

# 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

## 運用報告書(全体版)

第10期(決算日2016年3月23日)

作成対象期間(2015年9月25日～2016年3月23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/資産複合/特殊型(絶対収益追求型)	
信託期間	2011年4月26日から2021年3月23日(当初、2016年3月23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マネージド・フューチャーズ・ディバシファイド・ファンドーアジア通貨クラス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、世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引および為替予約取引等を現実的な主要取引対象とし、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うことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、マネージド・フューチャーズ・ディバシファイド・ファンドーアジア通貨クラス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します。	
主な投資対象	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	マネージド・フューチャーズ・ディバシファイド・ファンドーアジア通貨クラス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。
	マネージド・フューチャーズ・ ディバシファイド・ファンド ーアジア通貨クラス	世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引および為替予約取引等を主要取引対象とします。
	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。
主な投資制限	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	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。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104  
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 配	み 騰 落	中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円	
6期(2014年3月24日)	9,228	0	2.8	0.0	—	98.8	1,711	
7期(2014年9月24日)	12,102	10	31.3	0.0	—	99.0	1,309	
8期(2015年3月23日)	16,270	10	34.5	0.0	—	98.8	1,742	
9期(2015年9月24日)	14,131	10	△13.1	0.0	—	98.9	1,240	
10期(2016年3月23日)	14,496	10	2.7	0.0	—	97.5	1,368	

\* 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。

\* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	債 券 率
		騰 落	率				
(期 首)	円		%	%	%	%	%
2015年9月24日	14,131	—	—	0.0	—	98.9	—
9月末	14,616		3.4	0.0	—	98.9	—
10月末	14,809		4.8	0.0	—	98.9	—
11月末	15,078		6.7	0.0	—	99.1	—
12月末	14,700		4.0	0.0	—	99.2	—
2016年1月末	14,929		5.6	0.0	—	99.3	—
2月末	14,928		5.6	0.0	—	99.4	—
(期 末)							
2016年3月23日	14,506		2.7	0.0	—	97.5	—

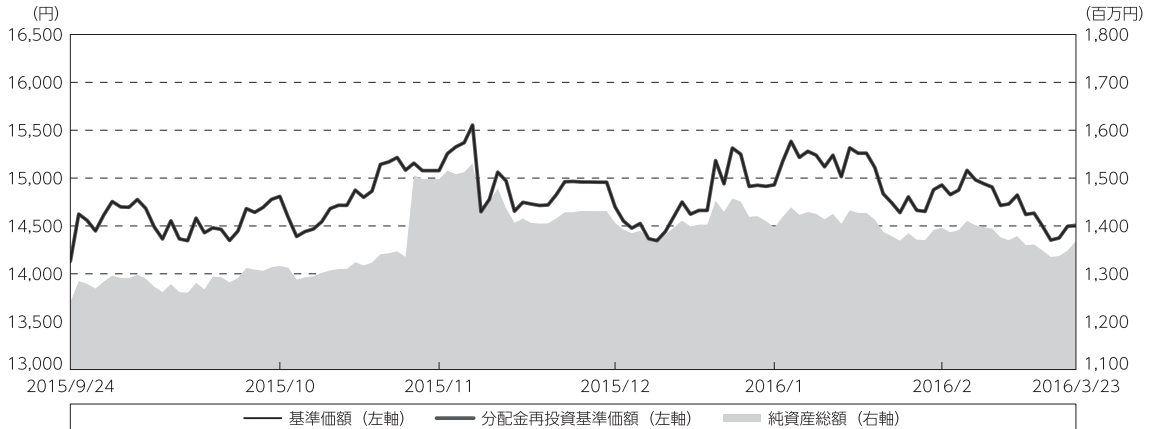
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

\* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：14,131円

期 末：14,496円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 2.7%（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（2015年9月24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）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

実質的に投資している世界各国の取引所に上場されている様々な先物取引等からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）

為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）  
円／アジア通貨の為替変動

### ○投資環境

2015年10月はECB（欧州中央銀行）のドラギ総裁が定例政策委員会後に、追加QE（量的金融緩和）プログラムの実施について言及したことなどから欧州10年国債利回りは低下（価格は上昇）しました。

11月はFOMC（米連邦公開市場委員会）議事録で利上げペースが緩やかなものになるとの見通しが公表されたことなどを受け、米国の株式市場は上昇しました。

12月はECBが発表した追加金融緩和策が予想外に小規模であったことからユーロを買い戻す動きが強まり、ユーロ高・円安となりました。

2016年1月にはECBのドラギ総裁が3月の追加金融緩和の可能性を示唆したことや、1月のドイツCPI（消費者物価指数）が前月比で大幅に低下したことに伴い、欧州10年国債利回りは低下（価格は上昇）しました。

