

野村日本高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型

運用報告書(全体版)

第8期(決算日2016年5月23日)

作成対象期間(2015年11月25日～2016年5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/国内/株式 | |
| 信託期間 | 2012年6月19日から2022年5月23日(当初、2017年7月24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ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円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を通じて、日本の高配当利回り株式(以下、「高配当株」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準の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指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円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することを基本とします。 | |
| 主な投資対象 | 野村日本高配当株 プレミアム(円コース) 年2回決算型 | ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円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。 |
| | ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円クラス 野村マネー マザーファンド | 日本の高配当株を主要投資対象とします。加えて、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用します。 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 | 野村日本高配当株 プレミアム(円コース) 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 込 分 配 金 | 騰 落 中 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 4期(2014年5月22日) | 13,141 | 10 | △ 4.2 | 0.0 | — | 99.0 | 7,313 |
| 5期(2014年11月25日) | 15,339 | 10 | 16.8 | 0.0 | — | 98.6 | 6,247 |
| 6期(2015年5月22日) | 17,791 | 10 | 16.1 | 0.0 | — | 98.5 | 6,577 |
| 7期(2015年11月24日) | 17,044 | 10 | △ 4.1 | 0.0 | — | 98.0 | 6,893 |
| 8期(2016年5月23日) | 14,377 | 10 | △15.6 | 0.0 | — | 99.2 | 5,592 |

*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 |
|-------------|--------|-------|-----|-----------|-----------|-----------------|
| | | 騰 落 率 | 率 | | | |
| (期 首) | 円 | % | % | % | % | % |
| 2015年11月24日 | 17,044 | — | 0.0 | — | 98.0 | |
| 11月末 | 16,956 | △ 0.5 | 0.0 | — | 98.8 | |
| 12月末 | 16,624 | △ 2.5 | 0.0 | — | 96.8 | |
| 2016年1月末 | 15,122 | △11.3 | 0.0 | — | 98.5 | |
| 2月末 | 14,146 | △17.0 | 0.0 | — | 98.9 | |
| 3月末 | 14,599 | △14.3 | 0.0 | — | 99.3 | |
| 4月末 | 14,897 | △12.6 | 0.0 | — | 99.3 | |
| (期 末) | | | | | | |
| 2016年5月23日 | 14,387 | △15.6 | 0.0 | — | 99.2 | |

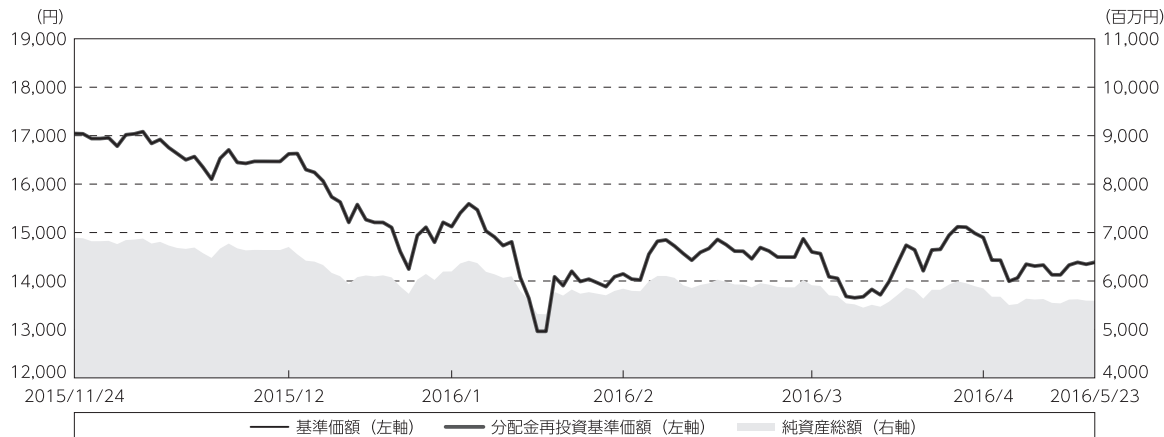
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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



（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11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日本の高配当利回り株式（以下、「高配当株」といいます。）からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・実質的に投資している日本の高配当株からのインカムゲイン
- ・実質的に保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」による、オプション価値の上昇（または下落）※

※ファンドはコール・オプションの売却を行いますので、オプションの価値が上昇すれば基準価額の下落要因となり、オプションの価値が下落すればプレミアム収入を上限として基準価額の上昇要因となります。

○投資環境

<日本の株式市場>

当作成期における日本の株式市場の株価は下落しました。

(期首～2015年12月下旬)

- (下 落) ECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和策が市場の期待を下回ったことや、国際原油市況の下落などが嫌気されたこと。
- (上 昇) FOMC（米連邦公開市場委員会）が9年半ぶりとなる利上げを決定し米国の景気回復を示したことなどが好感されたこと。
- (下 落) 日銀の12月の金融政策決定会合の内容が金融緩和への手詰まり感の表れと受け取られたことや、為替市場で円高ドル安が進行したことを受けて投資家心理が悪化したこと。

(2016年1月上旬～2016年2月中旬)

- (下 落) 中国株式市場の下落や中東の地政学的リスクの高まり、国際原油市況の下落などをを受けてリスク回避の姿勢が強まったこと。また、為替市場で円高ドル安が進行し、国内企業の来期業績見通しに対する不透明感が強まったこと。
- (上 昇) ECBのドラギ総裁が将来の追加金融緩和を示唆する発言をしたことや、日銀が1月末の金融政策決定会合で「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことなどが好感されたこと。
- (下 落) 米国金融政策に対する先行き不透明感の高まりや、国際原油市況の悪化、欧州大手金融機関の信用不安などが嫌気されたこと。加えて、円高進行による国内企業の業績下振れ懸念や低調な決算発表などの悪材料も重なったこと。

(2016年2月下旬～2016年3月下旬)

- (上 昇) 米国経済指標の堅調な結果を受けて米国株式市場が上昇したことや、ECBが追加金融緩和を決定したことなどにより、リスク回避の姿勢が後退したこと。
- (横ばい) FOMCの結果を受け米国の利上げペースが鈍化するとの見通しから米国株式市場が上昇したことなどが好感された一方で、円高ドル安の進行により国内企業の業績下振れ懸念が強まったこと。

(2016年4月上旬～期末)

- (下 落) 日銀短観の景況感が予想を下回ったことや、円高進行による国内企業の業績下振れ懸念が高まったことなどが嫌気されたこと。
- (上 昇) 円高に歯止めがかかったことや、主要国株式市場や国際原油市況が上昇に転じたことなどが好感されたこと。
- (下 落) 熊本地震の影響や産油国会合で原油増産凍結が見送られたことなどが嫌気されたこと。
- (上 昇) 原油価格が底堅く推移したことや米国株式市場が上昇したことなどが好感されたこと。

- (下 落) 日銀が4月末の金融政策決定会合で、市場予想に反して金融政策の現状維持を決定したことや、その結果を受けて為替市場で急速に円高ドル安が進行したことなどが嫌気されたこと。
- (上 昇) 国際原油市況が上昇したことや、為替市場で円高ドル安の進行に歯止めがかかったことなどをを受けてリスク回避の姿勢が後退したこと。

○当ファンドのポートフォリオ

【野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型】

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー・日本円クラス〕 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〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー・日本円クラス〕 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

【ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー・日本円クラス】

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド〕の当作成期末現在のポートフォリオ特性値は、下図のようになりました。

| ポートフォリオ特性値 | | ・ポートフォリオ特性値（カバー率、平均行使価格等）は、ファンドの組入株式の各特性値を、その組入比率で加重平均したものです。 ・カバー率：純資産に対するオプションのポジション ・平均行使価格：原資産価格（株価）に対する平均権利行使価格 ・平均行使期間：権利行使日までの平均日数 ・配当利回り：組入銘柄の今期または前期の配当予想（課税前）を、加重平均して算出。 （東洋経済新報社データ等を基に野村アセットマネジメントが作成） ・プレミアム（年率）：純資産に対する年率調整後のプレミアム収入 ・プレミアム（年率）については、組入れたオプションの諸条件により、年率調整後のプレミアム収入が大きく変動する場合があります。 |
|------------|--------|--|
| 組入比率 | 94.8% | |
| カバー率 | 31.0% | |
| 平均行使価格 | 108.9% | |
| 平均行使期間 | 20.5日 | |
| 配当利回り（年率） | 2.9% | |
| プレミアム（年率） | 2.8% | |

主要投資対象である〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド〕のポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、輸送用機器12.7%、電気機器11.7%、銀行業11.6%となりました。

*業種は東証33業種分類によります。

また、高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」に則り、現物株の購入とともにコール・オプションの売却を行ない、プレミアム収入の確保を図りました。

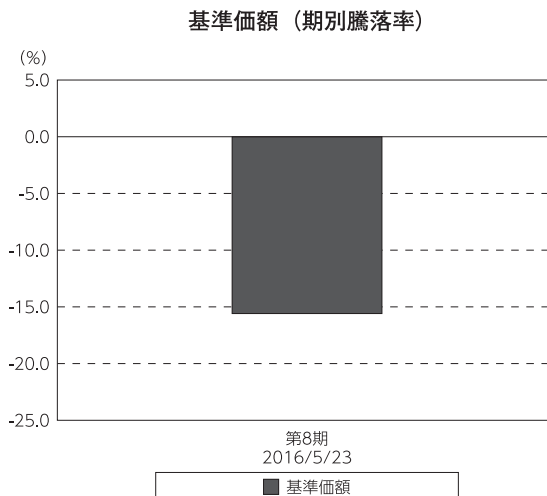
【野村マネー マザーファンド】

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

収益分配については、分配原資の範囲内で委託会社が決定するものとし、基準価額水準等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8期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2015年11月25日～ 2016年5月23日 |
| 当期分配金 | 10 |
| (対基準価額比率) | 0.070% |
| 当期の収益 | 10 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,042 |

(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

【野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型】

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円クラス〕 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〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円クラス〕 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

【ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー日本円クラス】

ファンドは、日本の高配当株へ投資することで、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。加えて、プレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用し、更なる収益の獲得に努めて参ります。

【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11月25日～2016年5月23日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 72 | % 0.470 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (21) | (0.134) | 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 ） | (49) | (0.320) | 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 | 72 | 0.472 | |
| 期中の平均基準価額は、15,390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11月25日～2016年5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 | ノムラ・マネージド・マスター・トラスト・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスド・ファンド-日本円クラス | 50,530 | 635,724 | 50,289 | 626,229 |
| | | | 千円 | | 千円 |

- * 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11月25日～2016年5月23日)

利害関係人との取引状況

<野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型>

| 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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 預金 | 百万円 1,961 | 百万円 1,961 | % 100.0 | 百万円 1,961 | 百万円 1,961 | % 100.0 |

<野村マネー マザーファンド>

| 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 13,549 | 百万円 2,394 | % 17.7 | 百万円 - | 百万円 - | % - |
| 預金 | 231,734 | 231,734 | 100.0 | 231,734 | 231,734 | 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證券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年5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 |
| ノムラ・マネージド・マスター・トラスト・ジャパン・ハイ・インカム・ ストック・エンハンスト・ファンド-日本円クラス | 470,574 | 470,815 | 5,546,671 | 99.2 |
| 合 計 | 470,574 | 470,815 | 5,546,671 | 99.2 |

*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 |
| 野村マネー マザーファンド | 千口 982 | 千口 982 | 千円 1,003 |

*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5月23日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 5,546,671 | % 97.8 |
| 野村マネー マザーファンド | 1,003 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 122,870 | 2.2 |
| 投資信託財産総額 | 5,670,544 | 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5月23日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 5,670,544,865 |
| コール・ローン等 | 109,869,599 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 5,546,671,515 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,003,143 |
| 未収入金 | 13,000,608 |
| (B) 負債 | 78,396,954 |
| 未払収益分配金 | 3,889,783 |
| 未払解約金 | 45,902,656 |
| 未払信託報酬 | 28,507,222 |
| 未払利息 | 166 |
| その他未払費用 | 97,127 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 5,592,147,911 |
| 元本 | 3,889,783,930 |
| 次期繰越損益金 | 1,702,363,981 |
| (D) 受益権総口数 | 3,889,783,930口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,377円 |

(注) 期首元本額は4,044,417,648円、期中追加設定元本額は503,254,914円、期中一部解約元本額は657,888,632円、1口当たり純資産額は14,377円です。

○損益の状況 (2015年11月25日～2016年5月23日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 166,650,849 |
| 受取配当金 | 166,634,926 |
| 受取利息 | 21,434 |
| 支払利息 | △ 5,511 |
| (B) 有価証券売買損益 | △1,103,295,344 |
| 売買益 | 107,039,282 |
| 売買損 | △1,210,334,626 |
| (C) 信託報酬等 | △ 28,604,349 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 965,248,844 |
| (E) 前期繰越損益金 | 943,052,389 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,728,450,219 |
| (配当等相当額) | (1,751,550,874) |
| (売買損益相当額) | (△ 23,100,655) |
| (G) 計(D+E+F) | 1,706,253,764 |
| (H) 収益分配金 | △ 3,889,783 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 1,702,363,981 |
| 追加信託差損益金 | 1,728,450,219 |
| (配当等相当額) | (1,751,550,923) |
| (売買損益相当額) | (△ 23,100,704) |
| 分配準備積立金 | 1,376,932,733 |
| 繰越損益金 | △1,403,018,971 |

*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11月25日～2016年5月23日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2015年11月25日～ 2016年5月23日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 138,048,541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 | 1,751,550,923円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 1,242,773,975円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 3,132,373,439円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 8,052円 |
| g. 分配金 | 3,889,783円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 10円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|-----|
| 1万口当たり分配金（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5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(20,706,716千口)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 | 2,058,780 | 2,066,351 | 9.8 | — | — | — | 9.8 |
| | (2,058,780) | (2,066,351) | (9.8) | (—) | (—) | (—) | (9.8) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 2,525,000 | 2,529,399 | 12.0 | — | — | — | 12.0 |
| | (2,525,000) | (2,529,399) | (12.0) | (—) | (—) | (—) | (12.0) |
| 金融債券 | 5,180,000 | 5,186,618 | 24.5 | — | — | — | 24.5 |
| | (5,180,000) | (5,186,618) | (24.5) | (—) | (—) | (—) | (24.5) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 2,300,000 | 2,304,215 | 10.9 | — | — | — | 10.9 |
| | (2,300,000) | (2,304,215) | (10.9) | (—) | (—) | (—) | (10.9) |
| 合 計 | 12,063,780 | 12,086,585 | 57.2 | — | — | — | 57.2 |
| | (12,063,780) | (12,086,585) | (57.2) | (—) | (—) | (—) | (57.2) |

