0
UAG	05/2018	JPY	40,000	\$	367	0	(9)
UAG	06/2018	\$	125	HKD	975	0	0
UAG	06/2018		571	KRW	604,396	0	(11)
						\$ 339	\$ (436)

● Institutional FC (JPY, Hedged)およびJ (JPY, Hedged)の外国為替先渡し契約

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益					
				資産	負債				
BOA	03/2018	CAD	467	\$	378	\$	13	\$	0
BOA	03/2018	JPY	5,300		49		0		0
BOA	03/2018	\$	288	AUD	365		0		(3)
BOA	04/2018	AUD	365	\$	288		3		0
BOA	04/2018	DKK	567		92		0		(1)
BPS	03/2018	EUR	2,367		2,940		53		0
BPS	03/2018	JPY	490,316		4,582		0		(13)
BPS	04/2018	\$	4,593	JPY	490,316		13		0
CBK	03/2018	AUD	365	\$	296		11		0
CBK	03/2018	\$	46	CHF	43		0		(1)
CBK	03/2018		113	EUR	91		0		(2)
CBK	03/2018		599	GBP	427		0		(11)
CBK	04/2018	GBP	427	\$	600		11		0
DUB	03/2018		457		645		16		0
FBF	03/2018	JPY	1,372		13		0		0
FBF	03/2018		372,743		3,481		0		(12)
FBF	03/2018	NZD	12		9		0		0
FBF	04/2018	\$	3,502	JPY	374,115		12		0
GLM	03/2018	NOK	679	\$	88		2		0
GLM	03/2018	\$	2,796	EUR	2,267		0		(31)
GLM	03/2018		43	GBP	30		0		(1)
GLM	04/2018	EUR	2,267	\$	2,803		31		0
HUS	03/2018	JPY	10,263		96		0		0
HUS	03/2018	\$	370	CAD	467		0		(5)
HUS	03/2018		13	JPY	1,372		0		0
HUS	04/2018	CAD	467	\$	370		5		0
JPM	03/2018	CHF	184		197		2		0
JPM	03/2018	\$	151	CHF	141		0		(2)
JPM	03/2018		11	EUR	9		0		0
JPM	03/2018		3,376	JPY	366,647		60		0
JPM	04/2018	CHF	141	\$	152		2		0
MSB	03/2018	JPY	489,783		4,591		1		0
MSB	04/2018	\$	4,601	JPY	489,783		0		0
NAB	03/2018		4,567		496,385		85		0
SCX	03/2018	SEK	1,089	\$	138		7		0
SSB	03/2018	\$	4,565	JPY	495,110		75		0
						\$	402	\$	(82)
外国為替先渡し契約合計						\$	741	\$	(518)

●買建オプション 金利スワップション

単位:千

取引 相手	銘柄	変動金利 インデックス	変動金利 支払/受取	行使レート	満期日	想定元本	費用	市場価格
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	受取	2.400%	03/14/2018	\$ 1,700	\$ 1	\$ 0
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	受取	2.400%	03/14/2018	8,900	7	2
							\$ 8	\$ 2

外国通貨オプション

単位:千

取引 相手	銘柄		行使価格	満期日	想定元本	費用	市場価格	
BOA	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	120.000	04/17/2020	\$ 147	\$ 3	\$ 1	
DUB	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	\$	1.201	01/22/2019	EUR 200	3	3	
DUB	Put - OTC Euro versus U.S. dollar		1.219	02/05/2019	315	4	6	
DUB	Call - OTC U.S. dollar versus Canadian dollar	CAD	1.288	04/06/2018	\$ 200	1	2	
DUB	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	120.000	04/17/2020	96	2	0	
FBF	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.794	03/16/2018	AUD 14	0	0	
FBF	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.794	03/16/2018	14	0	0	
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	120.000	04/20/2020	\$ 165	3	1	
HUS	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.735	02/05/2019	AUD 400	4	4	
HUS	Put - OTC Euro versus U.S. dollar		1.219	02/05/2019	EUR 44	1	1	
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	111.200	03/15/2018	\$ 100	0	0	
IND	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.794	03/16/2018	AUD 216	2	0	
IND	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.794	03/16/2018	216	2	3	
JPM	Put - OTC British pound versus U.S. dollar		1.315	05/04/2018	GBP 169	1	1	
JPM	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	111.200	03/09/2018	\$ 200	1	0	
MSB	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.794	03/16/2018	AUD 120	1	0	
MSB	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.794	03/16/2018	120	1	2	
RYL	Call - OTC U.S. dollar versus Canadian dollar	CAD	1.283	03/08/2018	\$ 200	1	1	
							\$ 30	\$ 25
							\$ 38	\$ 27