2月は原油価格の下落および世界的な株安を背景にリスク回避的な姿勢が高まったことやECBが3月に追加金融緩和を行なうとの期待などから国債が買われて利回りは低下し、欧州10年国債利回りは低下（価格は上昇）しました。

3月は米ドル高などを背景に安全資産である金は売られ、金の価格は下落しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### 〔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〕

〔マネージド・フューチャーズ・ディバーシファイド・ファンドーアジア通貨クラス〕および〔野村マネー マザーファンド〕の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔マネージド・フューチャーズ・ディバーシファイド・ファンドーアジア通貨クラス〕の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

### 〔マネージド・フューチャーズ・ディバーシファイド・ファンドーアジア通貨クラス〕

主に世界各国の取引所に上場されている様々な先物取引等に投資するとともに、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用しました。

- ・ 共通ポートフォリオにおける各セクターの代表的なロング・ポジション（買い持ち残高）、ショート・ポジション（売り持ち残高）の寄与は以下のようになりました。

【通貨】 日本円・ロング／ユーロ・ショート等がマイナスとなり、通貨セクターとしてはマイナスの影響

【債券】 イタリア国債のロング等がプラスとなり、債券セクターとしてはプラスの影響

【金属】 金のロング等がマイナスとなり、金属セクターとしてはマイナスの影響

【短期金利】 英ポンド短期金利先物のロング等がプラスとなり、短期金利セクターとしてはプラスの影響

【株式】 S&P500指数のショート等がマイナスとなり、株式セクターとしてはマイナスの影響

【エネルギー】 天然ガスのショート等がプラスとなり、エネルギーセクターとしてはプラスの影響

【農産物】 ココアのロング等がマイナスとなり、農産物セクターとしてはマイナスの影響

- ・ 当作成期における共通ポートフォリオの騰落率はプラスとなりました。世界的な供給過剰などを背景に、天然ガスのショート等から主に収益を計上しました。一方、ECBが一段の利下げについて否定的な見方を発表したことなどを背景に、日本円・ロング／ユーロ・ショート等から主に損失を計上しました。

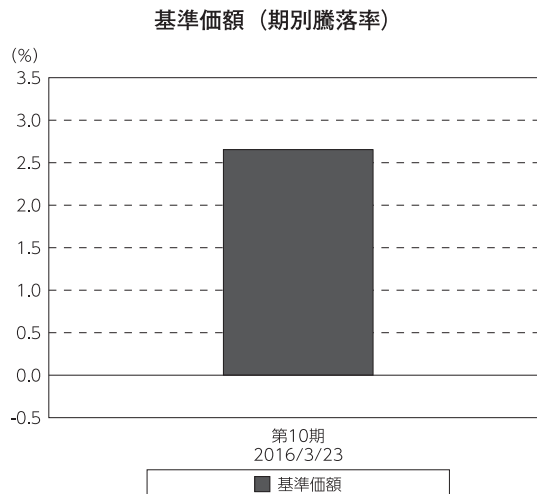
### [野村マネー マザーファンド]

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、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、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。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

収益分配金については、利子・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案して分配を行ないました。

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ないます。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第10期
	2015年9月25日～ 2016年3月23日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.069%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,092

（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

### 〔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〕

〔マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドーアジア通貨クラス〕 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、投資の中心とする〔マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドーアジア通貨クラス〕 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

### 〔マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドーアジア通貨クラス〕

世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引、および為替予約取引等を積極的に活用し、主として市場動向の方向性にそって多数の先物等についてロング・ポジション、あるいはショート・ポジションを構築することにより、中期的に米ドルベースでの絶対収益<sup>※</sup>の獲得を目指して運用を行なうことを基本とします。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

また、原則として純資産総額とほぼ同額程度、米ドルを売り、アジア通貨を買う為替取引を行ないます。

### 〔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、あわせて債券現先取引やコール・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、よろしくお願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化の動きについて

店頭デリバティブ取引に関して、将来、国際的に規制の強化等が予定されています。ファンドが投資対象とする外国投資信託が原則として活用する店頭デリバティブ取引（オプション、NDFおよびNDO等を含みます。）が当該規制強化等の対象取引となり、かつ、当該取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合、当該現金等を資産の一部として追加的に保有することとなります。その場合、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

(2015年9月25日～2016年3月23日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 75	% 0.507	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(21)	(0.144)	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 ）	(52)	(0.347)	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	0.002	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 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	75	0.509	
期中の平均基準価額は、14,843円です。			

\* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

\* 各項目の費用は、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）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2015年9月25日～2016年3月23日)

## 投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	マネーゾド・フューチャーズ・ディバースィファイド・ファンドーアジア通貨クラス	口 35,576	千円 336,980	口 22,822	千円 214,702

\* 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9月25日～2016年3月23日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;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&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
預金	百万円 240	百万円 240	% 100.0	百万円 212	百万円 212	% 100.0