* ()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 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 東京都 公募第634回 | 1.86 | 651,000 | 651,865 | 2016/6/20 |
| 東京都 公募第636回 | 2.04 | 101,500 | 101,654 | 2016/6/20 |
| 北海道 公募平成18年度第7回 | 2.0 | 1,500 | 1,512 | 2016/10/31 |
| 北海道 公募平成18年度第10回 | 1.9 | 200,000 | 202,289 | 2016/12/28 |
| 北海道 公募（5年）平成23年度第2回 | 0.53 | 7,200 | 7,201 | 2016/5/31 |
| 北海道 公募（5年）平成23年度第12回 | 0.38 | 5,000 | 5,011 | 2017/1/31 |
| 神奈川県 公募（5年）第49回 | 0.37 | 101,700 | 101,804 | 2016/9/20 |
| 大阪府 公募第292回 | 2.1 | 100,000 | 100,366 | 2016/7/28 |
| 大阪府 公募第294回 | 2.0 | 12,000 | 12,078 | 2016/9/28 |
| 大阪府 公募第295回 | 1.9 | 1,000 | 1,007 | 2016/10/28 |
| 大阪府 公募（5年）第73回 | 0.51 | 102,000 | 102,011 | 2016/5/30 |
| 大阪府 公募（5年）第77回 | 0.42 | 100,000 | 100,153 | 2016/10/28 |
| 京都府 公募平成23年度第1回 | 0.49 | 7,000 | 7,002 | 2016/6/22 |
| 兵庫県 公募平成18年度第7回 | 2.1 | 80,000 | 80,288 | 2016/7/27 |
| 福岡県 公募平成18年度第3回 | 1.9 | 1,000 | 1,007 | 2016/10/31 |
| 千葉県 公募平成18年度第4回 | 1.8 | 8,600 | 8,661 | 2016/10/25 |
| 新潟県 公募平成18年度第1回 | 2.1 | 6,500 | 6,522 | 2016/7/27 |
| 群馬県 公募第3回 | 1.9 | 9,000 | 9,080 | 2016/11/25 |
| 大分県 公募平成18年度第1回 | 1.8 | 193,000 | 194,505 | 2016/10/31 |
| 共同発行市場地方債 公募第38回 | 2.0 | 5,000 | 5,000 | 2016/5/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第39回 | 1.9 | 2,000 | 2,003 | 2016/6/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第40回 | 2.1 | 8,000 | 8,027 | 2016/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第41回 | 2.0 | 6,000 | 6,029 | 2016/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第43回 | 1.8 | 4,000 | 4,028 | 2016/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第44回 | 1.8 | 100,000 | 100,897 | 2016/11/25 |
| 島根県 公募平成23年度第1回 | 0.38 | 2,500 | 2,504 | 2016/11/25 |
| 熊本県 公募平成18年度第2回 | 1.8 | 7,500 | 7,554 | 2016/10/27 |
| 名古屋市 公募第455回 | 1.9 | 1,000 | 1,001 | 2016/6/20 |
| 名古屋市 公募第456回 | 1.82 | 16,000 | 16,089 | 2016/9/20 |
| 京都市 公募平成23年度第1回 | 0.493 | 90,000 | 90,074 | 2016/7/29 |
| 京都市 公募平成23年度第3回 | 0.364 | 4,000 | 4,003 | 2016/9/29 |
| 札幌市 公募（5年）平成23年度第5回 | 0.4 | 12,900 | 12,912 | 2016/9/20 |
| 川崎市 公募第28回 | 0.46 | 4,570 | 4,571 | 2016/6/20 |
| 川崎市 公募（5年）第29回 | 0.36 | 12,200 | 12,210 | 2016/9/20 |
| 川崎市 公募（5年）第31回 | 0.27 | 2,000 | 2,003 | 2017/3/17 |
| 北九州市 公募（5年）平成23年度第1回 | 0.36 | 7,000 | 7,006 | 2016/9/28 |
| 広島市 公募平成18年度第1回 | 1.82 | 6,000 | 6,062 | 2016/12/26 |
| 仙台市 公募平成23年度第1回 | 0.36 | 59,410 | 59,523 | 2017/1/27 |
| さいたま市 公募第4回 | 1.8 | 5,000 | 5,051 | 2016/12/26 |
| 鹿児島県 公募平成18年度第1回 | 1.9 | 7,200 | 7,257 | 2016/10/31 |
| 鹿児島県 公募（5年）平成23年度第1回 | 0.37 | 8,500 | 8,511 | 2016/10/31 |
| 小 計 | | 2,058,780 | 2,066,351 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第12回 | 2.0 | 300,000 | 300,148 | 2016/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第16回 | 2.0 | 100,000 | 100,355 | 2016/7/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第21回 | 1.8 | 125,000 | 126,186 | 2016/11/30 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回 | 0.243 | 200,000 | 200,040 | 2016/6/20 |

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | 償 還 年 月 日 |
|-------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 日本政策投資銀行債券 財投機関債第27回 | 1.98 | 100,000 | 100,628 | 2016/9/20 |
| 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 | 100,146 | 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91回 | 0.16 | 300,000 | 300,042 | 2016/6/20 |
| 地方公共団体金融機構債券(5年) 第9回 | 0.34 | 100,000 | 100,339 | 2017/4/28 |
| 首都高速道路 第8回 | 0.439 | 140,000 | 140,163 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 第20回財投機関債 | 0.471 | 300,000 | 300,487 | 2016/9/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第75回 | 0.213 | 160,000 | 160,025 | 2016/6/20 |
| 関西国際空港社債 財投機関債第31回 | 0.504 | 70,000 | 70,097 | 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10回 | 1.99 | 100,000 | 100,649 | 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 | 430,000 | 430,089 | 2016/6/20 |
| 小 計 | | 2,525,000 | 2,529,399 | |
| 金融債券 | | | | |
| 商工債券 利付第732回い号 | 0.6 | 100,000 | 100,008 | 2016/5/27 |
| 商工債券 利付第733回い号 | 0.55 | 300,000 | 300,142 | 2016/6/27 |
| 商工債券 利付第734回い号 | 0.55 | 170,000 | 170,146 | 2016/7/27 |
| 商工債券 利付第736回い号 | 0.45 | 300,000 | 300,394 | 2016/9/27 |
| 商工債券 利付第737回い号 | 0.45 | 100,000 | 100,159 | 2016/10/27 |
| 商工債券 利付第738回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,447 | 2016/11/25 |
| 農林債券 利付第732回い号 | 0.6 | 100,000 | 100,008 | 2016/5/27 |
| 農林債券 利付第733回い号 | 0.55 | 380,000 | 380,190 | 2016/6/27 |
| 農林債券 利付第734回い号 | 0.6 | 50,000 | 50,048 | 2016/7/27 |
| 農林債券 利付第735回い号 | 0.45 | 150,000 | 150,147 | 2016/8/26 |
| 農林債券 利付第736回い号 | 0.5 | 650,000 | 651,042 | 2016/9/27 |
| 農林債券 利付第737回い号 | 0.5 | 80,000 | 80,143 | 2016/10/27 |
| 農林債券 利付第739回い号 | 0.5 | 300,000 | 300,881 | 2016/12/27 |
| 農林債券 利付第742回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,751 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第258回 | 0.55 | 300,000 | 300,022 | 2016/5/27 |
| しんきん中金債券 利付第259回 | 0.55 | 400,000 | 400,200 | 2016/6/27 |
| しんきん中金債券 利付第261回 | 0.45 | 300,000 | 300,349 | 2016/8/26 |
| しんきん中金債券 利付第262回 | 0.45 | 100,000 | 100,148 | 2016/9/27 |
| しんきん中金債券 利付第263回 | 0.5 | 100,000 | 100,206 | 2016/10/27 |
| しんきん中金債券 利付第266回 | 0.45 | 300,000 | 300,943 | 2017/1/27 |
| 商工債券 利付(3年)第160回 | 0.25 | 100,000 | 100,010 | 2016/5/27 |
| 商工債券 利付(3年)第161回 | 0.25 | 200,000 | 200,036 | 2016/6/27 |
| 商工債券 利付(3年)第164回 | 0.2 | 200,000 | 200,088 | 2016/9/27 |
| 商工債券 利付(3年)第166回 | 0.2 | 100,000 | 100,099 | 2016/11/25 |
| 小 計 | | 5,180,000 | 5,186,618 | |
| 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26回特定社債間限定同順位特約付 | 0.54 | 600,000 | 600,473 | 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 | 400,000 | 400,807 | 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 | 100,072 | 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 | 100,179 | 2016/10/20 |
| 三菱東京UFJ銀行 第145回特定社債間限定同順位特約付 | 0.22 | 100,000 | 100,033 | 2016/7/22 |
| 三井住友銀行 第54回社債間限定同順位特約付 | 0.49 | 200,000 | 200,151 | 2016/7/20 |
| 三井住友銀行 第55回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 100,000 | 100,195 | 2016/10/20 |
| トヨタファイナンス 第23回社債間限定同等特約付 | 1.97 | 100,000 | 100,622 | 2016/9/20 |
| 三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.66 | 400,000 | 401,255 | 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 | 100,275 | 2016/7/29 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------|---|-------|------------|------------|-----------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 東邦瓦斯 第30回社債間限定同順位特約付 | | 2.07 | 100,000 | 100,150 | 2016/6/20 |
| 小 計 | | | 2,300,000 | 2,304,215 | |
| 合 計 | | | 12,063,780 | 12,086,585 | |