買建オプション合計

●売建オプション クレジットデフォルトスワップション

単位:千

取引 相手	銘柄	プロテクション 買い/売り	行使レート	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	市場価格
BRC	Call - iTraxx Europe Series 28 Index	買い	0.475%	04/18/2018	EUR 1,200	\$ (1)	\$ (1)
BRC	Put - iTraxx Europe Series 28 Index	売り	0.700%	04/18/2018	1,200	(1)	(1)
						\$ (2)	\$ (2)

外国通貨オプション

単位:千

取引 相手	銘柄		行使価格	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	市場価格
BPS	Put - OTC U.S. dollar versus South Korean won	KRW	1,075.000	04/25/2018	\$ 56	\$ (1)	\$ (1)
CBK	Put - OTC British pound versus U.S. dollar	\$	1.295	05/04/2018	GBP 284	(3)	(1)
DUB	Call - OTC Euro versus U.S. dollar		1.332	01/22/2019	EUR 200	(3)	(2)
DUB	Call - OTC Euro versus U.S. dollar		1.357	02/05/2019	315	(4)	(3)
DUB	Put - OTC U.S. dollar versus Canadian dollar	CAD	1.229	04/06/2018	\$ 200	(1)	0
FBF	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.796	08/16/2018	AUD 14	0	0
FBF	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.796	08/16/2018	14	0	0
GLM	Call - OTC Australian dollar versus Canadian dollar	CAD	1.024	06/29/2018	200	(1)	(1)
GLM	Put - OTC Australian dollar versus Canadian dollar		0.961	06/29/2018	200	(1)	(1)
GLM	Put - OTC Canadian dollar versus Japanese yen	¥	76.700	06/19/2018	CAD 200	(3)	(1)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Brazilian real	BRL	3.892	07/02/2018	\$ 200	(19)	0
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Brazilian real		3.892	07/02/2018	200	(19)	(37)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus South Korean won	KRW	1,075.000	04/20/2018	165	(3)	(2)
HUS	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.825	12/04/2018	AUD 400	(5)	(3)
HUS	Call - OTC Euro versus U.S. dollar		1.357	02/05/2019	EUR 44	(1)	0
IND	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.796	08/16/2018	AUD 44	(1)	0
IND	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.796	08/16/2018	44	(1)	(1)
JPM	Call - OTC Australian dollar versus Canadian dollar	CAD	1.024	06/29/2018	209	(1)	(1)
JPM	Put - OTC Australian dollar versus Canadian dollar		0.961	06/29/2018	209	(1)	(1)
JPM	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	107.000	03/09/2018	\$ 200	(1)	(1)
JPM	Put - OTC U.S. dollar versus South Korean won	KRW	1,075.000	04/25/2018	153	(3)	(2)
MSB	Call - OTC Australian dollar versus U.S. dollar	\$	0.796	08/16/2018	AUD 36	(1)	0
MSB	Put - OTC Australian dollar versus U.S. dollar		0.796	08/16/2018	36	(1)	(1)
RYL	Put - OTC U.S. dollar versus Canadian dollar	CAD	1.240	03/08/2018	\$ 200	(1)	0
						\$ (75)	\$ (59)