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 10,121	百万円 2,124	% 21.0	百万円 -	百万円 -	% -
預金	102,917	102,917	100.0	96,580	96,580	100.0

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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年3月23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	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
マネージド・フューチャーズ・ディバーシファイド・ ファンドーアジア通貨クラス	口 134,590	口 147,344	千円 1,334,199	% 97.5
合 計	134,590	147,344	1,334,199	97.5

\*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	期首(前期末)		当 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 983	千口 983	千円 983	千円 1,004

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年3月23日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,334,199	96.9
野村マネー マザーファンド	1,004	0.1
コール・ローン等、その他	41,407	3.0
投資信託財産総額	1,376,610	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 (2016年3月23日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,376,610,210
コール・ローン等	41,405,863
投資信託受益証券(評価額)	1,334,199,920
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,004,427
(B) 負債	7,939,189
未払収益分配金	944,174
未払信託報酬	6,973,054
その他未払費用	21,961
(C) 純資産総額(A-B)	1,368,671,021
元本	944,174,221
次期繰越損益金	424,496,800
(D) 受益権総口数	944,174,221口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,496円

(注) 期首元本額878百万円、期中追加設定元本額151百万円、期中一部解約元本額85百万円、計算口数当たり純資産額14,496円。

## ○損益の状況 (2015年9月25日～2016年3月23日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	50,098,547
受取配当金	50,091,418
受取利息	7,129
(B) 有価証券売買損益	△ 19,445,857
売買益	5,066,667
売買損	△ 24,512,524
(C) 信託報酬等	△ 6,995,015
(D) 当期損益金(A+B+C)	23,657,675
(E) 前期繰越損益金	217,118,917
(F) 追加信託差損益金	184,664,382
(配当等相当額)	( 207,806,083)
(売買損益相当額)	(△ 23,141,701)
(G) 計(D+E+F)	425,440,974
(H) 収益分配金	△ 944,174
次期繰越損益金(G+H)	424,496,800
追加信託差損益金	184,664,382
(配当等相当額)	( 207,806,136)
(売買損益相当額)	(△ 23,141,754)
分準備積立金	461,845,310
繰越損益金	△222,012,892

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

\*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

（注）分配金の計算過程（2015年9月25日～2016年3月23日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年9月25日～ 2016年3月23日
a. 配当等収益(経費控除後)	43,105,873円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	207,806,136円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	419,683,611円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	670,595,620円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	7,102円
g. 分配金	944,174円
h. 分配金(1万円当たり)	10円

## ○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金（税込み）	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

（2016年3月23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(20,429,285千口)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	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	%	%	%	%	%
地方債証券	1,580,310	1,583,383	7.6	—	—	—	7.6
	(1,580,310)	(1,583,383)	(7.6)	(—)	(—)	(—)	(7.6)
特殊債券 (除く金融債)	1,787,000	1,788,690	8.6	—	—	—	8.6
	(1,787,000)	(1,788,690)	(8.6)	(—)	(—)	(—)	(8.6)
金融債券	3,780,000	3,784,226	18.1	—	—	—	18.1
	(3,780,000)	(3,784,226)	(18.1)	(—)	(—)	(—)	(18.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	2,300,000	2,304,815	11.0	—	—	—	11.0
	(2,300,000)	(2,304,815)	(11.0)	(—)	(—)	(—)	(11.0)
合 計	9,447,310	9,461,115	45.4	—	—	—	45.4
	(9,447,310)	(9,461,115)	(45.4)	(—)	(—)	(—)	(45.4)