*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 1,399,866 | % 6.6 |

*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。

ノムラ・マネージド・マスター・トラスト
ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド
(日本円クラス、通貨セレクトクラス)

2015年3月31日決算

(計算期間:2014年4月1日～2015年3月31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 | 日本の高配当株を主要投資対象とし、高水準の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指して運用を行うことを基本とします。 |
| 投 資 対 象 | 日本の高配当株を主要投資対象とします。 |
| 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 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 副 投 資 顧 問 会 社 | ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド |
| 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 |

* 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3月31日に終了する計測期間
(円)

収益

| | |
|--------|----------------------|
| 銀行口座利息 | 172,652 |
| 受取配当金等 | 5,223,672,090 |
| 買戻し手数料 | 327,402,973 |
| 収益合計 | <u>5,551,247,715</u> |

費用

| | |
|----------|----------------------|
| 投資顧問報酬 | 1,292,072,156 |
| 事務管理代行報酬 | 284,365,183 |
| 保管費用 | 85,421,343 |
| 取引銀行報酬 | 30,973,696 |
| 受託報酬 | 56,900,186 |
| 法務報酬 | 875,199 |
| 海外登記手数料 | 60,214 |
| 立替費用 | 4,163,860 |
| 専門家報酬 | 2,757,672 |
| 創業費償却 | 864,128 |
| 雑費用 | 14,134 |
| 費用合計 | <u>1,758,467,771</u> |

純投資損益

3,792,779,944

| | |
|-----------------------|-----------------------|
| 投資有価証券売買に係る損益 | 38,640,821,980 |
| オプション取引契約に係る損益 | (7,451,450,420) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | <u>23,052,002,898</u> |

当期実現純損益

54,241,374,458

| | |
|-------------------|-------------------------|
| 投資有価証券評価差損益 | 23,445,020,463 |
| オプション取引契約に係る評価差損益 | 26,128,824 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損益 | <u>(10,216,654,895)</u> |

当期評価差損益

13,254,494,392

為替差額

4,490,963,167

運用の結果による純資産の増減額

75,779,611,961

組入資産の明細

2015年3月31日現在
(円)

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|------------|-------------------------------------|----------------|----------|
| | 日本 | | |
| 普通株 | | | |
| 1,540,000 | TOYOTA MOTOR CORP | 12,909,820,000 | 4.93 |
| 1,530,000 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | 6,943,905,000 | 2.64 |
| 8,600,000 | mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP | 6,395,820,000 | 2.44 |
| 2,017,200 | KDDI CORP | 5,487,792,600 | 2.09 |
| 740,200 | NIPPON TELG & TEL CORP NTT | 5,475,259,400 | 2.09 |
| 3,009,900 | SEKISUI HOUSE LTD | 5,253,780,450 | 2.00 |
| 2,140,000 | mitsubishi CORP | 5,179,870,000 | 1.97 |
| 24,500,000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC | 5,171,950,000 | 1.97 |
| 855,400 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | 5,131,544,600 | 1.95 |
| 4,160,000 | NISSAN MOTOR CO LTD | 5,091,840,000 | 1.94 |
| 2,050,000 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | 4,860,550,000 | 1.85 |
| 1,260,000 | JAPAN TOBACCO INC | 4,788,630,000 | 1.82 |
| 2,400,000 | ASTELLAS PHARMA INC | 4,722,000,000 | 1.80 |
| 2,980,000 | PANASONIC CORP | 4,699,460,000 | 1.79 |
| 15,400,000 | NIPPON STEEL & SUMITOMO METAL CORP | 4,658,500,000 | 1.77 |
| 2,730,000 | ORIX CORP | 4,609,605,000 | 1.76 |
| 1,000,000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | 4,601,500,000 | 1.75 |
| 1,810,000 | KOMATSU LTD | 4,276,125,000 | 1.63 |
| 993,500 | CANON INC | 4,220,388,000 | 1.61 |
| 1,080,000 | HONDA MOTOR CO LTD | 4,215,240,000 | 1.61 |
| 1,858,800 | NTT DOCOMO | 3,876,527,400 | 1.48 |
| 273,000 | DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD | 3,665,025,000 | 1.40 |
| 959,500 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | 3,631,707,500 | 1.38 |
| 2,250,000 | MITSUI & CO LTD | 3,627,000,000 | 1.38 |
| 4,384,000 | HITACHI LTD | 3,608,908,800 | 1.37 |
| 7,200,000 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 3,567,600,000 | 1.36 |
| 1,998,000 | NSK LIMITED | 3,512,484,000 | 1.34 |
| 210,000 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | 3,472,350,000 | 1.32 |
| 1,807,000 | KUBOTA CORP | 3,438,721,000 | 1.31 |
| 2,400,000 | SUMITOMO CORP | 3,085,200,000 | 1.18 |
| 630,000 | BRIDGESTONE CORP | 3,034,080,000 | 1.16 |
| 6,400,000 | JX HOLDINGS INC | 2,958,080,000 | 1.13 |
| 350,000 | SECOM CO LTD | 2,808,750,000 | 1.07 |
| 546,600 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | 2,761,969,800 | 1.05 |
| 2,030,000 | RICOH CO LTD | 2,655,240,000 | 1.01 |
| 4,172,000 | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD | 2,578,296,000 | 0.98 |
| 3,653,500 | MARUBENI CORP | 2,542,836,000 | 0.97 |
| 5,000,000 | TOSHIBA CORP | 2,521,000,000 | 0.96 |
| 3,800,000 | mitsubishi HEAVY IND LTD | 2,516,740,000 | 0.96 |
| 666,200 | OTSUKA HOLDINGS CO LTD | 2,504,578,900 | 0.95 |
| 1,880,300 | ITOCHU CORP | 2,447,210,450 | 0.93 |

