

野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース

運用報告書(全体版)

第72期(決算日2015年7月27日) 第73期(決算日2015年8月25日) 第74期(決算日2015年9月25日)
第75期(決算日2015年10月26日) 第76期(決算日2015年11月25日) 第77期(決算日2015年12月25日)

作成対象期間(2015年6月26日～2015年12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。
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・ファンドーJ(JPY)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・ファンドーJ(JPY)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 Bコース	PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドーJ(JPY)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・ファンドーJ(JPY)	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 B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	基準額 (分配落)	価額		参考	指数		純資産額
		税分	み達金騰落		期騰落	中率	
	円		円			%	百万円
48期(2013年7月25日)	10,821		20	4.8	130.91	4.8	184
49期(2013年8月26日)	10,471		20	△3.0	127.33	△2.7	178
50期(2013年9月25日)	10,714		20	2.5	130.24	2.3	180
51期(2013年10月25日)	10,756		20	0.6	131.10	0.7	179
52期(2013年11月25日)	10,982		20	2.3	133.70	2.0	176
53期(2013年12月25日)	11,213		20	2.3	137.40	2.8	178
54期(2014年1月27日)	11,019		20	△1.6	135.02	△1.7	175
55期(2014年2月25日)	11,131		20	1.2	136.47	1.1	176
56期(2014年3月25日)	11,081		20	△0.3	136.47	0.0	168
57期(2014年4月25日)	11,227		20	1.5	138.48	1.5	167
58期(2014年5月26日)	11,325		20	1.1	139.65	0.8	169
59期(2014年6月25日)	11,458		20	1.4	140.72	0.8	168
60期(2014年7月25日)	11,392		20	△0.4	140.53	△0.1	166
61期(2014年8月25日)	11,495		20	1.1	142.62	1.5	164
62期(2014年9月25日)	11,760		20	2.5	146.16	2.5	167
63期(2014年10月27日)	11,617		20	△1.0	145.14	△0.7	165
64期(2014年11月25日)	12,538		20	8.1	156.50	7.8	158
65期(2014年12月25日)	12,410		20	△0.9	155.50	△0.6	154
66期(2015年1月26日)	12,135		20	△2.1	151.26	△2.7	151
67期(2015年2月25日)	12,203		20	0.7	152.74	1.0	149
68期(2015年3月25日)	12,173		20	△0.1	152.30	△0.3	147
69期(2015年4月27日)	12,071		20	△0.7	151.79	△0.3	143
70期(2015年5月25日)	12,154		20	0.9	153.72	1.3	131
71期(2015年6月25日)	12,279		20	1.2	155.99	1.5	130
72期(2015年7月27日)	12,074		20	△1.5	153.52	△1.6	128
73期(2015年8月25日)	11,578		20	△3.9	148.49	△3.3	123
74期(2015年9月25日)	11,398		20	△1.4	146.66	△1.2	123
75期(2015年10月26日)	11,676		20	2.6	150.48	2.6	125
76期(2015年11月25日)	11,646		20	△0.1	149.99	△0.3	124
77期(2015年12月25日)	11,369		20	△2.2	147.11	△1.9	122

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*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（ヘッジなし・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。

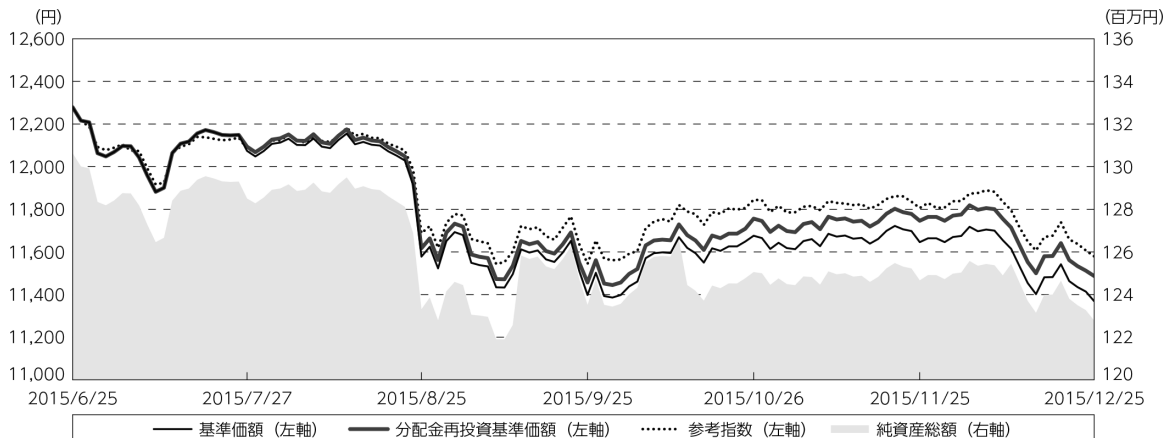
○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	参 考 指 数	
			騰 落 率	騰 落 率
第72期	(期 首) 2015年6月25日	円 12,279	% —	155.99 —
	6月末	12,063	△1.8	153.63 △1.5
	(期 末) 2015年7月27日	12,094	△1.5	153.52 △1.6
第73期	(期 首) 2015年7月27日	12,074	—	153.52 —
	7月末	12,113	0.3	154.02 0.3
	(期 末) 2015年8月25日	11,598	△3.9	148.49 △3.3
第74期	(期 首) 2015年8月25日	11,578	—	148.49 —
	8月末	11,693	1.0	149.63 0.8
	(期 末) 2015年9月25日	11,418	△1.4	146.66 △1.2
第75期	(期 首) 2015年9月25日	11,398	—	146.66 —
	9月末	11,386	△0.1	146.87 0.1
	(期 末) 2015年10月26日	11,696	2.6	150.48 2.6
第76期	(期 首) 2015年10月26日	11,676	—	150.48 —
	10月末	11,618	△0.5	149.72 △0.5
	(期 末) 2015年11月25日	11,666	△0.1	149.99 △0.3
第77期	(期 首) 2015年11月25日	11,646	—	149.99 —
	11月末	11,646	0.0	150.02 0.0
	(期 末) 2015年12月25日	11,389	△2.2	147.11 △1.9

* 期末基準価額は分配金込み、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



- (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(2015年6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PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス(ヘッジなし・円ベース)です。作成期首(2015年6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、保有している利付き債からのクーポン収入がプラスに寄与したこと
- ・ 投資している債券の価格が下落したことがマイナスに影響したこと

○投資環境

・先進国国債

米国債券市場は、当作成期間では、利回りは下落(価格は上昇)傾向で推移しました。米国の主要経済指標やFRB(米連邦準備制度理事会)の動向などに左右されました。

欧州債券市場は、当作成期間では、利回りは下落傾向で推移しました。ECB(欧州中央銀行)の動向や中国経済の動向などに左右されました。

・新興国国債

当作成期首から9月末頃にかけては中国経済の減速に対する懸念を受け、概ね下落基調で推移しました。その後、中国人民銀行（中央銀行）による緩和策などにより投資家心理が改善し上昇したものの、年末にかけての原油価格の下落を受け、概ね下落基調で推移しました。

・投資適格社債

米国の投資適格社債は、FRBの動向などに左右され、概ね下落基調で推移しました。

・モーゲージ債

当作成期首から10月末頃にかけては、より高い利回りを求める投資家が同資産を買う動きがみられたことなどから概ね上昇基調で推移しました。当作成期末にかけては米国の利上げ観測の高まりにより下落基調で推移し、通期では概ね横ばいで推移しました。

・為替市場

ドル・円相場は、米国の利上げ観測や中国経済の減速に対する先行き懸念などに左右され、ドルに対して円高が進行しました。

ユーロ・円相場は、ECBに対する追加緩和への期待などからユーロに対して円高が進行しました。

○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 Bコース〕

〔野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 B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・ファンドーJ（JPY）〕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・ファンドーJ（JPY）〕

<国・地域別比率（純資産比）>

国・地域別配分については、'15年11月末で米国28.5%、ユーロ圏24.0%、ブラジル12.2%、メキシコ10.1%、英国9.8%、香港6.0%、カナダ5.3%、その他の国・地域33.6%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、'15年11月末で先進国国債等36.5%、新興国国債等25.9%、社債27.0%、モーゲージ債16.5%、新興国通貨23.7%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、'15年11月末でAAA格28.4%、AA格9.4%、A格22.7%、BBB格25.7%、BB格9.0%、B格以下10.7%、新興国通貨23.7%としました。

〔野村マネー マザーファンド〕

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー（CP）等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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。

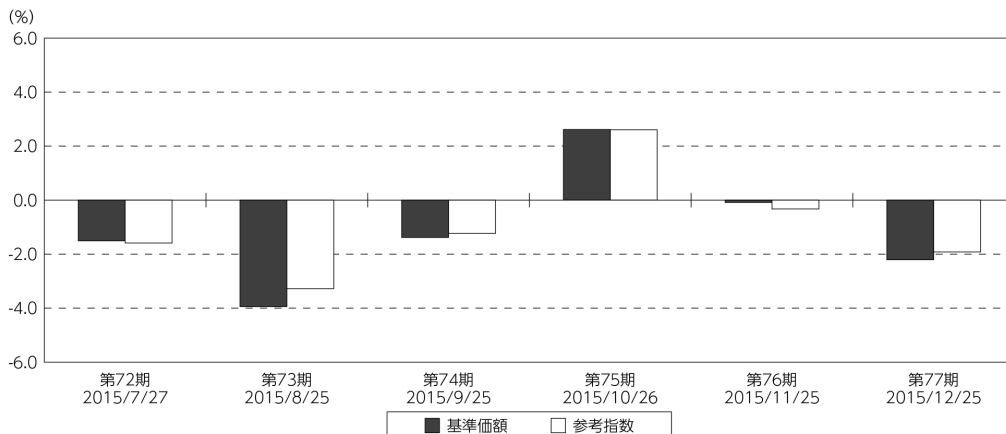
○当ファンドのベンチマークとの差異

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 -6.5% ※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（ヘッジなし・円ベース）は -5.7% となりました。保有する債券の値下がりなどがマイナスに影響しました。

※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（ヘッジなし・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、1万口当たり・税込み)

項 目	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期
	2015年6月26日～ 2015年7月27日	2015年7月28日～ 2015年8月25日	2015年8月26日～ 2015年9月25日	2015年9月26日～ 2015年10月26日	2015年10月27日～ 2015年11月25日	2015年11月26日～ 2015年12月25日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.165%	0.172%	0.175%	0.171%	0.171%	0.176%
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,190	3,198	3,206	3,225	3,234	3,242

(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 B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・ファンドーJ (JPY)] 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・ファンドーJ (JPY)]