インフレーションキャップドオプション

単位:千

取引 相手	銘柄	インシャル インデックス	変動金利	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	市場価格
CBK	Floor - OTC CPURNSA Index	216.687	Maximum of [1 - (Index Final/Index Initial) or \$0]	04/07/2020	\$ 500	\$ (4)	\$ 0
DUB	Floor - OTC CPURNSA Index	218.011	Maximum of [-(Final Index/Initial Index -1), 0]	10/13/2020	100	(1)	0
						\$ (5)	\$ 0
売建オプション合計						\$ (82)	\$ (61)

●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－買い

取引 相手	参照債務	支払		2018/2/28時点の		プレミアム (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
		固定金利	満期日	信用スプレッド	想定元本			資産	負債
BPS	Japan Government International Bond	(1.000%)	06/20/2022	0.166%	\$ 100	\$ (4)	\$ 0	\$ 0	\$ (4)
BRC	Japan Government International Bond	(1.000%)	06/20/2022	0.166%	100	(3)	0	0	(3)
CBK	Japan Government International Bond	(1.000%)	06/20/2022	0.166%	100	(4)	0	0	(4)
GST	Japan Government International Bond	(1.000%)	06/20/2022	0.166%	200	(7)	0	0	(7)
						\$ (18)	\$ 0	\$ 0	\$ (18)

単位:千

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－売り

取引 相手	参照債務	受取		2018/2/28時点の		プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
		固定金利	満期日	信用スプレッド	想定元本			資産	負債
BPS	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2021	1.204%	\$ 100	\$ (6)	\$ 6	\$ 0	\$ 0
BRC	Indonesia Government International Bond	1.000%	03/20/2024	1.098%	100	(14)	13	0	(1)
BRC	Mexico Government International Bond	1.000%	06/20/2022	0.938%	500	0	2	2	0
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.006%	200	(2)	3	1	0
CBK	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2021	0.810%	300	(10)	12	2	0
DUB	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2022	1.395%	150	(5)	3	0	(2)
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.547%	100	(5)	3	0	(2)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.006%	100	(1)	1	0	0
GST	Mexico Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.049%	700	(4)	4	0	0
GST	Russia Government International Bond	1.000%	12/20/2021	0.810%	100	(3)	4	1	0
GST	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2022	1.300%	300	(13)	10	0	(3)
HUS	Brazil Government International Bond	1.000%	03/20/2018	0.377%	100	0	0	0	0
HUS	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2021	0.740%	100	(4)	5	1	0
HUS	Colombia Government International Bond	1.000%	12/20/2022	1.006%	100	(1)	1	0	0
HUS	Indonesia Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.967%	25	(2)	2	0	0
JPM	Indonesia Government International Bond	1.000%	06/20/2023	0.967%	200	(2)	3	1	0
						\$ (72)	\$ 72	\$ 8	\$ (8)

単位:千

クレジットデフォルトスワップ(クレジットインデックス)－買い

取引 相手	インデックス/トランシェ	支払		想定元本	プレミアム支払額	未実現 評価損益	スワップ契約時価		
		固定金利	満期日				資産	負債	
BPS	iTraxx Europe Sub Financials Series 27 Index	(1.000%)	06/20/2022	EUR	100 \$	5 \$	(6) \$	0 \$	(1)

単位:千

クロス通貨スワップ

単位:千

取引 相手	受取	支払	満期日	想定元本 通貨受取	想定元本 通貨支払	プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価			
								資産	負債		
BPS	Floating rate equal to 3-Month Australian Bank Bill plus 0.362% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	09/26/2027	\$ 159	AUD 200	\$ 1	\$ (3)	\$ 0	\$ (2)		
BPS	Floating rate equal to 3-Month Australian Bank Bill plus 0.368% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	10/05/2027	79	100	0	(1)	0	(1)		
MYC	Floating rate equal to 3-Month Australian Bank Bill plus 0.368% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	10/06/2027	34	43	0	0	0	0		
RYL	Floating rate equal to 3-Month GBP-LIBOR less 0.055% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	10/13/2026	122	GBP 100	3	12	15	0		
								\$ 4	\$ 8	\$ 15	\$ (3)