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|-------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| 1,163,200 | JSR CORPORATION | 2,422,945,600 | 0.92 |
| 601,800 | FUJI HEAVY INDUSTRIES LTD | 2,401,783,800 | 0.91 |
| 1,490,700 | ISUZU MOTORS LTD | 2,381,393,250 | 0.91 |
| 430,000 | DENSO CORP | 2,357,690,000 | 0.90 |
| 4,780,000 | OJI HOLDINGS CORPORATION | 2,351,760,000 | 0.90 |
| 690,000 | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS | 2,325,300,000 | 0.89 |
| 1,349,000 | HINO MOTORS LTD | 2,313,535,000 | 0.88 |
| 2,400,000 | DAIWA SECURITIES GROUP INC | 2,270,400,000 | 0.86 |
| 350,000 | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY | 2,206,050,000 | 0.84 |
| 450,000 | HOYA CORP | 2,167,875,000 | 0.83 |
| 803,800 | JFE HOLDINGS INC | 2,133,285,200 | 0.81 |
| 1,150,500 | DAIHATSU MOTOR CO LTD | 2,114,619,000 | 0.81 |
| 1,180,000 | KURARAY CO LTD | 1,919,860,000 | 0.73 |
| 1,700,000 | TONENGENERAL SEKIYU K.K | 1,762,900,000 | 0.67 |
| 1,100,000 | SUMITOMO ELECTRIC IND LTD | 1,732,500,000 | 0.66 |
| 460,000 | SOMPO JAPAN NIPPONKOA HOLDINGS | 1,718,100,000 | 0.65 |
| 888,300 | SONY FINANCIAL HOLDING INC | 1,716,195,600 | 0.65 |
| 1,532,400 | SHOWA SHELL SEKIYU KK | 1,682,575,200 | 0.64 |
| 1,060,000 | CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD | 1,659,960,000 | 0.63 |
| 2,992,000 | OSAKA GAS CO LTD | 1,504,078,400 | 0.57 |
| 170,000 | NITTO DENKO CORP | 1,365,100,000 | 0.52 |
| 935,000 | MITSUBISHI ELECTRIC CORP | 1,335,647,500 | 0.51 |
| 439,400 | LIXIL GROUP CORPORATION | 1,250,971,800 | 0.48 |
| 300,000 | ELECTRIC POWER DEVELOPMENT CO | 1,215,000,000 | 0.46 |
| 3,500,000 | NIPPON YUSEN KK | 1,211,000,000 | 0.46 |
| 766,100 | KIRIN HOLDINGS CO LTD | 1,208,139,700 | 0.46 |
| 276,200 | AISIN SEIKI CO LTD | 1,204,232,000 | 0.46 |
| 200,000 | KAO CORP | 1,200,000,000 | 0.46 |
| 1,290,000 | TOPPAN PRINTING CO LTD | 1,194,540,000 | 0.46 |
| 2,800,000 | AOZORA BANK LTD | 1,192,800,000 | 0.45 |
| 1,034,000 | ASAHI KASEI CORPORATION | 1,188,066,000 | 0.45 |
| 690,000 | FUJI MEDIA HOLDINGS INC | 1,175,760,000 | 0.45 |
| 1,962,400 | RESONA HOLDINGS INC | 1,170,767,840 | 0.45 |
| 1,650,000 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 1,152,690,000 | 0.44 |
| 1,840,000 | FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC | 1,138,960,000 | 0.43 |
| 304,000 | JAPAN AIRLINES | 1,136,960,000 | 0.43 |
| 136,300 | LAWSON INC | 1,135,379,000 | 0.43 |
| 1,560,000 | BANK OF YOKOHAMA LTD | 1,098,240,000 | 0.42 |
| 112,000 | EAST JAPAN RAILWAY CO | 1,079,680,000 | 0.41 |
| 1,594,000 | NIPPON EXPRESS | 1,071,168,000 | 0.41 |
| 970,000 | DOWA HOLDINGS CO LTD | 997,160,000 | 0.38 |
| 360,000 | ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP | 898,200,000 | 0.34 |
| 300,000 | MARUICHI STEEL TUBE LTD | 853,800,000 | 0.33 |
| | | <u>241,124,952,790</u> | <u>91.85</u> |
| | 日本計 | <u>241,124,952,790</u> | <u>91.85</u> |
| 投資合計 | | <u>241,124,952,790</u> | <u>91.85</u> |

外国為替先渡し契約

2015年3月31日現在

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|---------------|--------|----------------|----------------|----------------------|
| USD | 425,376,437 | JPY | 49,887,000,000 | April 24, 2015 | 1,229,462,865 |
| INR | 4,500,000,000 | USD | 72,005,760 | April 24, 2015 | (55,955,941) |
| ZAR | 450,000,000 | USD | 39,348,907 | April 24, 2015 | (313,549,475) |
| TRY | 150,000,000 | USD | 60,520,476 | April 24, 2015 | (417,371,211) |
| USD | 419,956,057 | JPY | 49,887,000,000 | April 24, 2015 | 577,878,514 |
| INR | 4,500,000,000 | USD | 71,621,837 | April 24, 2015 | (9,804,429) |
| TRY | 150,000,000 | USD | 59,150,597 | April 24, 2015 | (252,697,964) |
| ZAR | 450,000,000 | USD | 38,489,501 | April 24, 2015 | (210,240,217) |
| INR | 4,524,000,000 | USD | 72,101,363 | April 24, 2015 | (21,582,352) |
| USD | 421,525,187 | JPY | 49,887,000,000 | April 24, 2015 | 766,503,696 |
| ZAR | 448,000,000 | USD | 38,357,806 | April 24, 2015 | (214,038,479) |
| TRY | 144,000,000 | USD | 57,164,407 | April 24, 2015 | (288,249,891) |
| MXN | 3,026,000,000 | USD | 202,098,458 | April 24, 2015 | (568,649,912) |
| USD | 33,620,791 | JPY | 4,000,000,000 | April 24, 2015 | 40,108,894 |
| USD | 10,098,715 | JPY | 1,200,000,000 | April 24, 2015 | 13,532,602 |
| INR | 392,000,000 | USD | 6,290,116 | April 24, 2015 | (6,991,733) |
| MXN | 763,000,000 | USD | 50,764,393 | April 24, 2015 | (120,022,484) |
| USD | 14,182,800 | JPY | 1,700,000,000 | April 24, 2015 | 4,299,607 |
| TRY | 43,000,000 | USD | 16,205,733 | April 24, 2015 | 17,810,253 |
| JPY | 6,700,000,000 | USD | 55,191,957 | April 24, 2015 | 67,797,708 |
| USD | 15,503,799 | MXN | 235,000,000 | April 24, 2015 | 21,174,565 |
| BRL | 1,006,400,000 | USD | 319,264,018 | May 05, 2015 | (1,287,778,673) |
| USD | 253,840,163 | JPY | 30,638,000,000 | May 22, 2015 | (145,009,011) |
| INR | 8,100,000,000 | USD | 127,426,612 | May 22, 2015 | 63,948,940 |
| TRY | 220,000,000 | USD | 82,750,008 | May 22, 2015 | 40,046,035 |
| ZAR | 790,000,000 | USD | 64,812,536 | May 22, 2015 | (72,726,724) |
| INR | 8,100,000,000 | USD | 127,318,453 | May 22, 2015 | 76,950,670 |
| USD | 252,031,437 | JPY | 30,638,000,000 | May 22, 2015 | (362,436,156) |
| ZAR | 790,000,000 | USD | 63,991,965 | May 22, 2015 | 25,914,236 |
| TRY | 220,000,000 | USD | 82,325,778 | May 22, 2015 | 91,042,811 |
| MXN | 3,401,000,000 | USD | 217,764,346 | May 22, 2015 | 435,156,996 |
| INR | 8,084,000,000 | USD | 126,953,217 | May 22, 2015 | 90,471,733 |
| USD | 252,764,795 | JPY | 30,638,000,000 | May 22, 2015 | (274,279,057) |
| ZAR | 801,000,000 | USD | 64,406,930 | May 22, 2015 | 83,502,567 |
| TRY | 205,500,000 | USD | 77,171,505 | May 22, 2015 | 52,375,905 |
| ZAR | 181,000,000 | USD | 14,716,045 | May 22, 2015 | (625,590) |
| USD | 19,868,702 | INR | 1,256,000,000 | May 22, 2015 | 3,272,384 |
| | | | | | (920,758,318) |