世界経済は、低水準で推移する原油価格が時間をかけて先進国経済を中心にプラスに働くなか、米国を中心に緩やかな景気回復が継続すると予想しています。米国では雇用市場の改善や原油価格の下落を背景に消費者マインドの改善が進んでおり、個人消費からの成長寄与が加速すると予想されることから、当面は潜在成長率を上回る成長が継続すると予想されます。欧州においては、ECBによる緩和的な金融政策が欧州経済を下支えすると考えられ、潜在成長率を上回る水準に成長率が加速すると期待されます。新興国では、特に中国においてこれまでの過剰投資と過剰信用に依存した経済成長を持続させるのが困難になるなか、かつてのような高成長を見込むことは難しく、中国における抑制された成長が、資源需要の鈍化などを通じて他の新興国の成長見通しも下押しすると予想されます。

ポートフォリオの金利戦略に関しては、金融政策の正常化が予想される米国の金利リスクを消極姿勢とする一方、緩和的な金融政策が継続する見込みの欧州の金利リスクを積極姿勢とするなど、国別選択を強化します。また、欧州における金融緩和の恩恵を受けやすい欧州周縁国の債券の組み入れを継続します。クレジット戦略では、リスク調整後のバリュエーションに魅力のある銘柄を中心に保有を継続いたします。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や、米国におけるインフレ見通しの正常化を捉える資産として、米国の物価連動国債の組み入れを継続します。また、欧州における金融緩和がプラスの影響を及ぼすと考えられる欧州の金融債を選好します。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（基礎的条件）の分析に軸を置きつつ、政治的要因についても配慮した投資対象国の選別が一層重要になると考えています。具体的には、米国の景気回復の恩恵を受けやすく、構造改革による成長が期待できるメキシコの現地通貨建て債券を選好します。通貨に関しては、インド・ルピーのオーバーウェイトを継続します。

[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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る運用を行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年6月26日～2015年12月25日)

項 目	第72期～第77期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 79	% 0.675	(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)	(52)	(0.443)	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)	(25)	(0.216)	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
(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	79	0.676	
作成期間の平均基準価額は、11,753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

(2015年6月26日～2015年12月25日)

投資信託証券

銘 柄		第72期～第77期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	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)	口 330	千円 3,631	口 161	千円 1,785

* 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

(2015年6月26日～2015年12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 B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72期～第77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 15,141	百万円 2,360	% 15.6	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

(2015年12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71期末	第77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(JPY)	口 10,908	口 11,077	千円 119,210	% 97.1
合 計	10,908	11,077	119,210	97.1

*比率は、純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘 柄	第71期末	第77期末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 98	千口 98	千円 100

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年12月25日現在)

項 目	第77期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 119,210	% 96.8
野村マネー マザーファンド	100	0.1
コール・ローン等、その他	3,824	3.1
投資信託財産総額	123,134	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72期末	第73期末	第74期末	第75期末	第76期末	第77期末
	2015年7月27日現在	2015年8月25日現在	2015年9月25日現在	2015年10月26日現在	2015年11月25日現在	2015年12月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	128,871,279	123,661,448	123,870,341	125,410,820	125,018,266	123,134,566
コール・ローン等	3,459,885	3,506,821	3,604,577	3,662,993	3,742,971	3,823,572
投資信託受益証券(評価額)	125,311,104	120,054,328	120,165,465	121,647,518	121,174,975	119,210,674
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,284	100,293	100,293	100,303	100,313	100,313
未収利息	6	6	6	6	7	7
(B) 負債	365,551	351,301	359,301	356,821	352,459	354,083
未払収益分配金	212,865	213,015	216,721	214,210	214,092	215,991
未払信託報酬	152,455	138,079	142,360	142,392	138,153	137,878
その他未払費用	231	207	220	219	214	214
(C) 純資産総額(A-B)	128,505,728	123,310,147	123,511,040	125,053,999	124,665,807	122,780,483
元本	106,432,957	106,507,760	108,360,925	107,105,332	107,046,408	107,995,996
次期繰越損益金	22,072,771	16,802,387	15,150,115	17,948,667	17,619,399	14,784,487
(D) 受益権総口数	106,432,957口	106,507,760口	108,360,925口	107,105,332口	107,046,408口	107,995,996口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,074円	11,578円	11,398円	11,676円	11,646円	11,369円

(注) 第72期首元本額106百万円、第72～第77期中追加設定元本額3百万円、第72～第77期中一部解約元本額1百万円、第77期末計算口数当たり純資産額11,369円。

(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3,397,282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72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期
	2015年6月26日～ 2015年7月27日	2015年7月28日～ 2015年8月25日	2015年8月26日～ 2015年9月25日	2015年9月26日～ 2015年10月26日	2015年10月27日～ 2015年11月25日	2015年11月26日～ 2015年12月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	436,483	436,872	444,625	439,427	439,181	443,275
受取配当金	436,320	436,720	444,440	439,240	439,000	443,080
受取利息	163	152	185	187	181	195
(B) 有価証券売買損益	△ 2,257,760	△ 5,371,640	△ 2,015,535	2,891,245	△ 405,959	△ 3,081,342
売買益	191	9	—	2,928,378	360	—
売買損	△ 2,257,951	△ 5,371,649	△ 2,015,535	△ 37,133	△ 406,319	△ 3,081,342
(C) 信託報酬等	△ 152,686	△ 138,286	△ 142,580	△ 142,611	△ 138,367	△ 138,092
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,973,963	△ 5,073,054	△ 1,713,490	3,188,661	△ 105,145	△ 2,776,159
(E) 前期繰越損益金	25,251,052	23,057,862	17,771,793	15,641,328	18,585,360	18,266,123
(F) 追加信託差損益金	△ 991,453	△ 969,406	△ 691,467	△ 666,512	△ 646,724	△ 489,486
(配当等相当額)	(5,111,181)	(5,143,006)	(5,735,774)	(5,699,870)	(5,727,080)	(6,034,172)
(売買損益相当額)	(△ 6,102,634)	(△ 6,112,412)	(△ 6,427,241)	(△ 6,366,382)	(△ 6,373,804)	(△ 6,523,658)
(G) 計(D+E+F)	22,285,636	17,015,402	15,366,836	18,162,877	17,833,491	15,000,478
(H) 収益分配金	△ 212,865	△ 213,015	△ 216,721	△ 214,210	△ 214,092	△ 215,991
次期繰越損益金(G+H)	22,072,771	16,802,387	15,150,115	17,948,667	17,619,399	14,784,487
追加信託差損益金	△ 991,453	△ 969,406	△ 691,467	△ 666,512	△ 646,724	△ 489,486
(配当等相当額)	(5,111,181)	(5,143,006)	(5,735,774)	(5,699,870)	(5,727,080)	(6,034,172)
(売買損益相当額)	(△ 6,102,634)	(△ 6,112,412)	(△ 6,427,241)	(△ 6,366,382)	(△ 6,373,804)	(△ 6,523,658)
分配準備積立金	28,848,683	28,926,332	29,011,694	28,851,399	28,891,941	28,981,172
繰越損益金	△ 5,784,459	△ 11,154,539	△ 13,170,112	△ 10,236,220	△ 10,625,818	△ 13,707,199

* 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(2015年6月26日～2015年12月25日)は以下の通りです。

項 目	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期
	2015年6月26日～ 2015年7月27日	2015年7月28日～ 2015年8月25日	2015年8月26日～ 2015年9月25日	2015年9月26日～ 2015年10月26日	2015年10月27日～ 2015年11月25日	2015年11月26日～ 2015年12月25日
a. 配当等収益(経費控除後)	283,839円	298,621円	302,083円	420,653円	300,851円	305,222円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	5,111,181円	5,143,006円	5,735,774円	5,699,870円	5,727,080円	6,034,172円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	28,777,709円	28,840,726円	28,926,332円	28,644,956円	28,805,182円	28,891,941円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	34,172,729円	34,282,353円	34,964,189円	34,765,479円	34,833,113円	35,231,335円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	3,210円	3,218円	3,226円	3,245円	3,254円	3,262円
g. 分配金	212,865円	213,015円	216,721円	214,210円	214,092円	215,991円
h. 分配金(1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第72期	第73期	第74期	第75期	第76期	第77期
1万口当たり分配金(税込み)	20円	20円	20円	20円	20円	20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

(2015年12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(22,026,778千口)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77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	3,170,300	3,178,879	14.1	—	—	—	14.1
	(3,170,300)	(3,178,879)	(14.1)	(—)	(—)	(—)	(14.1)
特殊債券 (除く金融債)	3,724,000	3,731,875	16.6	—	—	—	16.6
	(3,724,000)	(3,731,875)	(16.6)	(—)	(—)	(—)	(16.6)
金融債券	1,980,000	1,984,285	8.8	—	—	—	8.8
	(1,980,000)	(1,984,285)	(8.8)	(—)	(—)	(—)	(8.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,800,000	1,805,225	8.0	—	—	—	8.0
	(1,800,000)	(1,805,225)	(8.0)	(—)	(—)	(—)	(8.0)
合 計	10,674,300	10,700,265	47.6	—	—	—	47.6
	(10,674,300)	(10,700,265)	(47.6)	(—)	(—)	(—)	(47.6)