金利スワップ

単位:千

取引 相手	変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価			
								資産	負債		
BOA	受取	3-Month TELBOR	0.370%	06/20/2020	ILS 1,200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0		
BOA	支払	3-Month TELBOR	1.998%	06/20/2028	300	0	1	1	0		
BRC	受取	3-Month TELBOR	0.374%	06/20/2020	5,000	0	0	0	0		
BRC	支払	3-Month TELBOR	1.950%	06/20/2028	1,100	0	0	0	0		
CBK	支払	6-Month Thailand Fixing Rate	2.810%	05/18/2037	THB 2,600	0	2	2	0		
CBK	受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	1.995%	07/10/2027	KRW 211,900	0	7	7	0		
CBK	受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	1.928%	08/02/2027	200,000	0	8	8	0		
GLM	受取	3-Month TELBOR	0.270%	03/21/2020	ILS 2,500	0	0	0	0		
GLM	受取	3-Month TELBOR	0.370%	06/20/2020	2,600	0	0	0	0		
GLM	支払	3-Month TELBOR	1.883%	03/21/2028	600	0	0	0	0		
GLM	支払	3-Month TELBOR	1.998%	06/20/2028	600	0	1	1	0		
HUS	受取	3-Month TELBOR	0.370%	06/20/2020	700	0	0	0	0		
HUS	支払	3-Month TELBOR	1.998%	06/20/2028	200	0	0	0	0		
JPM	受取	3-Month TELBOR	0.420%	06/20/2020	2,800	0	(1)	0	(1)		
JPM	支払	3-Month TELBOR	2.078%	06/20/2028	600	0	2	2	0		
SOG	受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	2.025%	07/10/2027	KRW 410,200	0	13	13	0		
								\$ 0	\$ 33	\$ 34	\$ (1)
スワップ契約合計								\$ (81)	\$ 107	\$ 57	\$ (31)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2017年8月21日）

作成対象期間（2016年8月20日～2017年8月21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	本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式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	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		騰	落			
11期(2013年8月19日)	円 10,191		% 0.1	% 80.9	% -	百万円 5,297
12期(2014年8月19日)	10,199		0.1	59.7	-	8,648
13期(2015年8月19日)	10,206		0.1	44.7	-	22,034
14期(2016年8月19日)	10,211		0.0	68.6	-	19,722
15期(2017年8月21日)	10,208		△0.0	64.0	-	17,754

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

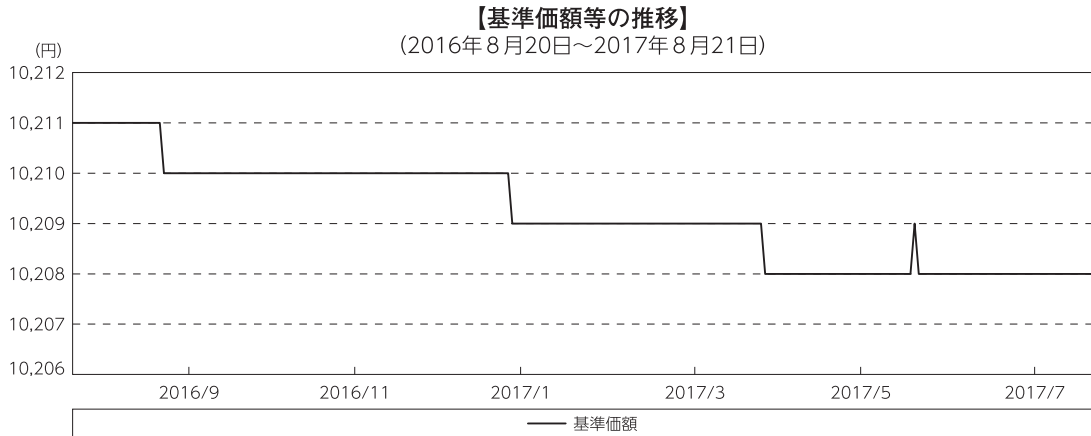
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落		
(期首) 2016年8月19日	円 10,211		% -	% 68.6	% -
8月末	10,211		0.0	66.8	-
9月末	10,210		△0.0	55.4	-
10月末	10,210		△0.0	67.1	-
11月末	10,210		△0.0	81.1	-
12月末	10,210		△0.0	54.1	-
2017年1月末	10,209		△0.0	49.7	-
2月末	10,209		△0.0	48.6	-
3月末	10,209		△0.0	29.2	-
4月末	10,208		△0.0	75.0	-
5月末	10,208		△0.0	73.1	-
6月末	10,208		△0.0	65.4	-
7月末	10,208		△0.0	60.1	-
(期末) 2017年8月21日	10,208		△0.0	64.0	-