オプション取引契約

2015年3月31日現在

| 通貨 | 契約数 | 銘柄 | 満期 | 費用(円) | 評価額(円) | 未実現損益(円) |
|----------------|-------------|-----------------------------------|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 売建ポジション | | | | | | |
| JPY | (650,000) | C 8601 JT 1018.961 01/04/15 OTC | April 01, 2015 | (3,156,855) | 0 | 3,156,855 |
| JPY | (40,000) | C 1878 JT 14209.3 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (2,252,040) | (2,829,118) | (577,078) |
| JPY | (40,000) | C 1878 JT 14368.9412 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (3,284,328) | (1,812,838) | 1,471,490 |
| JPY | (240,000) | C 1925 JT 2421.0538 09/04/15 OTC | April 09, 2015 | (5,363,568) | (4,734,557) | 629,011 |
| JPY | (280,000) | C 1925 JT 2472.704 24/04/15 OTC | April 24, 2015 | (6,524,140) | (7,445,382) | (921,242) |
| JPY | (500,000) | C 1928 JT 1855.6595 23/04/15 OTC | April 23, 2015 | (4,376,550) | (2,818,310) | 1,558,240 |
| JPY | (500,000) | C 1928 JT 1879.904 08/05/15 OTC | May 08, 2015 | (3,689,550) | (4,137,595) | (448,045) |
| JPY | (190,000) | C 2503 JT 1666.4843 10/04/15 OTC | April 10, 2015 | (1,941,610) | (277,717) | 1,663,893 |
| JPY | (330,000) | C 2914 JT 4038.9133 23/04/15 OTC | April 23, 2015 | (7,473,873) | (6,820,318) | 653,555 |
| JPY | (130,000) | C 3382 JT 4881.3 13/04/15 OTC | April 13, 2015 | (5,088,525) | (26,593,596) | (21,505,071) |
| JPY | (280,000) | C 3405 JT 1703.0934 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (2,952,040) | (4,013,414) | (1,061,374) |
| JPY | (250,000) | C 3407 JT 1287.825 14/04/15 OTC | April 14, 2015 | (1,809,100) | (88,488) | 1,720,612 |
| JPY | (600,000) | C 3861 JT 523.95 09/04/15 OTC | April 09, 2015 | (2,514,960) | (309,192) | 2,205,768 |
| JPY | (1,200,000) | C 4005 JT 599.4109 08/04/15 OTC | April 08, 2015 | (5,328,120) | (27,697,692) | (22,369,572) |
| JPY | (120,000) | C 4185 JT 2195.26 17/04/15 OTC | April 17, 2015 | (1,565,676) | (2,504,542) | (938,866) |
| JPY | (120,000) | C 4185 JT 2264.2766 15/04/15 OTC | April 15, 2015 | (2,435,160) | (892,360) | 1,542,800 |
| JPY | (410,000) | C 4188 JT 786.6506 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (3,194,843) | (171,925) | 3,022,918 |
| JPY | (180,000) | C 4502 JT 6474.57 30/04/15 OTC | April 30, 2015 | (3,485,376) | (2,634,208) | 851,168 |
| JPY | (640,000) | C 4503 JT 2050.568 01/04/15 OTC | April 01, 2015 | (6,940,416) | (1,990) | 6,938,426 |
| JPY | (600,000) | C 4503 JT 2081.9233 07/05/15 OTC | May 07, 2015 | (11,063,940) | (12,246,882) | (1,182,942) |
| JPY | (150,000) | C 4519 JT 4267.35 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (3,523,500) | (844,139) | 2,679,361 |
| JPY | (150,000) | C 4519 JT 4301 20/04/15 OTC | April 20, 2015 | (2,873,850) | (583,478) | 2,290,372 |
| JPY | (150,000) | C 4578 JT 3799.95 10/04/15 OTC | April 10, 2015 | (3,962,805) | (6,135,443) | (2,172,638) |
| JPY | (1,600,000) | C 5020 JT 501.9243 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (4,971,520) | (2,130,224) | 2,841,296 |
| JPY | (170,000) | C 5108 JT 4921.2025 07/04/15 OTC | April 07, 2015 | (4,925,801) | (4,209,360) | 716,441 |
| JPY | (3,700,000) | C 5401 JT 339.6394 17/04/15 OTC | April 17, 2015 | (6,459,460) | (308,950) | 6,150,510 |
| JPY | (3,700,000) | C 5401 JT 342.1086 28/04/15 OTC | April 28, 2015 | (5,625,850) | (1,096,162) | 4,529,688 |
| JPY | (200,000) | C 5411 JT 2935.866 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (3,512,060) | (1,521,310) | 1,990,750 |
| JPY | (190,000) | C 5411 JT 3059.69 13/04/15 OTC | April 13, 2015 | (6,032,785) | (82,821) | 5,949,964 |
| JPY | (280,000) | C 5802 JT 1687.455 24/04/15 OTC | April 24, 2015 | (3,284,904) | (1,760,702) | 1,524,202 |
| JPY | (110,000) | C 5938 JT 2879.0512 14/04/15 OTC | April 14, 2015 | (2,420,033) | (5,089,086) | (2,669,053) |
| JPY | (470,000) | C 6301 JT 2646.82 08/04/15 OTC | April 08, 2015 | (8,449,848) | (11,360) | 8,438,488 |
| JPY | (450,000) | C 6301 JT 2651.139 23/04/15 OTC | April 23, 2015 | (5,574,825) | (785,367) | 4,789,458 |
| JPY | (430,000) | C 6326 JT 2054.7 07/04/15 OTC | April 07, 2015 | (7,444,504) | (376,487) | 7,068,017 |
| JPY | (430,000) | C 6326 JT 2129.544 16/04/15 OTC | April 16, 2015 | (7,122,133) | (737,300) | 6,384,833 |
| JPY | (380,000) | C 6471 JT 1810.08 20/04/15 OTC | April 20, 2015 | (6,177,736) | (10,430,251) | (4,252,515) |
| JPY | (380,000) | C 6471 JT 1909.5313 28/04/15 OTC | April 28, 2015 | (4,419,704) | (4,445,320) | (25,616) |
| JPY | (1,000,000) | C 6501 JT 868.428 09/04/15 OTC | April 09, 2015 | (4,181,300) | (1,254,590) | 2,926,710 |
| JPY | (1,000,000) | C 6501 JT 922.57 27/04/15 OTC | April 27, 2015 | (3,438,700) | (1,141,930) | 2,296,770 |
| JPY | (1,200,000) | C 6502 JT 519.8064 10/04/15 OTC | April 10, 2015 | (3,031,440) | (3,189,144) | (157,704) |
| JPY | (730,000) | C 6752 JT 1660.4892 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (9,315,676) | (9,737,426) | (421,750) |
| JPY | (110,000) | C 6902 JT 6027.1323 15/04/15 OTC | April 15, 2015 | (3,189,835) | (243,101) | 2,946,734 |
| JPY | (110,000) | C 6902 JT 6199.4016 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (1,975,699) | (198,320) | 1,777,379 |