* ()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。

*—印は組み入れなし。

*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77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634回	1.86	1,000	1,008	2016/6/20
東京都	公募第636回	2.04	101,500	102,456	2016/6/20
北海道	公募平成17年度第12回	1.6	50,000	50,119	2016/2/24
北海道	公募平成18年度第7回	2.0	1,500	1,523	2016/10/31
北海道	公募(5年)平成23年度第2回	0.53	7,200	7,212	2016/5/31
神奈川県	公募第136回	1.5	90,000	90,014	2015/12/28
神奈川県	公募第138回	1.7	11,000	11,042	2016/3/24
神奈川県	公募第45回	0.62	200,000	200,240	2016/3/18
神奈川県	公募第46回	0.61	15,500	15,518	2016/3/18
神奈川県	公募第47回	0.47	450,000	450,390	2016/3/18
神奈川県	公募(5年)第49回	0.37	1,700	1,703	2016/9/20
大阪府	公募第287回	1.6	80,000	80,193	2016/2/26
大阪府	公募第288回	1.7	200,000	200,842	2016/3/30
大阪府	公募第294回	2.0	12,000	12,169	2016/9/28
大阪府	公募第295回	1.9	1,000	1,014	2016/10/28
大阪府	公募(5年)第71回	0.76	430,000	430,745	2016/3/30
大阪府	公募(5年)第72回	0.61	3,000	3,005	2016/4/27
大阪府	公募(5年)第73回	0.51	102,000	102,184	2016/5/30
京都府	公募平成23年度第1回	0.49	7,000	7,013	2016/6/22
兵庫県	公募平成18年度第7回	2.1	80,000	80,944	2016/7/27
埼玉県	公募平成18年度第1回	1.8	13,500	13,576	2016/4/27
福岡県	公募平成18年度第3回	1.9	1,000	1,015	2016/10/31
千葉県	公募平成18年度第4回	1.8	8,600	8,721	2016/10/25
千葉県	公募平成22年度第13回	0.56	66,000	66,053	2016/2/25
新潟県	公募平成18年度第1回	2.1	6,500	6,573	2016/7/27
群馬県	公募第3回	1.9	9,000	9,145	2016/11/25
大分県	公募平成18年度第1回	1.8	23,000	23,331	2016/10/31
共同発行市場地方債	公募第34回	1.4	200,000	200,230	2016/1/25
共同発行市場地方債	公募第35回	1.6	300,000	300,753	2016/2/25
共同発行市場地方債	公募第36回	1.6	2,000	2,007	2016/3/25
共同発行市場地方債	公募第38回	2.0	5,000	5,039	2016/5/25
共同発行市場地方債	公募第39回	1.9	2,000	2,017	2016/6/24
共同発行市場地方債	公募第40回	2.1	8,000	8,091	2016/7/25
共同発行市場地方債	公募第41回	2.0	6,000	6,075	2016/8/25
共同発行市場地方債	公募第43回	1.8	4,000	4,055	2016/10/25
福島県	公募平成22年度第2回	0.59	400,000	400,325	2016/2/22
熊本県	公募平成18年度第2回	1.8	7,500	7,606	2016/10/27
大阪市	公募平成17年度第13回	1.7	200,000	200,768	2016/3/23
名古屋市	公募第455回	1.9	1,000	1,008	2016/6/20
名古屋市	公募第456回	1.82	16,000	16,200	2016/9/20
京都市	公募平成17年度第4回	1.7	1,000	1,004	2016/3/30
京都市	公募平成23年度第3回	0.364	4,000	4,008	2016/9/29
札幌市	公募(5年)平成23年度第5回	0.4	12,900	12,927	2016/9/20
川崎市	公募(5年)第29回	0.36	12,200	12,222	2016/9/20
北九州市	公募(5年)平成23年度第1回	0.36	7,000	7,014	2016/9/28
鹿児島県	公募平成18年度第1回	1.9	3,200	3,248	2016/10/31

銘柄	第77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	
鹿児島県 公募（5年）平成23年度第1回	0.37	6,500	6,515	2016/10/31
小計		3,170,300	3,178,879	
特殊債券(除く金融債)				
公営企業債券 政府保証第861回	1.6	29,000	29,101	2016/3/17
公営企業債券 政府保証第862回	1.8	117,000	117,642	2016/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3回	1.5	590,000	590,831	2016/1/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回	1.6	558,000	559,480	2016/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第11回	1.8	170,000	170,978	2016/4/26
首都高速道路債券 政府保証第1回	1.6	400,000	401,583	2016/3/28
中部国際空港債券 政府保証第17回	0.051	300,000	300,000	2016/3/7
日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回	0.243	200,000	200,157	2016/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第13回	1.96	100,000	100,892	2016/6/20
地方公共団体金融機構債券 2年第1回	0.135	200,000	200,020	2016/2/26
公営企業債券 第19回財投機関債	2.02	100,000	100,461	2016/3/24
都市再生債券 財投機関債第75回	0.213	100,000	100,064	2016/6/20
関西国際空港社債 財投機関債第31回	0.504	70,000	70,210	2016/9/20
中日本高速道路社債 財投機関債第37回	0.385	400,000	400,211	2016/2/26
中日本高速道路社債 第40回	0.298	300,000	300,162	2016/3/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回	0.255	90,000	90,076	2016/6/20
小計		3,724,000	3,731,875	
金融債券				
商工債券 利付第733回い号	0.55	300,000	300,705	2016/6/27
商工債券 利付第734回い号	0.55	170,000	170,466	2016/7/27
商工債券 利付第736回い号	0.45	300,000	300,840	2016/9/27
商工債券 利付第737回い号	0.45	100,000	100,306	2016/10/27
農林債券 利付第731回い号	0.75	100,000	100,222	2016/4/27
農林債券 利付第733回い号	0.55	180,000	180,424	2016/6/27
農林債券 利付第735回い号	0.45	100,000	100,241	2016/8/26
農林債券 利付第736回い号	0.5	100,000	100,311	2016/9/27
農林債券 利付第737回い号	0.5	30,000	30,088	2016/10/27
商工債券 利付（3年）第160回	0.25	100,000	100,072	2016/5/27
商工債券 利付（3年）第161回	0.25	200,000	200,170	2016/6/27
商工債券 利付（3年）第164回	0.2	200,000	200,177	2016/9/27
商工債券 利付（10年）第2回	1.78	100,000	100,256	2016/2/19
小計		1,980,000	1,984,285	
普通社債券(含む投資法人債券)				
みずほコーポレート銀行 第24回特定社債間限定同順位特約付	0.595	200,000	200,073	2016/1/20
みずほコーポレート銀行 第25回特定社債間限定同順位特約付	0.755	200,000	200,416	2016/4/20
みずほコーポレート銀行 第26回特定社債間限定同順位特約付	0.54	100,000	100,251	2016/7/20
トヨタファイナンス 第19回社債間限定同等特約付	2.04	200,000	200,883	2016/3/18
三菱UFJリース 第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	501,136	2016/4/22
三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付	0.66	200,000	201,058	2016/12/14
三菱UFJリース 第22回社債間限定同順位特約付	0.235	100,000	100,021	2016/2/26
三井住友海上火災保険 第5回社債間限定同順位特約付	0.67	100,000	100,055	2016/1/27
三井不動産 第25回社債間限定同順位特約付	1.805	100,000	100,374	2016/3/16
東邦瓦斯 第30回社債間限定同順位特約付	2.07	100,000	100,953	2016/6/20
小計		1,800,000	1,805,225	
合計		10,674,300	10,700,265	

* 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77期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,399,142	% 10.7

*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)

2015年2月28日決算

(計算期間:2014年3月1日～2015年2月28日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託
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
受 託 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー(ケイマン)・リミテッド
投 資 顧 問 会 社	パンフィック・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
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 受 託 銀 行	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー

* 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

2015年2月28日に終了した期間

(単位:千)

収益

利息(外国税額控除後)	\$	1,105
雑収入		1
収益合計		1,106

費用

管理費用-InstitutionalFC(JPY,Hedged)		1
管理費用-InstitutionalFD(JPY)		144
支払利息		2
費用合計		147

純投資収益

959

当期実現損益

投資有価証券(外国税額控除後)		(10)
上場金融デリバティブ商品		(303)
店頭金融デリバティブ商品		(940)
外貨通貨		(153)
当期実現損益		(1,406)

当期末実現損益

投資有価証券(外国税額控除後)		(1,953)
上場金融デリバティブ商品		(58)
店頭金融デリバティブ商品		289
外貨建資産および負債		18
当期末実現損益		(1,704)
当期実現および未実現損益		(3,110)

運用の結果による純資産の増減額

\$ (2,151)

外国源泉徴収課税額	\$	24
-----------	----	----

期末純資産総額

(単位:千)

Institutional FC (JPY, Hedged)	\$	135
Institutional FD (JPY)		24,663
J (JPY)		1,231
J (JPY, Hedged)		10,243

期末現在発行済受益証券数

(単位:千)

Institutional FC (JPY, Hedged)		2
Institutional FD (JPY)		256
J (JPY)		13
J (JPY, Hedged)		122

期末1口当たり純資産価格

Institutional FC (JPY, Hedged)		78.81
Institutional FD (JPY)		96.54
J (JPY)		97.87
J (JPY, Hedged)		83.91

※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36,272千米ドル。

組入資産の明細

2015年2月28日現在

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 110.2%					
ブラジル 2.9%					
社債・約束手形 1.1%					
Banco Santander Brasil S.A.					
4.250% due 01/14/2016	\$ 200	\$ 205			
Itau Unibanco Holding S.A.					
5.750% due 01/22/2021	100	105			
Petrobras Global Finance BV					
6.250% due 03/17/2024	100	92			
		<u>402</u>			
ソブリン債 1.8%					
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social					
3.375% due 09/26/2016	200	202			
Brazil Government International Bond					
5.000% due 01/27/2045	200	182			
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F					
10.000% due 01/01/2017	BRL 652	222			
10.000% due 01/01/2025	100	31			
		<u>637</u>			
ブラジル計		<u>1,039</u>			
(Cost \$1,168)					
カナダ 4.3%					
ソブリン債 4.3%					
Canada Housing Trust No.1 Province of Ontario					
2.400% due 12/15/2022	CAD 1,000	857			
2.500% due 09/10/2021	\$ 700	717			
		<u>1,574</u>			
カナダ計		<u>1,574</u>			
(Cost \$1,618)					
ケイマン諸島 0.0%					
資産担保証券 0.0%					
Hyundai Capital Auto Funding VIII Ltd.					
1.173% due 09/20/2016	3	3			
		<u>3</u>			
ケイマン諸島計		<u>3</u>			
(Cost \$3)					
デンマーク 5.1%					
社債・約束手形 5.1%					
Nykredit Realkredit A/S					
2.000% due 04/01/2015	DKK 200	30			
2.000% due 10/01/2015	3,100	473			
2.000% due 01/01/2016	700	107			
Realkredit Danmark A/S					
2.000% due 01/01/2016	3,000	460			
4.000% due 01/01/2016	5,000	778			
		<u>1,848</u>			
デンマーク計		<u>1,848</u>			
(Cost \$1,886)					
フランス 5.4%					
社債・約束手形 2.9%					
Banque PSA Finance S.A.					
4.250% due 02/25/2016	EUR 200	232			
BNP Paribas Cardif S.A.					
4.032% due 11/25/2025 (a)	100	121			
BPCE S.A.					
4.625% due 07/11/2024	\$ 200	207			
Credit Agricole S.A.					
6.500% due 06/23/2021 (a)	EUR 200	237			
RCI Banque S.A.					
4.250% due 04/27/2017	100	121			
SNCF Reseau					
0.375% due 02/25/2016	100	113			
		<u>1,031</u>			
ソブリン債 2.5%					
France Government Bond					
0.250% due 07/25/2024 (b)	203	248			
2.250% due 05/25/2024	300	390			
2.500% due 05/25/2030	200	273			
		<u>911</u>			
フランス計		<u>1,942</u>			
(Cost \$2,081)					
ドイツ 1.7%					
ソブリン債 1.7%					
FMS Wertmanagement					
1.875% due 05/09/2019	100	121			
Republic of Germany Inflation-Linked Bond					
0.750% due 04/15/2018 (b)	424	492			
		<u>613</u>			
ドイツ計		<u>613</u>			
(Cost \$728)					
ギリシャ 0.3%					
社債・約束手形 0.1%					
Hellenic Railways Organization S.A.					
4.500% due 12/06/2016	¥ 4,000	29			
		<u>29</u>			
ソブリン債 0.2%					
Greece Government International Bond					
5.250% due 02/01/2016	10,000	71			
		<u>100</u>			
ギリシャ計		<u>100</u>			
(Cost \$136)					
香港 0.6%					
社債・約束手形 0.6%					
CNOOC Nexen Finance 2014 ULC					
4.250% due 04/30/2024	\$ 200	214			
		<u>214</u>			
香港計		<u>214</u>			
(Cost \$204)					