*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



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、高水準にある企業収益や雇用・所得環境の改善継続等を背景に、緩やかな回復基調が続きました。

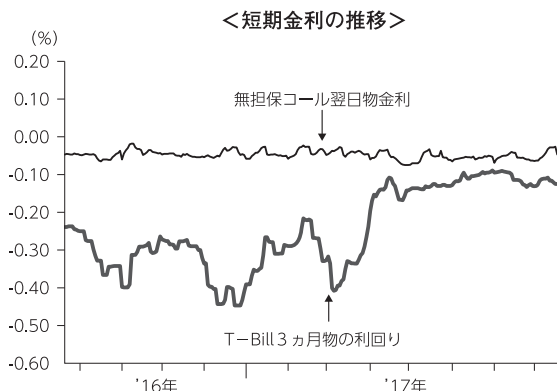
このような中、日本銀行は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を継続し、2016年9月には、これらの政策枠組みを強化する意味合いから「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入しました。

・無担保コール翌日物金利の推移

マイナス金利政策のもと、 -0.05% 程度で推移しました。

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

日本銀行による買入や海外勢を中心とした投資家需要が続く中、3月下旬までの間、利回りは $-0.2\% \sim -0.4\%$ 程度で推移しました。その後は、投資家の需要減退等を背景に利回りは上昇し、期末には -0.14% となりました。



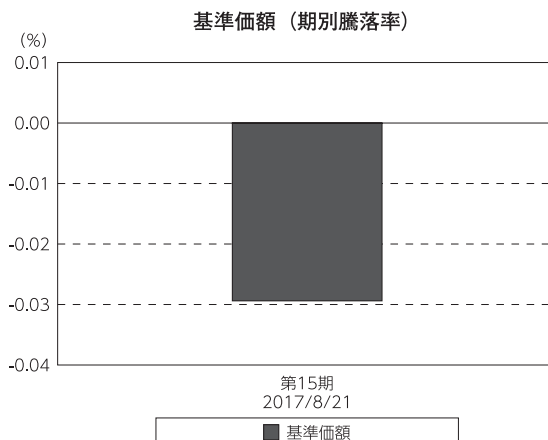
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

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

(2016年8月20日～2017年8月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年8月20日～2017年8月21日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	26,957,668	26,957,639
	地方債証券	7,885,120	—
	特殊債券	18,040,131	—
	社債券（投資法人債券を含む）	16,069,442	—
			(6,738,010)
			(23,825,000)
			—
			(13,490,000)

*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す。

*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。

その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	3,599,972	—
			(3,900,000)

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2016年8月20日～2017年8月21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		B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D		D C
		百万円	百万円			百万円	百万円	
公社債	41,994	4,092	9.7	—	—	—	—	—