\*（ ）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	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>			千円	千円	
東京都	公募第634回	1.86	1,000	1,004	2016/6/20
東京都	公募第636回	2.04	101,500	101,980	2016/6/20
北海道	公募平成18年度第7回	2.0	1,500	1,517	2016/10/31
北海道	公募（5年）平成23年度第2回	0.53	7,200	7,205	2016/5/31
神奈川県	公募第138回	1.7	11,000	11,001	2016/3/24
神奈川県	公募（5年）第49回	0.37	101,700	101,856	2016/9/20
大阪府	公募第288回	1.78	300,000	300,095	2016/3/30
大阪府	公募第294回	2.0	12,000	12,115	2016/9/28
大阪府	公募第295回	1.9	1,000	1,010	2016/10/28
大阪府	公募（5年）第71回	0.76	430,000	430,066	2016/3/30
大阪府	公募（5年）第72回	0.61	3,000	3,001	2016/4/27
大阪府	公募（5年）第73回	0.51	102,000	102,081	2016/5/30
大阪府	公募（5年）第77回	0.42	100,000	100,209	2016/10/28
京都府	公募平成23年度第1回	0.49	7,000	7,007	2016/6/22
兵庫県	公募平成18年度第7回	2.1	80,000	80,554	2016/7/27
静岡県	公募平成17年度第7回	1.7	14,100	14,103	2016/3/28
埼玉県	公募平成18年度第1回	1.8	13,500	13,522	2016/4/27
福岡県	公募平成18年度第3回	1.9	1,000	1,010	2016/10/31
千葉県	公募平成18年度第4回	1.8	8,600	8,686	2016/10/25
新潟県	公募平成18年度第1回	2.1	6,500	6,543	2016/7/27
群馬県	公募第3回	1.9	9,000	9,106	2016/11/25
大分県	公募平成18年度第1回	1.8	23,000	23,236	2016/10/31
共同発行市場地方債	公募第36回	1.6	2,000	2,000	2016/3/25
共同発行市場地方債	公募第38回	2.0	5,000	5,016	2016/5/25
共同発行市場地方債	公募第39回	1.9	2,000	2,009	2016/6/24
共同発行市場地方債	公募第40回	2.1	8,000	8,053	2016/7/25
共同発行市場地方債	公募第41回	2.0	6,000	6,047	2016/8/25
共同発行市場地方債	公募第43回	1.8	4,000	4,039	2016/10/25
熊本県	公募平成18年度第2回	1.8	7,500	7,575	2016/10/27
名古屋市	公募第455回	1.9	1,000	1,004	2016/6/20
名古屋市	公募第456回	1.82	16,000	16,134	2016/9/20
京都市	公募平成17年度第4回	1.7	1,000	1,000	2016/3/30
京都市	公募平成23年度第1回	0.493	90,000	90,142	2016/7/29
京都市	公募平成23年度第3回	0.364	4,000	4,005	2016/9/29
札幌市	公募（5年）平成23年度第5回	0.4	12,900	12,918	2016/9/20
川崎市	公募（5年）第29回	0.36	12,200	12,215	2016/9/20
北九州市	公募（5年）平成23年度第1回	0.36	7,000	7,009	2016/9/28
仙台市	公募平成23年度第1回	0.36	57,410	57,544	2017/1/27
鹿児島県	公募平成18年度第1回	1.9	3,200	3,234	2016/10/31
鹿児島県	公募（5年）平成23年度第1回	0.37	6,500	6,511	2016/10/31
小	計		1,580,310	1,583,383	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
公営企業債券	政府保証第862回	1.8	117,000	117,160	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11回	1.8	170,000	170,271	2016/4/26
首都高速道路債券	政府保証第1回	1.6	400,000	400,092	2016/3/28

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回		0.243	200,000	200,087	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	100,449	2016/6/20
公営企業債券 第19回財投機関債		2.02	100,000	100,013	2016/3/24
首都高速道路 第8回		0.439	140,000	140,242	2016/9/20
都市再生債券 財投機関債第75回		0.213	100,000	100,035	2016/6/20
関西国際空港社債 財投機関債第31回		0.504	70,000	70,143	2016/9/20
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	390,000	390,193	2016/6/20
小 計			1,787,000	1,788,690	
<b>金融債券</b>					
商工債券 利付第730回い号		0.7	100,000	100,009	2016/3/25
商工債券 利付第731回い号		0.7	100,000	100,064	2016/4/27
商工債券 利付第732回い号		0.6	100,000	100,099	2016/5/27
商工債券 利付第733回い号		0.55	300,000	300,371	2016/6/27
商工債券 利付第734回い号		0.55	170,000	170,276	2016/7/27
商工債券 利付第736回い号		0.45	300,000	300,576	2016/9/27
商工債券 利付第737回い号		0.45	100,000	100,218	2016/10/27
農林債券 利付第730回い号		0.7	200,000	200,019	2016/3/25
農林債券 利付第731回い号		0.75	200,000	200,134	2016/4/27
農林債券 利付第732回い号		0.6	100,000	100,099	2016/5/27
農林債券 利付第733回い号		0.55	180,000	180,224	2016/6/27
農林債券 利付第734回い号		0.6	50,000	50,094	2016/7/27
農林債券 利付第735回い号		0.45	150,000	150,240	2016/8/26
農林債券 利付第736回い号		0.5	150,000	150,330	2016/9/27
農林債券 利付第737回い号		0.5	80,000	80,198	2016/10/27
しんきん中金債券 利付第256回		0.7	100,000	100,005	2016/3/25
しんきん中金債券 利付第257回		0.7	100,000	100,061	2016/4/27
しんきん中金債券 利付第258回		0.55	300,000	300,253	2016/5/27
しんきん中金債券 利付第259回		0.55	100,000	100,135	2016/6/27
しんきん中金債券 利付第261回		0.45	300,000	300,556	2016/8/26
商工債券 利付(3年)第158回		0.15	100,000	100,004	2016/3/25
商工債券 利付(3年)第160回		0.25	100,000	100,035	2016/5/27
商工債券 利付(3年)第161回		0.25	200,000	200,090	2016/6/27
商工債券 利付(3年)第164回		0.2	200,000	200,124	2016/9/27
小 計			3,780,000	3,784,226	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
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	300,000	300,156	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	500,000	500,772	2016/7/20
みずほコーポレート銀行 第27回特定社債間限定同順位特約付		0.515	200,000	200,560	2016/10/20
三菱東京UFJ銀行 第126回特定社債間限定同順位特約付		0.545	100,000	100,152	2016/7/14
三菱東京UFJ銀行 第129回特定社債間限定同順位特約付		0.465	100,000	100,248	2016/10/20
三菱UFJリース 第13回社債間限定同順位特約付		0.796	500,000	500,301	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	400,000	401,625	2016/12/14
東京急行電鉄 第67回社債間限定同順位特約付		1.55	100,000	100,519	2016/7/29
東邦瓦斯 第30回社債間限定同順位特約付		2.07	100,000	100,476	2016/6/20
小 計			2,300,000	2,304,815	
合 計			9,447,310	9,461,115	