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
インド 0.3%					
社債・約束手形 0.3%					
ICICI Bank Ltd.					
4.750% due 11/25/2016	100	105			
インド計		105			
(Cost \$100)					
インドネシア 1.6%					
ソブリン債 1.6%					
Indonesia Government International Bond					
2.875% due 07/08/2021	EUR 100	118			
6.625% due 05/15/2033	IDR 204,000	14			
8.250% due 06/15/2032	2,740,000	231			
8.375% due 03/15/2034	2,611,000	225			
インドネシア計		588			
(Cost \$656)					
アイルランド 1.7%					
社債・約束手形 1.7%					
Bank of Ireland					
10.000% due 07/30/2016	EUR 100	122			
Depfa ACS Bank					
3.875% due 11/14/2016	150	179			
German Postal Pensions Securitisation PLC					
3.375% due 01/18/2016	100	116			
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC					
5.375% due 02/13/2017	\$ 200	186			
アイルランド計		603			
(Cost \$690)					
モーゲージ担保証券 0.0%					
Silenus European Loan Conduit No.25 Ltd.					
0.198% due 05/15/2019	EUR 12	13			
アイルランド計		616			
(Cost \$690)					
イタリア 7.8%					
ソブリン債 7.8%					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro					
1.650% due 04/23/2020 (b)	299	358			
2.500% due 12/01/2024	100	124			
4.500% due 03/01/2024	550	785			
4.750% due 08/01/2023	600	865			
4.750% due 09/01/2044	100	171			
5.000% due 09/01/2040	300	512			
イタリア計		2,815			
(Cost \$2,836)					
日本 3.5%					
ソブリン債 3.5%					
Japan Government International Bond					
1.700% due 09/20/2044	¥ 140,000	1,249			
日本計		1,249			
(Cost \$1,268)					
ルクセンブルグ 4.6%					
社債・約束手形 2.0%					
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.					
6.510% due 03/07/2022	\$ 150	138			
Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A.					
8.700% due 03/17/2016	RUB 14,000	213			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.					
4.950% due 02/07/2017	\$ 400	383			
ルクセンブルグ計		734			
(Cost \$2,002)					
ソブリン債 2.6%					
European Financial Stability Facility					
1.500% due 01/22/2020	EUR 200	241			
3.375% due 07/05/2021	500	676			
ソブリン債計		917			
(Cost \$1,173)					
メキシコ 3.1%					
ソブリン債 3.1%					
Mexico Government International Bond					
1.625% due 03/06/2024	200	223			
7.750% due 05/29/2031	MXN 980	77			
10.000% due 12/05/2024	9,359	829			
メキシコ計		1,129			
(Cost \$1,173)					
オランダ 3.9%					
社債・約束手形 3.9%					
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA					
6.875% due 03/19/2020	EUR 100	137			
8.375% due 07/26/2016 (a)	\$ 100	108			
ING Bank NV					
2.625% due 12/05/2022	1,150	1,171			
オランダ計		1,416			
(Cost \$1,378)					
ノルウェー 0.2%					
ソブリン債 0.2%					
Norway Government Bond					
3.750% due 05/25/2021	NOK 500	76			
ノルウェー計		76			
(Cost \$76)					
ポーランド 4.9%					
ソブリン債 4.9%					
Poland Government International Bond					
3.250% due 07/25/2025	PLN 4,200	1,249			
4.000% due 10/25/2023	900	280			
5.500% due 10/25/2019	450	142			
5.750% due 09/23/2022	300	102			
ポーランド計		1,773			
(Cost \$1,828)					

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
スロベニア 2.9%		
社債・約束手形 0.3%		
Nova Ljubljanska Banka dd		
2.875% due 07/03/2017	EUR 100	112
ソブリン債 2.6%		
Slovenia Government International Bond		
4.700% due 11/01/2016	200	241
5.850% due 05/10/2023	\$ 600	708
		949
スロベニア計		1,061
(Cost \$1,007)		
南アフリカ 1.2%		
ソブリン債 1.2%		
South Africa Government International Bond		
5.375% due 07/24/2044	200	219
6.750% due 03/31/2021	ZAR 2,613	220
南アフリカ計		439
(Cost \$507)		
韓国 2.4%		
ソブリン債 2.4%		
Korea Housing Finance Corp.		
4.125% due 12/15/2015	\$ 250	256
Republic of Korea		
2.125% due 06/10/2024	EUR 500	607
韓国計		863
(Cost \$929)		
スペイン 8.7%		
社債・約束手形 5.1%		
Ayt Cedula Cajas Global		
0.153% due 02/22/2018	800	880
Banco Popular Espanol S.A.		
8.250% due 04/10/2020 (a)	200	232
Cedulas TDA 6 Fondo de Titulizacion de Activos		
4.250% due 04/10/2031	200	295
PITCH1		
5.125% due 07/20/2022	300	440
		1,847
ソブリン債 3.6%		
Autonomous Community of Catalonia		
3.875% due 04/07/2015	300	338
4.950% due 02/11/2020	50	64
Autonomous Community of Valencia		
2.360% due 09/03/2017	100	113
3.250% due 07/06/2015	50	57
4.000% due 11/02/2016	100	119
Spain Government Bond		
1.600% due 04/30/2025	100	115
5.150% due 10/31/2044	200	363

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
5.850% due 01/31/2022	100	149
スペイン計		1,318
(Cost \$3,412)		3,165
アラブ首長国連邦 0.3%		
社債・約束手形 0.3%		
Emirates Telecommunications Corp.		
1.750% due 06/18/2021	100	118
アラブ首長国連邦計		118
(Cost \$134)		
イギリス 13.2%		
社債・約束手形 4.0%		
Barclays Bank PLC		
7.750% due 04/10/2023	\$ 400	442
HBOS PLC		
0.779% due 03/21/2017	EUR 100	112
Lloyds Bank PLC		
4.875% due 03/30/2027	GBP 100	193
12.000% due 12/16/2024 (a)	\$ 200	288
Spirit Issuer PLC		
2.360% due 12/28/2036	GBP 100	149
Tesco Corporate Treasury Services PLC		
1.375% due 07/01/2019	EUR 100	111
Twinkle Pizza PLC		
6.625% due 08/01/2021	GBP 100	162
		1,457
モーゲージ担保証券 6.8%		
Arran Residential Mortgages Funding PLC		
1.448% due 05/16/2047	EUR 83	94
Eurosail PLC		
1.510% due 06/13/2045	GBP 100	153
Gemgarto		
3.513% due 05/14/2045	64	102
Granite Master Issuer PLC		
0.180% due 12/20/2054	EUR 38	43
0.374% due 12/20/2054	\$ 38	38
Great Hall Mortgages PLC		
0.373% due 06/18/2039	391	371
Hercules Eclipse PLC		
0.805% due 10/25/2018	GBP 187	286
Leek Finance Number Eighteen PLC		
0.507% due 09/21/2038	\$ 285	297
Leek Finance Number Seventeen PLC		
0.527% due 12/21/2037	815	859
Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC		
0.303% due 09/12/2037	EUR 83	88
Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC		
0.730% due 06/12/2044	GBP 84	122
		2,453

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ソブリン債 2.4%		
United Kingdom Gilt		
3.250% due 01/22/2044	200	358
United Kingdom Gilt		
Inflation-Linked		
0.125% due 03/22/2024 (b)	319	535
		<u>893</u>
Total United Kingdom		4,803
(Cost \$4,732)		
アメリカ 18.5%		
資産担保証券 0.5%		
Massachusetts Educational		
Financing Authority		
1.206% due 04/25/2038	\$ 34	34
SLM Private Credit Student Loan		
Trust		
0.421% due 03/15/2024	75	75
0.481% due 12/16/2041	100	89
		<u>198</u>
社債・約束手形 2.3%		
Goldman Sachs Group, Inc.		
1.417% due 04/23/2020	100	101
International Lease Finance Corp.		
6.750% due 09/01/2016	400	426
ONEOK Partners LP		
3.375% due 10/01/2022	100	95
UIL Holdings Corp.		
4.625% due 10/01/2020	100	108
Wells Fargo & Co.		
3.000% due 02/19/2025	100	100
		<u>830</u>
モーゲージ担保証券 3.0%		
American Home Mortgage		
Investment Trust		
2.069% due 10/25/2034	48	48
Banc of America Re-REMIC Trust		
5.648% due 02/17/2051	91	96
Bear Stearns Adjustable Rate		
Mortgage Trust		
2.515% due 03/25/2035	24	24
Bear Stearns Asset-Backed		
Securities Trust		
0.371% due 12/25/2036	165	154
Citigroup Mortgage Loan Trust,		
Inc.		
2.546% due 05/25/2035	65	63
Countrywide Asset-Backed		
Certificates		
0.271% due 08/25/2037	13	13
Deutsche Alternative-A Securities		
Mortgage Loan Trust		
0.351% due 06/25/2037 (c)	50	42
HarborView Mortgage Loan Trust		
0.514% due 06/20/2035	106	102
Impac CMB Trust		
1.171% due 07/25/2033	15	14
MASTR Asset Securitization Trust		
5.500% due 11/25/2017	5	5