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

(2017年8月21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B B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	%	%	%	%	%	%
地方債証券	4,020,000	4,031,567	22.7	—	—	—	—	22.7
	(4,020,000)	(4,031,567)	(22.7)	(—)	(—)	(—)	(—)	(22.7)
特殊債券 (除く金融債)	1,205,000	1,207,280	6.8	—	—	—	—	6.8
	(1,205,000)	(1,207,280)	(6.8)	(—)	(—)	(—)	(—)	(6.8)
金融債券	2,090,000	2,090,748	11.8	—	—	—	—	11.8
	(2,090,000)	(2,090,748)	(11.8)	(—)	(—)	(—)	(—)	(11.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	4,030,000	4,034,993	22.7	—	—	—	—	22.7
	(4,030,000)	(4,034,993)	(22.7)	(—)	(—)	(—)	(—)	(22.7)
合 計	11,345,000	11,364,590	64.0	—	—	—	—	64.0
	(11,345,000)	(11,364,590)	(64.0)	(—)	(—)	(—)	(—)	(64.0)

* ()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	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第651回	1.62	50,000	50,062	2017/9/20
神奈川県 公募(5年)第52回	0.26	360,000	360,089	2017/9/20
神奈川県 公募(5年)第53回	0.231	480,000	480,101	2017/9/20
大阪府 公募(5年)第86回	0.23	100,000	100,024	2017/9/27
大阪府 公募(5年)第89回	0.2	190,000	190,132	2017/12/27
京都府 公募平成24年度第9回	0.14	30,000	30,027	2018/3/22
静岡県 公募(5年)平成24年度第8回	0.236	170,000	170,059	2017/10/18
岐阜県 公募平成19年度第1回	1.87	150,000	150,496	2017/10/26
共同発行市場地方債 公募第54回	1.7	100,000	100,161	2017/9/25
共同発行市場地方債 公募第57回	1.65	900,000	905,079	2017/12/25
共同発行市場地方債 公募第58回	1.59	100,000	100,666	2018/1/25
大阪市 公募平成19年度第10回	1.74	800,000	804,416	2017/12/19
鹿児島県 公募(5年)平成24年度第1回	0.22	590,000	590,251	2017/10/31
小 計		4,020,000	4,031,567	
特殊債券(除く金融債)				
公営企業債券 政府保証第885回	1.7	33,000	33,414	2018/5/22
政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第1回	0.4	70,000	70,033	2017/9/27
政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第3回	0.4	20,000	20,034	2018/1/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第47回	1.5	4,000	4,020	2017/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第49回	1.5	42,000	42,274	2018/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第52回	1.6	44,000	44,360	2018/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第56回	1.4	25,000	25,228	2018/4/20
東日本高速道路債券 政府保証第10回	1.5	77,000	77,375	2017/12/21
新関西国際空港社債 財投機関債第10回	0.161	260,000	260,031	2017/9/20
首都高速道路 第11回	0.279	500,000	500,462	2017/12/20
東日本高速道路 第18回	0.387	130,000	130,045	2017/9/20
小 計		1,205,000	1,207,280	
金融債券				
商工債券 利付第748回い号	0.3	200,000	200,069	2017/9/27
商工債券 利付第751回い号	0.25	120,000	120,100	2017/12/27
農林債券 利付第747回い号	0.35	370,000	370,020	2017/8/25
しんきん中金債券 利付第274回	0.3	1,000,000	1,000,317	2017/9/27
商工債券 利付(3年)第179回	0.14	400,000	400,240	2017/12/27
小 計		2,090,000	2,090,748	
普通社債券(含む投資法人債券)				
関西電力 第400回	3.1	100,000	100,041	2017/8/25
関西電力 第458回	1.83	100,000	100,145	2017/9/20
北陸電力 第288回	1.89	240,000	240,754	2017/10/25
四国電力 第265回	1.79	300,000	300,065	2017/8/25
四国電力 第276回	0.592	200,000	200,111	2017/9/25
九州電力 第417回	0.641	340,000	340,036	2017/8/25
北海道電力 第293回	1.86	100,000	100,169	2017/9/25
北海道電力 第322回	0.3	350,000	350,348	2017/12/25
トヨタ自動車 第12回社債間限定同等特約付	0.317	500,000	500,142	2017/9/20
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付	0.33	300,000	300,177	2017/10/25
三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付	0.442	300,000	301,250	2018/8/6