\* 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 1,899,564	% 9.1

\*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。

# マネーゾド・フューチャーズ・ディバーシファイド・ファンド (日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)

2015年6月30日決算

(計算期間：2014年7月1日～2015年6月30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
主 要 取 引 対 象	世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引、および為替予約取引等
運 用 方 針	世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引、および為替予約取引等を積極的に活用し、主として市場動向の方向性にそって多数の先物等についてロング・ポジション、あるいはショート・ポジションを構築することにより、中期的に米ドルベースでの絶対収益の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投 資 顧 問 会 社	AHLパートナーズ・エルエルピー
共 同 投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 銀 行	ノムラ・バンク (ルクセンブルグ) エス・エー
副 管 理 事 務 代 行 会 社	シトコ・ファンド・サービスズ (アイルランド) リミテッド
モ ニ タ リ ン グ 会 社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社

\*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6月30日に終了する計測期間  
(米ドル)

<b>費用</b>	
投資顧問、サービス顧問および共同投資顧問報酬	179,407
モニタリング費用	61,845
管理事務代行会社および副管理事務代行会社費用	123,704
保管費用	37,387
銀行手数料	18,220
受託報酬	24,745
法務報酬	2,533
立替費用	12,367
専門家報酬	26,333
雑費用	654
	<hr/>
費用合計	487,195
	<hr/>
<b>純投資損益</b>	(487,195)
	<hr/>
投資有価証券売買に係る損益	7,962,593
外国通貨および為替先渡し契約に係る損益	(15,166,416)
	<hr/>
<b>当期実現純損益</b>	(7,203,823)
	<hr/>
投資有価証券評価差損益	16,329,260
外国為替先渡し契約に係る評価差損益	(1,580,583)
	<hr/>
<b>当期評価差損益</b>	14,748,677
	<hr/>
<b>運用の結果による純資産の増減額</b>	7,057,659
	<hr/> <hr/>

	期末1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産
Class ASC (in JPY)	9,299	328,090	3,050,929,096
Class RSC (in JPY)	6,821	755,627	5,154,262,683
Class JPY (in JPY)	7,779	629,595	4,897,800,142

組入資産明細  
2015年6月30日現在  
(米ドル)

数量	銘柄	評価額	投資比率(%)
ケイマン諸島			
マネージドアカウント			
1,013,048	MFDF-INVESTMENT PORTFOLIO ACCOUNT	104,961,863	98.02
		104,961,863	98.02
	ケイマン諸島計	104,961,863	98.02
投資有価証券合計		<b>104,961,863</b>	<b>98.02</b>

外国為替先渡し契約

2015年6月30日現在

通貨(買い)	通貨(売り)	満期	未実現損益(米ドル)
JPY 2,546,363,707	USD 20,523,721	July 10,2015	287,561
JPY 2,591,130,733	USD 21,128,906	July 27,2015	52,663
BRL 8,536,854	USD 2,700,000	August 04,2015	2,806
JPY 21,240,453	USD 171,412	July 10,2015	2,185
JPY 69,772,701	USD 568,265	July 27,2015	2,102
JPY 69,786,452	USD 568,265	July 10,2015	2,096
JPY 9,994,949	USD 80,573	July 10,2015	1,114
JPY 14,341,538	USD 116,467	July 27,2015	769
JPY 14,343,984	USD 116,467	July 10,2015	765
JPY 9,495,376	USD 76,842	July 10,2015	763
JPY 7,146,119	USD 57,766	July 27,2015	651
JPY 7,147,332	USD 57,766	July 10,2015	649
JPY 4,947,653	USD 40,006	July 10,2015	430
JPY 4,847,776	USD 39,236	July 10,2015	384
JPY 4,647,829	USD 37,642	July 10,2015	344