| 通貨 | 契約数 | 銘柄 | 満期 | 費用(円) | 評価額(円) | 未実現損益(円) |
|-----|-------------|----------------------------------|----------------|--------------|--------------|--------------|
| JPY | (53,000) | C 6981 JT 16652.196 13/04/15 OTC | April 13, 2015 | (8,825,666) | (14,353,696) | (5,528,030) |
| JPY | (950,000) | C 7011 JT 729.216 27/04/15 OTC | April 27, 2015 | (2,501,635) | (1,633,316) | 868,319 |
| JPY | (1,000,000) | C 7201 JT 1314.5212 07/04/15 OTC | April 07, 2015 | (6,572,600) | (202,450) | 6,370,150 |
| JPY | (1,000,000) | C 7201 JT 1314.952 17/04/15 OTC | April 17, 2015 | (7,691,200) | (2,234,090) | 5,457,110 |
| JPY | (360,000) | C 7202 JT 1752.72 07/05/15 OTC | May 07, 2015 | (3,415,392) | (3,158,719) | 256,673 |
| JPY | (180,000) | C 7203 JT 8499.75 16/04/15 OTC | April 16, 2015 | (8,014,050) | (19,120,275) | (11,106,225) |
| JPY | (180,000) | C 7203 JT 8516.6025 08/04/15 OTC | April 08, 2015 | (10,219,932) | (10,412,507) | (192,575) |
| JPY | (160,000) | C 7203 JT 8982.9817 28/04/15 OTC | April 28, 2015 | (4,701,376) | (4,705,349) | (3,973) |
| JPY | (300,000) | C 7205 JT 1967.5139 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (6,068,040) | (408,624) | 5,659,416 |
| JPY | (300,000) | C 7205 JT 1995.2397 14/04/15 OTC | April 14, 2015 | (6,992,670) | (62,754) | 6,929,916 |
| JPY | (68,000) | C 7259 JT 4679.9 13/04/15 OTC | April 13, 2015 | (1,140,836) | (365,198) | 775,638 |
| JPY | (200,000) | C 7262 JT 1855.35 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (2,191,080) | (6,294,034) | (4,102,954) |
| JPY | (260,000) | C 7267 JT 4250.9675 23/04/15 OTC | April 23, 2015 | (2,892,240) | (1,884,709) | 1,007,531 |
| JPY | (270,000) | C 7267 JT 4381.2006 20/04/15 OTC | April 20, 2015 | (5,969,889) | (421,278) | 5,548,611 |
| JPY | (150,000) | C 7270 JT 4326.92 01/04/15 OTC | April 01, 2015 | (3,000,270) | (2) | 3,000,268 |
| JPY | (150,000) | C 7270 JT 4509.112 24/04/15 OTC | April 24, 2015 | (2,916,450) | (1,649,384) | 1,267,066 |
| JPY | (160,000) | C 7741 JT 5082.7 09/04/15 OTC | April 09, 2015 | (7,748,720) | (1,385,085) | 6,363,635 |
| JPY | (230,000) | C 7751 JT 4205.25 15/04/15 OTC | April 15, 2015 | (4,974,210) | (21,558,429) | (16,584,219) |
| JPY | (500,000) | C 7752 JT 1276.0965 16/04/15 OTC | April 16, 2015 | (3,706,750) | (23,171,550) | (19,464,800) |
| JPY | (460,000) | C 8001 JT 1381.3603 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (3,328,422) | (2,303,220) | 1,025,202 |
| JPY | (380,000) | C 8001 JT 1408.575 28/04/15 OTC | April 28, 2015 | (2,192,030) | (1,453,420) | 738,610 |
| JPY | (860,000) | C 8002 JT 747.3 27/04/15 OTC | April 27, 2015 | (2,485,830) | (1,879,306) | 606,524 |
| JPY | (870,000) | C 8002 JT 750.7656 14/04/15 OTC | April 14, 2015 | (4,396,284) | (362,677) | 4,033,607 |
| JPY | (550,000) | C 8031 JT 1708.4288 23/04/15 OTC | April 23, 2015 | (5,059,560) | (3,748,822) | 1,310,738 |
| JPY | (540,000) | C 8058 JT 2559.5115 21/04/15 OTC | April 21, 2015 | (10,925,442) | (6,370,537) | 4,554,905 |
| JPY | (540,000) | C 8058 JT 2593.017 30/04/15 OTC | April 30, 2015 | (9,468,198) | (6,871,187) | 2,597,011 |
| JPY | (700,000) | C 8304 JT 476.5199 17/04/15 OTC | April 17, 2015 | (2,064,930) | (16,135) | 2,048,795 |
| JPY | (1,900,000) | C 8306 JT 798.2853 07/04/15 OTC | April 07, 2015 | (15,167,510) | (747,384) | 14,420,126 |
| JPY | (490,000) | C 8308 JT 649.0361 11/05/15 OTC | May 11, 2015 | (3,061,373) | (2,139,840) | 921,533 |
| JPY | (480,000) | C 8308 JT 665.385 24/04/15 OTC | April 24, 2015 | (2,250,912) | (449,630) | 1,801,282 |
| JPY | (1,900,000) | C 8309 JT 520.4937 10/04/15 OTC | April 10, 2015 | (6,903,840) | (2,877,284) | 4,026,556 |
| JPY | (260,000) | C 8316 JT 4910.85 01/04/15 OTC | April 01, 2015 | (9,606,558) | (5) | 9,606,553 |
| JPY | (260,000) | C 8316 JT 5014.193 15/04/15 OTC | April 15, 2015 | (10,946,078) | (1,558,463) | 9,387,615 |
| JPY | (370,000) | C 8332 JT 768.915 13/04/15 OTC | April 13, 2015 | (2,980,461) | (325,533) | 2,654,928 |
| JPY | (460,000) | C 8354 JT 702.3898 20/04/15 OTC | April 20, 2015 | (3,692,558) | (447,281) | 3,245,277 |
| JPY | (6,000,000) | C 8411 JT 236.4117 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (5,352,600) | (499,080) | 4,853,520 |
| JPY | (120,000) | C 8630 JT 4215.9605 23/04/15 OTC | April 23, 2015 | (5,484,684) | (560,540) | 4,924,144 |
| JPY | (180,000) | C 8725 JT 3701.558 27/04/15 OTC | April 27, 2015 | (4,234,302) | (2,411,323) | 1,822,979 |
| JPY | (180,000) | C 8729 JT 2095.5168 16/04/15 OTC | April 16, 2015 | (3,336,714) | (291,308) | 3,045,406 |
| JPY | (360,000) | C 8766 JT 4564.3973 15/04/15 OTC | April 15, 2015 | (14,106,564) | (30,331,498) | (16,224,934) |
| JPY | (90,000) | C 9021 JT 7112.6015 08/04/15 OTC | April 08, 2015 | (5,425,902) | (492) | 5,425,410 |
| JPY | (88,000) | C 9021 JT 7254.66 17/04/15 OTC | April 17, 2015 | (4,864,076) | (17,091) | 4,846,985 |
| JPY | (75,000) | C 9201 JT 3906.735 14/04/15 OTC | April 14, 2015 | (2,957,955) | (1,687,021) | 1,270,934 |
| JPY | (180,000) | C 9432 JT 7869.0399 20/04/15 OTC | April 20, 2015 | (11,061,630) | (5,053,552) | 6,008,078 |
| JPY | (140,000) | C 9432 JT 8033.56 30/04/15 OTC | April 30, 2015 | (5,465,824) | (4,006,293) | 1,459,531 |
| JPY | (510,000) | C 9433 JT 2892.008 13/04/15 OTC | April 13, 2015 | (10,113,759) | (3,322,614) | 6,791,145 |