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Merrill Lynch Mortgage Trust		
5.690% due 02/12/2051	73	80
Morgan Stanley Re-REMIC Trust		
5.796% due 08/15/2045	86	92
Structured Adjustable Rate		
Mortgage Loan Trust		
0.491% due 10/25/2035	138	120
Thornburg Mortgage Securities		
Trust		
2.018% due 10/25/2043	217	213
WaMu Mortgage Pass-Through		
Certificates Trust		
0.451% due 11/25/2045	46	40
		<u>1,106</u>
地方債・約束手形 1.1%		
New York, New York, Municipal		
Water Finance Authority Revenue		
Bonds, Series 2010		
5.440% due 06/15/2043	200	258
Ohio, American Municipal Power		
Revenue Bonds, Series 2010		
7.334% due 02/15/2028	100	132
		<u>390</u>
米国政府機関債 3.5%		
Fannie Mae		
2.500% due 08/01/2028	87	89
4.500% due 06/01/2038	22	24
4.500% due 05/01/2041	691	752
4.500% due 07/01/2041	66	72
Ginnie Mae (d)		
3.500% due 03/01/2045	100	105
4.000% due 03/20/2045	200	213
		<u>1,255</u>
国庫債券 8.1%		
Treasury Inflation Protected		
Securities		
2.375% due 01/15/2025 (b)	2,143	2,604
U.S. Treasury Bonds		
3.625% due 02/15/2044	200	242
U.S. Treasury Notes		
0.250% due 02/28/2015	100	100
		<u>2,946</u>
アメリカ計		6,725
(Cost \$6,390)		
短期証券 11.1%		
コマーシャル・ペーパー 0.0%		
Fannie Mae		
0.060% due 03/18/2015	10	10
現先取引 8.0%		
		<u>2,900</u>
定期預金 1.1%		
ANZ National Bank		
0.030% due 03/02/2015	6	6

PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)	
0.086% due 03/02/2015	GBP	5	8	0.030% due 03/02/2015	\$ 1	1
1.442% due 03/02/2015	AUD	10	8	0.386% due 03/02/2015	NOK 1	0
2.550% due 03/02/2015	NZD	28	21	Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.				(0.169%) due 03/02/2015	EUR 14	15
0.005% due 03/02/2015	¥	252	2	0.005% due 03/02/2015	¥ 105	1
0.030% due 03/02/2015	\$	10	10	Wells Fargo Bank		
Brown Brothers Harriman & Co.				(0.169%) due 03/02/2015	EUR 10	11
(0.750%) due 03/02/2015	DKK	2	0	0.030% due 03/02/2015	\$ 8	8
0.005% due 03/02/2015	¥	3	0	0.100% due 03/02/2015	CAD 5	4
Citibank N.A.						406
0.030% due 03/02/2015	\$	63	63	メキシコ短期国債 2.0%		
DBS Bank Ltd.				2.945% due 05/14/2015	MXN 10,920	726
0.030% due 03/02/2015		116	116	短期証券計		4,042
DnB NORBank ASA				(Cost \$4,060)		
(0.169%) due 03/02/2015	EUR	5	6	投資有価証券計 110.2%		39,967
0.030% due 03/02/2015	\$	39	39	(Cost \$41,002)		
HSBC Bank				金融デリバティブ商品 (0.9%)		(307)
0.005% due 03/02/2015	¥	124	1	(Cost or Premiums, net \$(269))		
0.086% due 03/02/2015	GBP	12	19	その他資産・負債 (9.3%)		(3,388)
4.950% due 03/02/2015	ZAR	1	0			
JPMorgan Chase & Co.				純資産 100.0%		\$ 36,272
0.030% due 03/02/2015	\$	39	39			
National Australia Bank Ltd.						
1.442% due 03/02/2015	AUD	7	6			
Nordea Bank AB						
(0.183%) due 03/02/2015	SEK	2	0			
(0.169%) due 03/02/2015	EUR	19	22			

(a) Perpetual maturity, date shown represents next contractual call date.

(b) Principal amount of security is adjusted for inflation.

(c) Security is in default.

(d) When-Issued security.

◎借入およびその他金融取引

2015年2月28日現在

●現先取引

単位:千

取引相手	利率	決済日	満期	額面金額		受取担保時価	現先取引時価	未収現先取引損益
BOS	0.120%	02/27/2015	03/02/2015	\$ 2,900	U.S. Treasury Bonds 4.750% due 02/15/2041	\$ (2,972)	\$ 2,900	\$ 2,900
現先取引計						\$ (2,972)	\$ 2,900	\$ 2,900

●セール・バイバック取引

単位:千

取引相手	借入金利	借入日	満期	借入金額	買戻金額
BPS	0.031%	02/05/2015	05/07/2015	EUR (374)	\$ (423)
BPS	0.033%	02/05/2015	05/07/2015	(435)	(491)
BPS	0.035%	02/05/2015	05/07/2015	(144)	(162)
BPS	0.036%	02/05/2015	05/07/2015	(229)	(259)
BPS	0.054%	02/05/2015	05/07/2015	(313)	(351)
BPS	0.071%	02/05/2015	05/07/2015	(756)	(855)
BPS	0.071%	02/11/2015	05/07/2015	(542)	(611)
BPS	0.091%	01/29/2015	03/02/2015	¥ (153,489)	(1,284)
BPS	0.091%	03/02/2015	03/16/2015	(151,573)	(1,269)
BRC	0.122%	03/02/2015	05/07/2015	EUR (127)	(144)
JML	0.054%	02/05/2015	05/07/2015	(127)	(143)
セール・バイバック取引計					\$ (5,992)

●空売り

単位:千

取引相手	銘柄	クーポン	満期	額面	収益	空売り払込
FOB	Fannie Mae	4.000%	04/01/2045	\$ 1,300	\$ (1,383)	\$ (1,387)
FOB	Fannie Mae	3.500%	04/25/2045	300	(312)	(314)
JPS	Fannie Mae	4.500%	03/01/2045	300	(325)	(326)
空売り計					\$ (2,020)	\$ (2,027)

◎上場金融デリバティブ商品

2015年2月28日現在

●先物取引

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
5-Year USD Deliverable Interest Rate Swap March Futures	Short	03/2015	2	\$ (2)	\$ 0	\$ 0
10-Year USD Deliverable Interest Rate Swap March Futures	Short	03/2015	18	(55)	0	(3)
Canada Government 10-Year Bond June Futures	Short	06/2015	4	(6)	0	0
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Long	06/2015	1	0	0	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2015	25	10	4	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Short	06/2015	1	0	1	0
Call Option Strike @ EUR 160.000 on Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	05/2015	5	1	0	(3)
Put Option Strike @ EUR 152.000 on Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	05/2015	5	1	0	(2)
Put Option Strike @ EUR 111.100 on Euro-Schatz 2-Year Bond June Futures	Short	05/2015	4	0	0	0
先物取引計				\$ (51)	\$ 5	\$ (8)

●スワップ契約

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)ー売り

単位:千

	固定取引			市場価格	未実現評価損益	変動証拠金	
	受取金利	満期	想定元本			資産	負債
CDX.IG-23 Index	1.000%	12/20/2019	\$ 1,900	\$ 38	\$ 11	\$ 0	\$ 0

金利スワップ

単位:千

変動金利の 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金							
							資産	負債						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.013%	01/23/2025	SEK 500	\$ (1)	\$ (1)	\$ 0	\$ (1)						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.023%	01/23/2025	400	0	0	0	0						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.033%	01/23/2025	400	0	0	0	0						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.036%	01/23/2025	500	(1)	(1)	0	(1)						
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.200%	07/15/2015	\$ 100	(1)	(1)	0	0						
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.800%	09/25/2017	10,300	100	(47)	0	(7)						
Pay	3-Month USD-LIBOR	4.000%	09/21/2021	500	42	8	1	0						
Pay	3-Month USD-LIBOR	3.000%	12/17/2024	100	8	2	0	0						
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.750%	06/17/2025	1,300	65	30	2	0						
Pay	3-Month USD-LIBOR	3.750%	06/18/2044	600	169	152	3	0						
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.250%	12/17/2019	AUD 1,400	44	41	3	0						
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.750%	12/17/2019	1,400	71	42	3	0						
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	100	5	0	1	0						
Receive	6-Month EURIBOR	0.500%	03/18/2020	EUR 400	(5)	(8)	0	0						
Pay	6-Month EURIBOR	1.250%	03/18/2025	400	25	2	0	0						
Receive	6-Month EURIBOR	1.250%	03/18/2025	400	(25)	(1)	0	0						
Pay	6-Month EURIBOR	0.750%	09/16/2025	200	0	0	0	(1)						
Receive	6-Month EURIBOR	2.000%	03/18/2045	900	(210)	(197)	0	(1)						
Pay	6-Month GBP-LIBOR	2.250%	03/18/2020	GBP 300	16	(5)	0	(2)						
Receive	6-Month GBP-LIBOR	2.750%	03/18/2025	700	(88)	27	8	0						
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.500%	09/17/2021	¥ 440,000	(56)	(28)	0	(3)						
Receive	6-Month JPY-LIBOR	1.000%	09/18/2023	50,000	(22)	(16)	0	(1)						
Pay	6-Month JPY-LIBOR	1.250%	06/17/2035	30,000	4	(1)	1	0						
Pay	6-Month JPY-LIBOR	1.500%	12/20/2044	20,000	6	5	1	0						
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.000%	09/16/2025	PLN 600	(1)	0	0	0						
Pay	IBMEXID	5.610%	07/07/2021	MXN 23,200	15	11	0	(5)						
Pay	IBMEXID	5.630%	10/11/2021	400	0	0	0	0						
Pay	IBMEXID	5.715%	10/15/2021	3,400	3	(3)	0	(1)						
Pay	IBMEXID	5.620%	11/09/2021	1,000	0	0	0	0						
Pay	IBMEXID	5.560%	11/11/2021	100	0	0	0	0						
Pay	IBMEXID	6.710%	09/20/2029	700	2	1	0	0						
							\$	165	\$	12	\$	23	\$	(23)
スワップ契約計							\$	203	\$	23	\$	23	\$	(23)