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
住友不動産 第84回社債間限定同順位特約付		0.388	100,000	100,196	2018/2/28
東日本旅客鉄道 第7回社債間限定同順位特約付		3.3	600,000	600,236	2017/8/25
東日本旅客鉄道 第50回社債間限定同順位特約付		1.86	100,000	100,153	2017/9/20
東海旅客鉄道 第3回		2.825	200,000	201,066	2017/10/30
電源開発 第34回社債間限定同順位特約付		0.592	200,000	200,095	2017/9/20
小 計			4,030,000	4,034,993	
合 計			11,345,000	11,364,590	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 899,993	% 5.1

* 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。

○投資信託財産の構成

(2017年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 11,364,590	% 63.6
その他有価証券	899,993	5.0
コール・ローン等、その他	5,590,335	31.4
投資信託財産総額	17,854,918	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 (2017年8月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,854,918,800
コール・ローン等	5,549,998,539
公社債(評価額)	11,364,590,303
その他有価証券	899,993,268
未収利息	18,125,679
前払費用	22,211,011
(B) 負債	100,793,362
未払金	100,679,000
未払解約金	106,947
未払利息	7,415
(C) 純資産総額(A-B)	17,754,125,438
元本	17,392,173,897
次期繰越損益金	361,951,541
(D) 受益権総口数	17,392,173,897口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,208円

(注) 期首元本額は19,315,765,955円、期中追加設定元本額は2,507,553,179円、期中一部解約元本額は4,431,145,237円、1口当たり純資産額は1.0208円です。

○損益の状況 (2016年8月20日～2017年8月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	95,706,562
受取利息	98,717,375
支払利息	△ 3,010,813
(B) 有価証券売買損益	△100,546,660
売買損	△100,546,660
(C) 当期損益金(A+B)	△ 4,840,098
(D) 前期繰越損益金	406,859,951
(E) 追加信託差損益金	52,555,651
(F) 解約差損益金	△ 92,623,963
(G) 計(C+D+E+F)	361,951,541
次期繰越損益金(G)	361,951,541

*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(E)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(F)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
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30 (非課税適格機関投資家専用)	5,423,785,404
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50 (適格機関投資家監査制限付)	4,206,288,588
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプラス(適格機関投資家専用)	3,161,244,481
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプラス(適格機関投資家専用)	2,296,160,091
日本株インカムプラス _a (公社債運用移行型)1305(適格機関投資家監査制限付)	969,401,962
野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	436,168,504
野村世界高金利通貨投信	151,953,753
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06	146,986,772
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	98,153,976
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09	98,039,216
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	49,417,625
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623
ネクストコア	19,922,154
野村新中國株投資 マネーボール・ファンド	14,424,815
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	10,258,341
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド	6,983,416
野村新米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	6,929,426
野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド	5,350,038
野村グローバルCB投信(マネーボールファンド)年2回決算型	3,826,372
野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド	3,459,024
野村新エマーズン債投信(マネーボールファンド)年2回決算型	3,279,122

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネーボールファンド)年2回決算型	3,123,334
米国変動好金利ファンド Aコース	2,952,997
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	1,937,870
野村・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド	1,020,305
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチュ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
第1回 野村短期公社債ファンド	98,261
第2回 野村短期公社債ファンド	98,261
第3回 野村短期公社債ファンド	98,261
第4回 野村短期公社債ファンド	98,261
第5回 野村短期公社債ファンド	98,261
第6回 野村短期公社債ファンド	98,261
第7回 野村短期公社債ファンド	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
第11回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	98,146
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	82,780
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	80,956
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	58,906
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	52,622
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
野村新興国高配当株トリプルウィング ブラジルリアル毎月分配型	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	4,908
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	1,967
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	1,963

〇お知らせ

スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

<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よろしくお願いいたします。

(2018年6月25日現在)

年 月	日
2018年6月	—
7月	4
8月	—
9月	3
10月	—
11月	22
12月	25

※2018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。