通貨(買い)		通貨(売り)		満期	未実現損益(米ドル)
JPY	799,641	USD	6,453	July 10,2015	82
JPY	1,499,121	USD	12,190	July 27,2015	65
JPY	1,499,365	USD	12,190	July 10,2015	64
ZAR	48,643	USD	3,898	July 10,2015	58
JPY	349,806	USD	2,805	July 10,2015	54
ZAR	40,401	USD	3,235	July 10,2015	51
JPY	1,399,453	USD	11,397	July 27,2015	42
JPY	1,399,729	USD	11,397	July 10,2015	42
JPY	1,349,333	USD	10,996	July 10,2015	32
ZAR	23,482	USD	1,881	July 10,2015	28
JPY	349,840	USD	2,831	July 10,2015	28
ZAR	11,764	USD	942	July 10,2015	14
JPY	99,946	USD	806	July 10,2015	11
ZAR	5,067	USD	402	July 10,2015	9
JPY	99,946	USD	807	July 27,2015	9
JPY	99,963	USD	807	July 10,2015	9
JPY	49,973	USD	400	July 10,2015	8
ZAR	5,041	USD	404	July 10,2015	6
ZAR	5,020	USD	403	July 10,2015	5
ZAR	3,364	USD	269	July 10,2015	4
ZAR	4,972	USD	400	July 10,2015	4
ZAR	1,689	USD	134	July 10,2015	3
JPY	49,970	USD	405	July 27,2015	3
JPY	49,979	USD	405	July 10,2015	3
ZAR	1,657	USD	133	July 10,2015	1
JPY	49,973	USD	407	July 27,2015	1
JPY	49,981	USD	407	July 10,2015	1
AUD	525	USD	402	July 10,2015	0
AUD	175	USD	134	July 10,2015	0
ZAR	1,665	USD	135	July 10,2015	0
ZAR	1,670	USD	135	July 27,2015	0
AUD	173	USD	133	July 10,2015	0

通貨(買い)		通貨(売り)		満期	未実現損益(米ドル)
AUD	521	USD	400	July 10,2015	(1)
ZAR	1,649	USD	135	July 10,2015	(1)
ZAR	1,654	USD	135	July 27,2015	(1)
AUD	174	USD	135	July 10,2015	(1)
AUD	175	USD	135	July 27,2015	(1)
AUD	174	USD	135	July 10,2015	(1)
AUD	174	USD	135	July 27,2015	(1)
AUD	349	USD	269	July 10,2015	(2)
AUD	524	USD	404	July 10,2015	(2)
BRL	846	USD	270	August 04,2015	(2)
AUD	2,451	USD	1,881	July 10,2015	(2)
AUD	521	USD	403	July 10,2015	(3)
BRL	843	USD	270	August 04,2015	(4)
AUD	1,223	USD	942	July 10,2015	(5)
AUD	5,078	USD	3,898	July 10,2015	(5)
AUD	1,567	USD	1,211	July 10,2015	(10)
AUD	1,568	USD	1,211	July 27,2015	(10)
BRL	11,854	USD	3,763	August 04,2015	(11)
ZAR	14,758	USD	1,211	July 10,2015	(11)
ZAR	14,801	USD	1,211	July 27,2015	(12)
AUD	4,194	USD	3,235	July 10,2015	(20)
BRL	24,555	USD	7,796	August 04,2015	(23)
BRL	7,555	USD	2,423	August 04,2015	(31)
ZAR	100,475,751	USD	8,179,246	July 10,2015	(7,664)
BRL	4,556,968	USD	1,456,834	August 04,2015	(14,078)
BRL	15,413,964	USD	4,900,000	August 04,2015	(19,871)
BRL	6,788,663	USD	2,200,000	August 04,2015	(50,679)
ZAR	90,816,039	USD	7,416,714	July 27,2015	(54,553)
BRL	12,126,831	USD	3,900,000	August 04,2015	(60,593)
AUD	9,725,461	USD	7,565,631	July 27,2015	(117,577)
AUD	10,842,778	USD	8,433,404	July 10,2015	(121,008)
USD	711,680	AUD	920,646	July 10,2015	5,886