◎店頭金融デリバティブ商品

2015年2月28日現在

●先渡外国為替契約

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				
AZD	04/2015	IDR	4,657,269	\$	357	\$	2	\$	0
BOA	03/2015	RUB	28,838		472		5		0
BOA	03/2015	\$	442	RUB	28,838		25		0
BOA	04/2015	RUB	24,920	\$	400		5		0
BOA	04/2015	\$	113	BRL	327		0		0
BOA	04/2015		208	ILS	822		0		(2)
BOA	05/2015		31	EUR	27		0		0
BOA	05/2015		37	MXN	544		0		(1)
BOA	05/2015		73	TWD	2,296		0		0
BOA	08/2015		203	SEK	1,695		1		0
BPS	05/2015		128	EUR	113		0		(1)
BPS	06/2015		246	COP	565,682		0		(21)
BPS	01/2016	DKK	2,255	\$	351		8		0
BRC	03/2015	RUB	79,022		1,258		0		(20)
BRC	03/2015	TRY	35		14		0		0
BRC	03/2015	\$	1,292	RUB	79,022		0		(14)
BRC	04/2015		1,222		78,369		21		0
BRC	04/2015		82	ZAR	962		0		0
BRC	04/2015	ZAR	259	\$	22		0		0
BRC	05/2015	MXN	1,414		94		0		0
CBK	03/2015	JPY	1,528		13		0		0
CBK	03/2015	RUB	16,208		265		3		0
CBK	03/2015	\$	9	JPY	1,050		0		0
CBK	03/2015		230	RUB	16,208		32		0
CBK	04/2015	GBP	437	\$	672		0		(3)
CBK	04/2015	PLN	309		83		0		0
CBK	04/2015	\$	193	CLP	120,148		0		0
CBK	04/2015		36	CZK	882		0		0
CBK	04/2015		33	HKD	256		0		0
CBK	04/2015		54	ILS	215		0		0
CBK	04/2015		58	SGD	79		0		0
CBK	04/2015		80	ZAR	941		0		0
CBK	05/2015	MXN	10,796	\$	732		13		0
CBK	05/2015	\$	878	KRW	959,370		0		(10)
CBK	05/2015		352	MXN	5,285		0		0
DUB	03/2015	RUB	13,568	\$	222		2		0
DUB	03/2015	\$	191	RUB	13,568		28		0
DUB	04/2015		223	HKD	1,729		0		0
DUB	04/2015		78	RON	312		1		0
DUB	05/2015		122	IDR	1,552,698		0		(4)
DUB	07/2015		170	BRL	461		0		(15)
DUB	08/2015	DKK	4,510	\$	696		14		0
DUB	10/2015		2,967		459		10		0
DUB	01/2016		717		111		2		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	
FBF	03/2015	RUB	11,440	187	2	0
FBF	03/2015	\$	163	RUB 11,440	22	0
FBF	05/2015		105	KRW 116,036	0	0
GLM	03/2015	JPY	42,300	\$ 357	3	0
GLM	03/2015	\$	98	AUD 126	1	0
GLM	03/2015		220	CAD 274	0	(1)
GLM	03/2015		163	GBP 106	1	0
GLM	04/2015		62	CLP 38,452	0	0
GLM	04/2015		379	INR 23,870	5	0
GLM	04/2015		2,436	JPY 288,787	0	(19)
GLM	05/2015	EUR	3,732	\$ 4,270	80	0
GLM	05/2015	\$	1,067	EUR 937	0	(15)
GLM	05/2015		197	PHP 8,725	1	0
GLM	05/2015		300	THB 9,841	3	0
GLM	08/2015	NOK	155	\$ 21	0	0
HUS	03/2015	\$	105	TRY 266	0	0
HUS	04/2015	PLN	446	\$ 121	1	0
HUS	04/2015	RUB	18,988	300	0	(1)
HUS	04/2015	\$	436	CNH 2,748	0	(1)
HUS	04/2015		203	SGD 272	0	(3)
HUS	05/2015		396	TWD 12,446	0	0
HUS	06/2015		105	COP 264,075	0	0
HUS	07/2015	PLN	800	\$ 214	0	(1)
HUS	08/2015	\$	275	DKK 1,780	0	(6)
JPM	03/2015	AUD	407	\$ 323	4	0
JPM	03/2015	BRL	1,916	674	4	0
JPM	03/2015	RUB	16,842	272	2	(3)
JPM	03/2015	\$	666	BRL 1,916	4	0
JPM	03/2015		245	RUB 16,842	28	0
JPM	04/2015	MXN	3,259	\$ 221	4	0
JPM	04/2015	PLN	234	64	0	0
JPM	04/2015	RUB	61,682	980	5	(4)
JPM	04/2015	\$	667	BRL 1,916	0	(4)
JPM	04/2015		174	CZK 4,176	0	(4)
JPM	04/2015		94	IDR 1,235,677	0	0
JPM	04/2015		334	JPY 39,800	0	(1)
JPM	04/2015		62	MYR 225	0	0
JPM	04/2015		179	PEN 538	0	(6)
JPM	04/2015		333	TRY 845	0	(2)
JPM	05/2015		33	PHP 1,455	0	0
JPM	05/2015		47	THB 1,525	0	0
JPM	06/2015		974	INR 61,740	8	0
JPM	07/2015	PLN	2,825	\$ 752	0	(8)
JPM	09/2015	\$	1,303	CNY 8,000	0	(36)
JPM	10/2015	DKK	101	\$ 15	0	0
JPM	01/2016	BRL	589	200	11	0
JPM	01/2016	DKK	299	46	0	0
MSB	03/2015	BRL	1,916	666	0	(4)

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	
MSB	03/2015	RUB	1,313	20	0	(1)
MSB	03/2015	\$	714	BRL 1,916	0	(44)
MSB	03/2015		21	RUB 1,313	0	0
MSB	04/2015	DKK	125	\$ 19	0	0
MSB	01/2016		490	75	1	0
SCX	04/2015	CNY	7,528	1,213	0	(1)
SOG	04/2015	\$	227	MYR 812	0	(3)
UAG	04/2015	DKK	78	\$ 12	0	0
UAG	04/2015	\$	116	IDR 1,485,281	0	(2)
UAG	05/2015		337	CHF 315	0	(3)
UAG	05/2015		40	EUR 35	0	(1)
UAG	10/2015	DKK	102	\$ 16	0	0
				\$ 362	\$ (265)	

● Institutional FC(JPY,Hedged)及びJ(JPY,Hedged)の先渡外国為替契約

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	03/2015	CHF	99	\$ 111	\$ 6	\$ 0
BOA	03/2015	DKK	378	58	1	0
BOA	03/2015	EUR	88	100	1	0
BOA	03/2015	JPY	327,442	2,742	3	0
BOA	03/2015	SEK	739	90	1	0
BOA	03/2015	\$	3,252	JPY 384,863	0	(32)
BOA	04/2015		2,680	320,041	0	(1)
BPS	03/2015	AUD	201	\$ 158	1	0
BPS	03/2015	JPY	320,041	2,678	1	0
BPS	03/2015	NOK	152	19	0	0
BPS	04/2015	\$	13	EUR 11	0	0
BPS	04/2015		2,679	JPY 320,041	0	(1)
BRC	03/2015	CAD	381	\$ 306	1	0
CBK	03/2015	EUR	66	74	0	0
CBK	03/2015		3	3	0	0
CBK	03/2015	JPY	119	1	0	0
CBK	03/2015	\$	156	AUD 201	1	0
CBK	03/2015		12	JPY 1,413	0	0
CBK	03/2015		3,168	373,826	0	(41)
CBK	04/2015	AUD	201	\$ 156	0	(1)
CBK	04/2015	\$	1	AUD 1	0	0
CBK	04/2015		2	CAD 3	0	0
CBK	04/2015		2	EUR 2	0	0
DUB	03/2015	JPY	320,041	\$ 2,677	0	0
DUB	03/2015		1,294	11	0	0
DUB	04/2015		931	8	0	0
DUB	04/2015	\$	2,689	JPY 321,334	0	0
FBF	03/2015	EUR	1	\$ 1	0	0
FBF	03/2015	NZD	12	9	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
FBF	03/2015	\$ 48	JPY 5,606	0	(1)
GLM	03/2015		CHF 99	0	0
GLM	04/2015	CHF 99	\$ 105	0	0
GLM	04/2015	JPY 5,712	48	0	0
JPM	03/2015	\$ 3	EUR 3	0	0
JPM	03/2015	82	JPY 9,632	0	(1)
JPM	04/2015	EUR 3	\$ 3	0	0
JPM	04/2015	\$ 2	GBP 1	0	0
MSB	03/2015	3,156	JPY 373,597	0	(31)
MSB	04/2015	EUR 1,826	\$ 2,061	12	0
MSB	04/2015	GBP 297	448	0	(11)
RBC	03/2015	\$ 306	CAD 381	0	(1)
RBC	04/2015	CAD 381	\$ 306	1	0
UAG	03/2015	JPY 180,001	1,506	0	0
UAG	03/2015	\$ 112	EUR 99	0	(2)
UAG	04/2015	EUR 99	\$ 112	2	0
UAG	04/2015	\$ 1,507	JPY 180,001	0	0
				\$ 31	\$ (123)
先渡外国為替契約計				\$ 393	\$ (388)

●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	変動金利の支払/受取	行使レート	満期	想定元本	費用	市場価格
GST	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	1.000%	09/01/2016	EUR 800	\$ 12	\$ 31

通貨オプション

単位:千

取引相手	銘柄	行使価格	満期	想定元本	費用	市場価格
BRC	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 122.000	04/30/2015	\$ 100	\$ 1	\$ 1
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	122.000	04/30/2015	300	2	2
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	122.000	04/30/2015	300	2	2
					\$ 5	\$ 5
買建オプション計					\$ 17	\$ 36

● 売建オプション

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	変動金利の支払/受取	行使レート	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格
DUB	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.195%	09/21/2015	EUR 6,600	\$ (4)	\$ (19)
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.310%	09/21/2015	6,600	(13)	(4)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.350%	09/08/2015	1,300	(3)	(8)
GLM	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.350%	09/08/2015	1,300	(3)	(1)
GST	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	1.493%	09/01/2016	300	(11)	(38)
							<u>\$ (34)</u>	<u>\$ (70)</u>

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	売買プロテクション	行使レート	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格
BOA	Put - CDX.IG-23 Index	Sell	1.000%	04/15/2015	\$ 100	\$ 0	\$ 0
JPM	Put - CDX.IG-23 Index	Sell	1.000%	04/15/2015	900	(1)	0
						<u>\$ (1)</u>	<u>\$ 0</u>

通貨オプション

単位:千

取引相手	銘柄	行使価格	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN 15.450	03/17/2015	\$ 300	\$ (3)	\$ 0	
BRC	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 116.950	04/30/2015	100	(1)	(1)	
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	116.950	04/30/2015	300	(2)	(2)	
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY 6.600	02/05/2016	100	(1)	(1)	
HUS	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 116.950	04/30/2015	300	(2)	(2)	
JPM	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY 6.600	02/05/2016	90	(1)	(1)	
MSB	Call - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN 15.450	03/17/2015	400	(4)	(1)	
						<u>\$ (14)</u>	<u>\$ (8)</u>

インフレフロアオプション

単位:千

取引相手	銘柄	インシヤルインデックス	変動金利	満期	想定元本	プレミアム(受取)	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
						<u>\$ (5)</u>	<u>\$ 0</u>
売建オプション計						<u>\$ (54)</u>	<u>\$ (78)</u>