通貨(買い)		通貨(売り)		満期	未実現損益(米ドル)
USD	123,911	AUD	160,449	July 10,2015	906
USD	37,436	AUD	48,536	July 10,2015	226
USD	11,378	BRL	35,451	August 04,2015	155
USD	14,879	BRL	46,573	August 04,2015	134
USD	8,914	ZAR	108,399	July 27,2015	127
USD	8,914	ZAR	108,079	July 10,2015	124
USD	7,563	ZAR	91,975	July 27,2015	108
USD	17,828	BRL	55,978	August 04,2015	106
USD	7,563	ZAR	91,704	July 10,2015	105
USD	7,566	ZAR	92,218	July 27,2015	91
USD	15,127	BRL	47,497	August 04,2015	90
USD	7,566	ZAR	91,948	July 10,2015	88
USD	13,890	AUD	18,008	July 10,2015	84
USD	7,439	AUD	9,609	July 27,2015	80
USD	7,439	AUD	9,600	July 10,2015	80
USD	8,635	AUD	11,163	July 10,2015	78
USD	8,914	AUD	11,545	July 27,2015	73
USD	8,914	AUD	11,534	July 10,2015	72
USD	5,495	AUD	7,082	July 10,2015	65
USD	5,404	ZAR	65,870	July 27,2015	65
USD	5,404	ZAR	65,677	July 10,2015	63
USD	7,439	ZAR	90,997	July 27,2015	63
USD	7,563	AUD	9,795	July 27,2015	62
USD	7,439	ZAR	90,726	July 10,2015	61
USD	7,563	AUD	9,786	July 10,2015	61
USD	5,689	AUD	7,350	July 27,2015	60
USD	5,689	AUD	7,343	July 10,2015	59
USD	6,852	AUD	8,864	July 10,2015	57
USD	7,566	AUD	9,852	July 27,2015	21
USD	7,566	AUD	9,843	July 10,2015	20
USD	7,327	ZAR	90,200	July 27,2015	16
USD	5,404	AUD	7,037	July 27,2015	15

通貨(買い)		通貨(売り)		満期	未実現損益(米ドル)
USD	5,404	AUD	7,030	July 10,2015	15
USD	7,327	ZAR	89,934	July 10,2015	14
USD	6,242	ZAR	76,837	July 27,2015	13
USD	6,242	ZAR	76,610	July 10,2015	12
USD	539	AUD	697	July 10,2015	5
USD	135	AUD	175	July 10,2015	1
USD	135	AUD	175	July 10,2015	1
USD	5,689	ZAR	70,185	July 27,2015	0
USD	135	ZAR	1,688	July 10,2015	(2)
USD	135	ZAR	1,688	July 10,2015	(2)
USD	5,689	ZAR	69,974	July 10,2015	(2)
USD	1,079	BRL	3,436	August 04,2015	(8)
USD	539	ZAR	6,743	July 10,2015	(9)
USD	6,242	AUD	8,169	July 27,2015	(14)
USD	6,242	AUD	8,161	July 10,2015	(15)
USD	7,327	AUD	9,589	July 27,2015	(16)
USD	7,327	AUD	9,581	July 10,2015	(17)
USD	798	JPY	99,951	July 10,2015	(18)
USD	1,608	JPY	199,902	July 10,2015	(26)
USD	5,495	ZAR	67,895	July 10,2015	(27)
USD	19,956	JPY	2,449,105	July 10,2015	(60)
USD	10,809	BRL	34,354	August 04,2015	(68)
USD	12,484	BRL	39,705	August 04,2015	(86)
USD	6,852	ZAR	85,353	July 10,2015	(89)
USD	15,132	BRL	48,096	August 04,2015	(95)
USD	14,655	BRL	46,610	August 04,2015	(101)
USD	10,393	JPY	1,284,434	July 10,2015	(104)
USD	17,271	BRL	54,980	August 04,2015	(136)
USD	16,206	JPY	1,999,589	July 10,2015	(136)
USD	16,206	JPY	1,999,260	July 27,2015	(137)
USD	8,635	ZAR	107,899	July 10,2015	(140)
USD	16,972	JPY	2,099,256	July 10,2015	(185)

通貨(買い)		通貨(売り)		満期	未実現損益(米ドル)
USD	13,890	ZAR	173,466	July 10,2015	(218)
USD	53,230	JPY	6,548,039	July 10,2015	(286)
USD	53,230	JPY	6,546,975	July 27,2015	(289)
USD	36,058	JPY	4,449,087	July 10,2015	(303)
USD	36,058	JPY	4,448,355	July 27,2015	(305)
USD	25,783	JPY	3,198,768	July 10,2015	(360)
USD	59,984	JPY	7,399,920	July 10,2015	(495)
USD	59,984	JPY	7,398,541	July 27,2015	(496)
USD	37,436	ZAR	467,521	July 10,2015	(587)
USD	86,986	JPY	10,750,241	July 10,2015	(875)
USD	123,911	ZAR	1,545,917	July 10,2015	(1,817)
USD	627,701	ZAR	7,831,209	July 10,2015	(9,202)
IDR	117,145,470,000	USD	8,667,644	July 15,2015	100,481
INR	567,642,600	USD	8,789,418	July 15,2015	82,796
CNY	54,813,610	USD	8,904,818	September 16,2015	(119,196)
					<b>(33,547)</b>

# 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 中 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		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

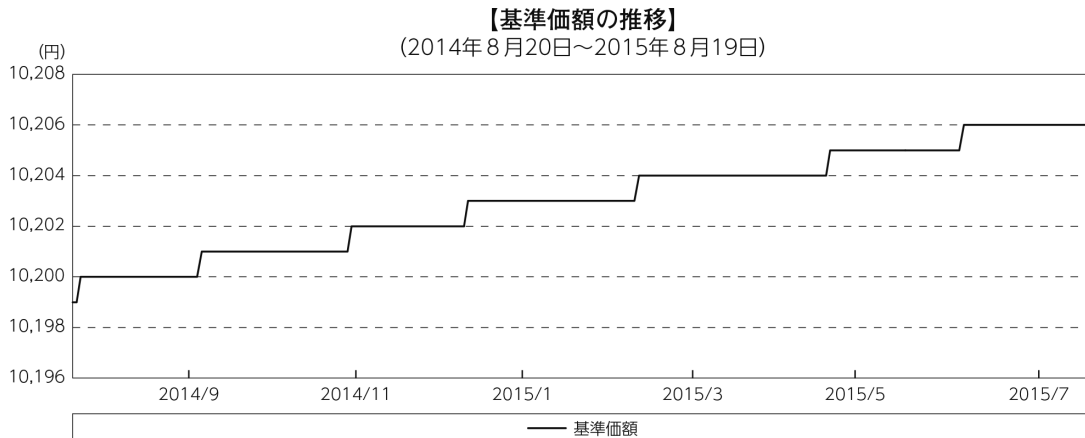
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰 落	率			
(期 首) 2014年8月19日	円 10,199		% —	% 59.7	% —	% —
8月末	10,200		0.0	70.0	—	—
9月末	10,200		0.0	62.3	—	—
10月末	10,201		0.0	52.6	—	—
11月末	10,202		0.0	52.6	—	—
12月末	10,202		0.0	54.3	—	—
2015年1月末	10,203		0.0	90.0	—	—
2月末	10,203		0.0	59.5	—	—
3月末	10,204		0.0	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。

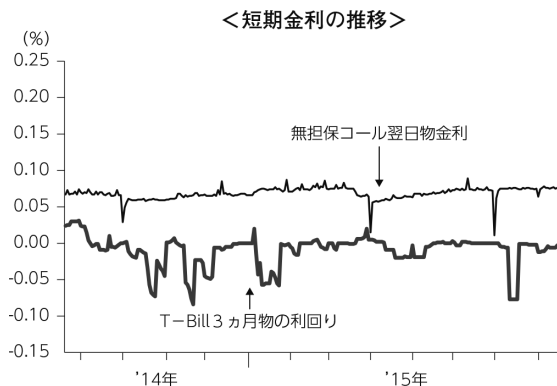
### ・無担保コール翌日物金利の推移

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。



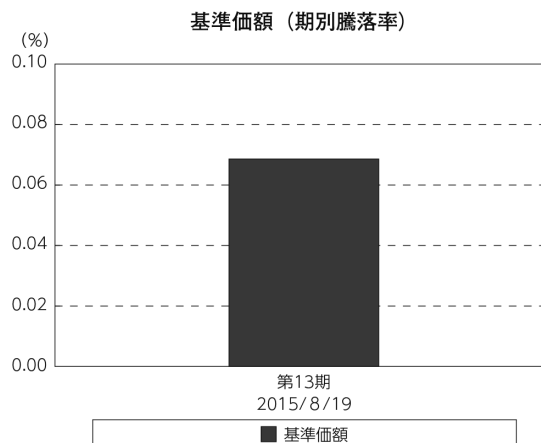
## ○当ファンドのポートフォリオ

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
<b>国債証券</b>			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	
<b>地方債証券</b>					
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	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
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	
<b>金融債券</b>					
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
<b>金融債券</b>		%	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	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
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	9
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資 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
野村新エマージング債券投信 (円コース) 年2回決算型	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(ブラジルリアルコース)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(ブラジルリアルコース)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(米ドルコース)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プルウィング ブラジルリアル毎月分配型	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＞

## 〈「ノムラ・グローバルトレンド（バスケット通貨選択型）」の 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。

(2016年3月23日現在)

年 月	「円コース」 「資源国通貨コース」	「アジア通貨コース」
2016年3月	24、25、28	23、24、25、28、31
4月	28	1、4、13、14、15、28
5月	2、13、16、27、30	2、6、13、16、27、30
6月	22、23	8、9、10、22、23
7月	1、4	1、4、5、6、7、8
8月	12、15、26、29	12、15、16、17、26、29
9月	2、5	2、5、9、12、14、15、16、30
10月	31	3、4、5、6、7、11、12、31
11月	1、10、11、22、24	1、10、11、22、24
12月	22、26、27	9、12、22、26、27

※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。