●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)－売り

単位:千

取引相手	固定取引 受取金利	満期	2015/2/28時点の 信用スプレッド	想定元本	プレミアム		スワップ契約時価	
					支払(受取)	未実現評価損益	資産	負債
BOA Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	2.337%	\$ 200	\$ (6)	\$ (6)	\$ 0	\$ (12)
BOA France Government Bond	0.250 %	03/20/2020	0.372%	200	(1)	0	0	(1)
BOA South Africa Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	1.778%	200	(6)	(1)	0	(7)
BPS Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	300	(6)	3	0	(3)
BPS Petrobras Global Finance BV	1.000 %	09/20/2019	6.164%	200	(10)	(28)	0	(38)
BRC Indonesia Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	1.186%	100	(1)	1	0	0
BRC Indonesia Government International Bond	1.000 %	03/20/2024	1.918%	100	(14)	7	0	(7)
BRC Russia Government International Bond	1.000 %	12/20/2015	4.341%	400	(13)	3	0	(10)
BRC South Africa Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.848%	700	(29)	3	0	(26)
CBK Freeport-McMoRan, Inc.	1.000 %	03/20/2016	0.630%	100	0	1	1	0
CBK South Africa Government International Bond	1.000 %	06/20/2019	1.699%	150	(6)	2	0	(4)
CBK Teck Resources Ltd.	1.000 %	03/20/2016	0.600%	100	0	1	1	0
DUB Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	100	(2)	1	0	(1)
GST Brazil Government International Bond	1.000 %	09/20/2015	0.991%	100	(1)	1	0	0
GST Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	2.337%	300	(8)	(9)	0	(17)
GST France Government Bond	0.250 %	03/20/2020	0.372%	300	(3)	1	0	(2)
GST Greece Government International Bond	1.000 %	09/20/2015	31.996%	200	(6)	(24)	0	(30)
GST Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	100	(2)	1	0	(1)
HUS Brazil Government International Bond	1.000 %	06/20/2016	1.396%	300	(2)	1	0	(1)
HUS Brazil Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	2.273%	200	(2)	(8)	0	(10)
HUS Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	2.337%	100	(3)	(3)	0	(6)
HUS Indonesia Government International Bond	1.000 %	06/20/2023	1.862%	25	(2)	1	0	(1)
JPM France Government Bond	0.250 %	03/20/2020	0.372%	200	(2)	1	0	(1)
JPM Indonesia Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	1.186%	100	(1)	1	0	0
JPM Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	200	(4)	2	0	(2)
JPM Russia Government International Bond	1.000 %	12/20/2015	4.341%	300	(10)	2	0	(8)
JPM Russia Government International Bond	1.000 %	03/20/2016	4.374%	100	(4)	1	0	(3)
MYC H.J. Heinz Co.	1.000 %	03/20/2020	1.822%	100	(4)	0	0	(4)
UAG Export-Import Bank of China	1.000 %	06/20/2016	0.453%	100	(2)	3	1	0
					\$ (150)	\$ (42)	\$ 3	\$ (195)

クロス通貨スワップ

単位:千

取引相手	受取	支払	満期	想定元本 通貨受取	想定元本 通貨支払	プレミアム 支払/(受取)	未実現 評価損益	スワップ契約時価			
								資産	負債		
BOA	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.100% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2020	\$ 371	EUR 300	\$ 0	\$ 4	\$ 4	\$ 0		
BOA	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.200% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2025	116	100	0	1	1	0		
BPS	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.100% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2020	1,288	977	(73)	13	0	(60)		
CBK	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.200% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2025	872	750	(8)	10	2	0		
DUB	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.100% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2020	1,239	1,000	0	13	13	0		
								\$ (81)	\$ 41	\$ 20	\$ (60)

金利スワップ

単位:千

取引相手	変動金利の		固定金利	満期	想定元本	プレミアム 支払/(受取)	未実現 評価損益	スワップ契約時価			
	支払/受取	変動金利インデックス						資産	負債		
BOA	Pay	BRL-CDI-Compounded	8.420%	01/02/2017	BRL 1,000	\$ 3	\$ (31)	\$ 0	\$ (28)		
BPS	Pay	BRL-CDI-Compounded	11.470%	01/02/2017	400	0	(1)	0	(1)		
BPS	Pay	BRL-CDI-Compounded	12.360%	01/02/2018	700	0	0	0	0		
BPS	Pay	BRL-CDI-Compounded	11.680%	01/04/2021	1,800	(4)	(2)	0	(6)		
JPM	Pay	BRL-CDI-Compounded	11.320%	01/04/2016	600	0	0	0	0		
								\$ (1)	\$ (34)	\$ 0	\$ (35)
スワップ契約計								\$ (232)	\$ (35)	\$ 23	\$ (290)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2015年8月19日）

作成対象期間（2014年8月20日～2015年8月19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	債券率	債先物比率	債券率	純資産額
		期騰	落中率					
9期(2011年8月19日)	円 10,170		% 0.1	% 91.3		% -		百万円 5,916
10期(2012年8月20日)	10,181		0.1	100.7		-		2,216
11期(2013年8月19日)	10,191		0.1	80.9		-		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

*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

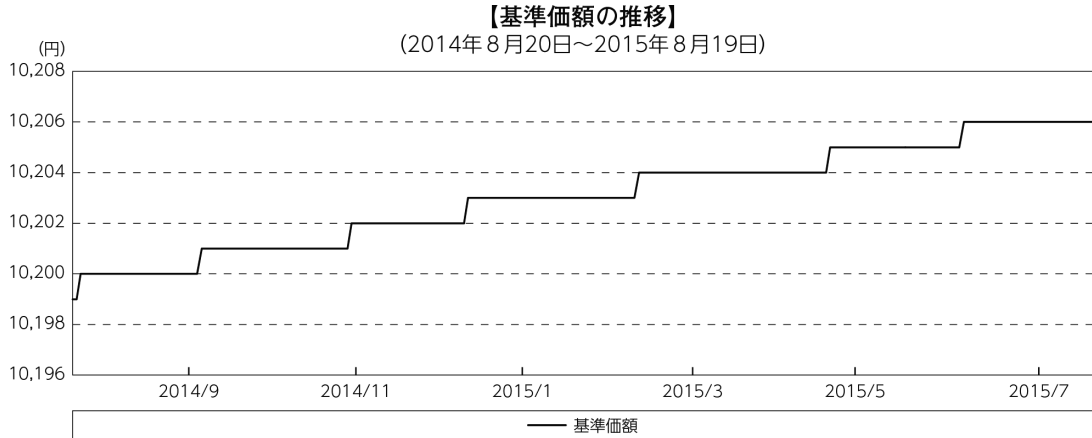
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券率	債先物比率	債券率
		騰	落率				
(期首) 2014年8月19日	円 10,199		% -		% 59.7		% -
8月末	10,200		0.0		70.0		-
9月末	10,200		0.0		62.3		-
10月末	10,201		0.0		52.6		-
11月末	10,202		0.0		52.6		-
12月末	10,202		0.0		54.3		-
2015年1月末	10,203		0.0		90.0		-
2月末	10,203		0.0		59.5		-
3月末	10,204		0.0		52.3		-
4月末	10,204		0.0		62.6		-
5月末	10,205		0.1		59.8		-
6月末	10,205		0.1		41.2		-
7月末	10,206		0.1		46.2		-
(期末) 2015年8月19日	10,206		0.1		44.7		-

*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



○基準価額の変動要因

* 基準価額は0.07%の上昇

基準価額は、期首10,199円から期末は10,206円となりました。

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

国内経済は、企業収益や雇用・所得環境が改善する中で緩やかな回復を続けてきましたが、4-6月期は個人消費や輸出といった内外需が落ち込み、景気回復が小休止状態にあることを示しました。

このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続し、2014年10月の金融政策決定会合では、資産買入れ額の拡大および長期国債買入れの平均残存年限の長期化を図るなど金融緩和を強化しました。

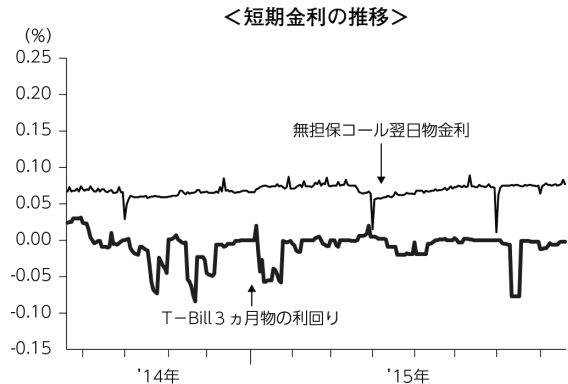
・無担保コール翌日物金利の推移

期を通じて概ね0.06%台から0.07%台で推移しました。

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

2014年9月以降、国内投資家の恒常的な国債需要に加え、日本銀行による買入や海外からの資金流入などによる需給ひっ迫から利回りは低下し、マイナスとなりました。

その後、一時的な需給の緩みにより利回りがプラス圏に戻る局面もありましたが、期末にかけて概ねマイナス圏で推移しました。



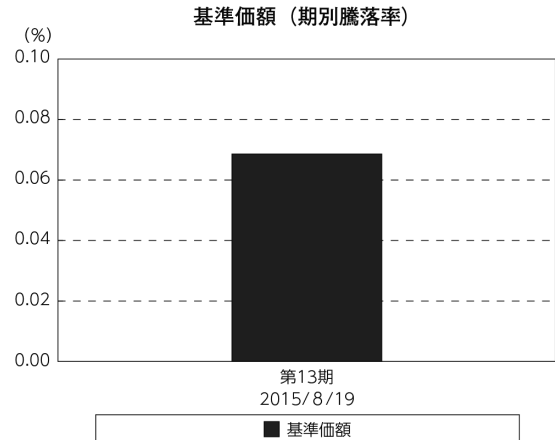
○当ファンドのポートフォリオ

今期の運用につきましては、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー（CP）等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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

今後も、残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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る運用を行なう方針です。

今後とも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

(2014年8月20日～2015年8月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.002 (0.002)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、10,202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

(2014年8月20日～2015年8月19日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	57,121,186	33,710,730 (24,409,350)
	地方債証券	3,262,292	— (1,970,000)
	特殊債券	10,876,852	— (7,504,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,312,770	— (2,240,000)

*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、上段の数字には含まれておりません。

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

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	7,297,610	— (5,300,000)

*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

(2014年8月20日～2015年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 40,912	百万円 5,799	% 14.2	百万円 50	百万円 —	% —

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2015年8月19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	%	%	%	%	%
国債証券	1,180,000 (1,130,000)	1,180,008 (1,129,999)	5.4 (5.1)	— (—)	— (—)	— (—)	5.4 (5.1)
地方債証券	1,281,600 (1,281,600)	1,287,899 (1,287,899)	5.8 (5.8)	— (—)	— (—)	— (—)	5.8 (5.8)
特殊債券 (除く金融債)	4,686,000 (4,686,000)	4,703,401 (4,703,401)	21.3 (21.3)	— (—)	— (—)	— (—)	21.3 (21.3)
金融債券	1,470,000 (1,470,000)	1,473,440 (1,473,440)	6.7 (6.7)	— (—)	— (—)	— (—)	6.7 (6.7)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,200,000 (1,200,000)	1,207,103 (1,207,103)	5.5 (5.5)	— (—)	— (—)	— (—)	5.5 (5.5)
合 計	9,817,600 (9,767,600)	9,851,853 (9,801,844)	44.7 (44.5)	— (—)	— (—)	— (—)	44.7 (44.5)

* () 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。

* —印は組み入れなし。

* 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	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫短期証券	第541回	—	500,000	499,999	2015/9/28
国庫短期証券	第542回	—	200,000	199,999	2015/10/5
国庫短期証券	第546回	—	100,000	99,999	2015/10/19
国庫短期証券	第547回	—	300,000	299,999	2015/10/26
国庫短期証券	第548回	—	30,000	29,999	2015/11/2
国庫債券	利付(2年)第333回	0.1	50,000	50,009	2015/10/15
小	計		1,180,000	1,180,008	
地方債証券					
東京都	公募第625回	1.41	200,000	200,218	2015/9/18
北海道	公募平成17年度第6回	1.4	105,100	105,142	2015/8/31
北海道	公募平成17年度第12回	1.6	50,000	50,365	2016/2/24
神奈川県	公募第136回	1.5	90,000	90,421	2015/12/28
大阪府	公募第284回	1.6	300,000	301,207	2015/11/27
兵庫県	公募平成18年度第7回	2.1	80,000	81,503	2016/7/27
新潟県	公募平成18年度第1回	2.1	6,500	6,617	2016/7/27
共同発行市場地方債	公募第31回	1.5	50,000	50,123	2015/10/23
共同発行市場地方債	公募第32回	1.6	100,000	100,391	2015/11/25
共同発行市場地方債	公募第34回	1.4	200,000	201,130	2016/1/25
共同発行市場地方債	公募第35回	1.6	100,000	100,778	2016/2/25
小	計		1,281,600	1,287,899	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第346回	1.4	300,000	300,095	2015/8/26
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第347回	1.3	352,000	352,411	2015/9/22
首都高速道路債券	政府保証第199回	1.4	50,000	50,018	2015/8/28
阪神高速道路債券	政府保証第148回	1.3	20,000	20,028	2015/9/30
本州四国連絡橋債券	政府保証第27回	1.4	300,000	300,141	2015/8/31
公営企業債券	政府保証第861回	1.6	29,000	29,256	2016/3/17
公営企業債券	政府保証第862回	1.8	117,000	118,337	2016/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証債第1回	1.5	100,000	100,499	2015/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第3回	1.5	590,000	593,701	2016/1/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第5回	1.6	558,000	562,454	2016/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第11回	1.8	170,000	171,994	2016/4/26
首都高速道路債券	政府保証第1回	1.6	400,000	403,726	2016/3/28
中部国際空港債券	政府保証第17回	0.051	300,000	300,000	2016/3/7
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第119回	0.067	200,000	199,993	2015/12/18
地方公共団体金融機構債券	2年第1回	0.135	200,000	200,056	2016/2/26
首都高速道路社債	第6回	0.315	100,000	100,024	2015/9/24
阪神高速道路社債	財投機関債第6回	0.589	100,000	100,166	2015/12/18
中日本高速道路債券	財投機関債第20回	0.417	100,000	100,025	2015/9/18
中日本高速道路社債	財投機関債第37回	0.385	200,000	200,314	2016/2/26
西日本高速道路	第16回	0.246	200,000	200,038	2015/9/18
西日本高速道路	第17回	0.196	300,000	300,113	2015/12/18
小	計		4,686,000	4,703,401	
金融債券					
商工債券	利付第724回い号	0.5	320,000	320,138	2015/9/25
商工債券	利付第733回い号	0.55	300,000	301,185	2016/6/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		%	千円	千円	
商工債券	利付第734回い号	0.55	150,000	150,655	2016/7/27
農林債券	利付第723回い号	0.55	150,000	150,020	2015/8/27
農林債券	利付第724回い号	0.5	50,000	50,021	2015/9/25
農林債券	利付第733回い号	0.55	100,000	100,392	2016/6/27
商工債券	利付(3年)第152回	0.2	100,000	100,013	2015/9/25
商工債券	利付(3年)第153回	0.2	100,000	100,026	2015/10/27
商工債券	利付(3年)第161回	0.25	100,000	100,144	2016/6/27
商工債券	利付(10年)第2回	1.78	100,000	100,841	2016/2/19
小	計		1,470,000	1,473,440	
普通社債券(含む投資法人債券)					
みずほコーポレート銀行	第24回特定社債間限定同順位特約付	0.595	200,000	200,415	2016/1/20
みずほコーポレート銀行	第25回特定社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	100,429	2016/4/20
トヨタファイナンス	第19回社債間限定同等特約付	2.04	200,000	202,217	2016/3/18
三菱UFJリース	第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	502,336	2016/4/22
三菱UFJリース	第22回社債間限定同順位特約付	0.235	100,000	100,066	2016/2/26
東邦瓦斯	第30回社債間限定同順位特約付	2.07	100,000	101,639	2016/6/20
小	計		1,200,000	1,207,103	
合	計		9,817,600	9,851,853	

* 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 2,499,141	% 11.3

* 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

(2015年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,851,853	% 44.3
その他有価証券	2,499,141	11.2
コール・ローン等、その他	9,864,830	44.5
投資信託財産総額	22,215,824	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 (2015年8月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,215,824,811
コール・ローン等	847,502,284
公社債(評価額)	9,851,853,649
その他有価証券	2,499,141,851
未収利息	15,014,658
前払費用	12,080,826
差入保証金	8,990,231,543
(B) 負債	181,800,841
未払金	181,483,841
未払解約金	317,000
(C) 純資産総額(A-B)	22,034,023,970
元本	21,588,342,274
次期繰越損益金	445,681,696
(D) 受益権総口数	21,588,342,274口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,206円

(注) 期首元本額8,478百万円、期中追加設定元本額20,130百万円、期中一部解約元本額7,020百万円、計算口数当たり純資産額10,206円。

○損益の状況 (2014年8月20日～2015年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	61,355,124
受取利息	58,968,909
その他収益金	2,386,215
(B) 有価証券売買損益	△ 49,857,397
売買益	19,664
売買損	△ 49,877,061
(C) 保管費用等	△ 261,886
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,235,841
(E) 前期繰越損益金	169,135,352
(F) 追加信託差損益金	408,020,917
(G) 解約差損益金	△142,710,414
(H) 計(D+E+F+G)	445,681,696
次期繰越損益金(H)	445,681,696

*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。

○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
	百万円
バンクローンファンド（為替ヘッジあり）2014-09	98
バンクローンファンド（為替ヘッジあり）2015-06	146
野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド	20
野村米国ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	90
野村新中國株投資 マネープール・ファンド	78
野村日本ブランド株投資（マネープールファンド）年2回決算型	745
野村新米国ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	9
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネープール・ファンド	1
野村RCM・グリーン・テックロジック マネープール・ファンド	1
野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド	5
野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド）	12
ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド）	2,033
野村新エマージング債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	5
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	8
野村グローバルCB投信（マネープールファンド）年2回決算型	6
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（マネープールファンド）年2回決算型	133
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	0
野村日本スマートシティ株投資 マネープールファンド	1
野村世界高金利通貨投信	151
野村新世界高金利通貨投信	0
コインの未来（毎月分配型）	3
コインの未来（年2回分配型）	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース）	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース）	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース）	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	0
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）毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（ブラジルレアルコース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資（ブラジルレアルコース）年2回決算型	0
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	0
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	0
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	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	0
野村新米国ハイ・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	0
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	0
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	0

ファンド名	当期末 元本額
	百万円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	0
野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型	0
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）年2回決算型	0
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	0
野村新エマージング債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	0
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	0
野村新エマージング債券投信（中国元コース）年2回決算型	0
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村高金利国際機関債投信（毎月分配型）	49
野村アジアCB投信（毎月分配型）	0
野村グローバルCB投信（円コース）毎月分配型	0
野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）毎月分配型	0
野村グローバルCB投信（アジア通貨コース）毎月分配型	0
野村グローバルCB投信（円コース）年2回決算型	0
野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）年2回決算型	0
野村グローバルCB投信（アジア通貨コース）年2回決算型	0
ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA向け）	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（円コース）毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）年2回決算型	0
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	0
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	0
野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型	0
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	0
野村米国ブランド株投資（円コース）毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資（円コース）年2回決算型	0
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	0
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	0
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型	0
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）毎月分配型	0
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）毎月分配型	0
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）年2回決算型	0
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）年2回決算型	0
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）年2回決算型	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	0
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	0
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・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	0
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Aコース)	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	0
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	0
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村カルミニャック・ファンド Aコース	0
野村カルミニャック・ファンド Bコース	0
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	0
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	0
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	0
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	0
ノムラ THE USA Aコース	0
ノムラ THE USA Bコース	0
ノムラ THE EUROPE Aコース	0
ノムラ THE EUROPE Bコース	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
米国変動好金利ファンド Aコース	8
米国変動好金利ファンド Bコース	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村グローバルボンド投信 Aコース	0
野村グローバルボンド投信 Bコース	0
野村グローバルボンド投信 Cコース	0
野村グローバルボンド投信 Dコース	0
野村グローバルボンド投信 Eコース	0
野村グローバルボンド投信 Fコース	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	0
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)毎月分配型	0
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	0
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
野村新興国高配当株トリアルウィング ブラジルレアル毎月分配型	0
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	0
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	0
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	0
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	0
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)	0
ノムラ THE ASIA Aコース	0
ノムラ THE ASIA Bコース	0
第1回 野村短期公社債ファンド	0
第2回 野村短期公社債ファンド	0
第3回 野村短期公社債ファンド	0
第4回 野村短期公社債ファンド	0
第5回 野村短期公社債ファンド	0
第6回 野村短期公社債ファンド	0
第7回 野村短期公社債ファンド	0
第8回 野村短期公社債ファンド	0
第9回 野村短期公社債ファンド	0
第10回 野村短期公社債ファンド	0
第11回 野村短期公社債ファンド	0
第12回 野村短期公社債ファンド	0
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)	5,276
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	3,422
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)2プライス(適格機関投資家専用)	2,296
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	4,635
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家転売制限付)	1,186
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1308(適格機関投資家転売制限付)	1,019
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Bコース	0

*単位未満は切り捨て。

○お知らせ

- ①デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2014年12月4日＞
- ②信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2015年2月23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。

(2015年12月25日現在)

年 月	日
2015年12月	25
2016年1月	18
2月	15
3月	25
4月	－
5月	30
6月	－
7月	4
8月	－
9月	5
10月	－
11月	24
12月	26

※2016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注意ください。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。