ノムラ・マネージド・マスター・トラスト・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド

| 通貨 | 契約数 | 銘柄 | 満期 | 費用(円) | 評価額(円) | 未実現損益(円) | |
|-----|-----------|---------------------|--------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------------------|
| JPY | (390,000) | C 9433 JT 2896.45 | 27/04/15 OTC | April 27, 2015 | (8,738,535) | (7,389,334) | 1,349,201 |
| JPY | (450,000) | C 9437 JT 2223.9 | 17/04/15 OTC | April 17, 2015 | (2,001,510) | (1,411,020) | 590,490 |
| JPY | (450,000) | C 9437 JT 2288.4056 | 22/04/15 OTC | April 22, 2015 | (5,148,900) | (733,865) | 4,415,035 |
| JPY | (670,000) | C 9532 JT 522.392 | 10/04/15 OTC | April 10, 2015 | (1,346,164) | (830,056) | 516,108 |
| JPY | (700,000) | C 9532 JT 528.944 | 20/04/15 OTC | April 20, 2015 | (1,958,110) | (1,287,377) | 670,733 |
| JPY | (80,000) | C 9735 JT 8075.6416 | 16/04/15 OTC | April 16, 2015 | (4,037,824) | (10,143,465) | (6,105,641) |
| | | | | | <u>(486,062,683)</u> | <u>(378,890,497)</u> | <u>107,172,186</u> |
| | | | | | <u>(486,062,683)</u> | <u>(378,890,497)</u> | <u>107,172,186</u> |

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

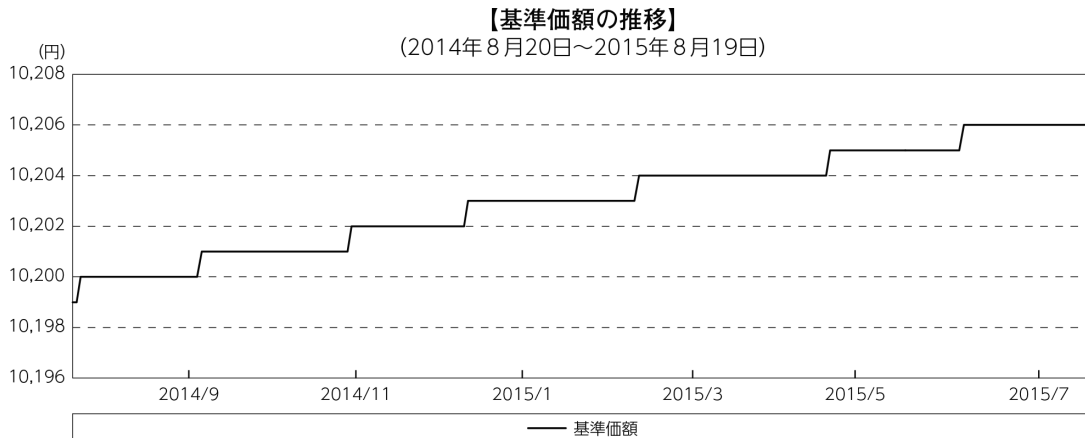
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券率 | 債先物比率 | 債券率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-------|-----------|-------|--------|
| | | 騰 | 落率 | | | | |
| (期首) 2014年8月19日 | 円 10,199 | | % - | | % 59.7 | | % - |
| 8月末 | 10,200 | | 0.0 | | 70.0 | | - |
| 9月末 | 10,200 | | 0.0 | | 62.3 | | - |
| 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。

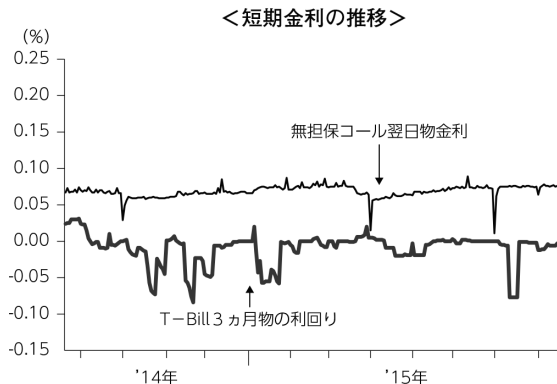
・無担保コール翌日物金利の推移

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。



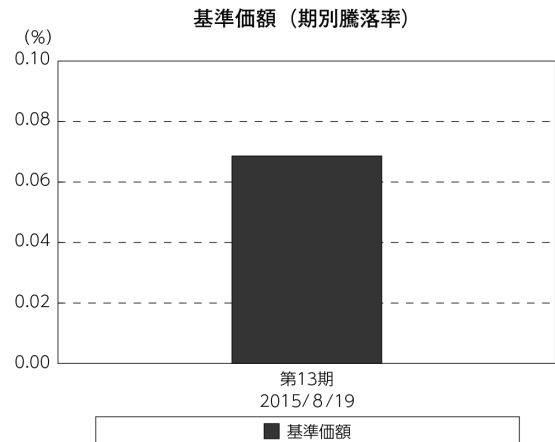
○当ファンドのポートフォリオ

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 | 国債証券 | 57,121,186 | 33,710,730 (24,409,350) |
| | 地方債証券 | 3,262,292 | — (1,970,000) |
| 内 | 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 マネーボール・ファンド | 20 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型 | 90 |
| 野村新中國株投資 マネーボール・ファンド | 78 |
| 野村日本ブランド株投資（マネーボールファンド）年2回決算型 | 745 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型 | 9 |
| 野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド | 9 |
| 野村RCM・グリーン・テックロジック マネーボール・ファンド | 1 |
| 野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド | 5 |
| 野村世界業種別投資シリーズ（マネーボール・ファンド） | 12 |
| ノムラ・アジア・シリーズ（マネーボール・ファンド） | 2,033 |
| 野村新エマージング債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型 | 5 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型 | 8 |
| 野村グローバルCB投信（マネーボールファンド）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（マネーボールファンド）年2回決算型 | 133 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型 | 0 |
| 野村日本スマートシティ株投資 マネーボールファンド | 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(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。

(2016年5月23日現在)

| 年 月 | 日 |
|----------|---------|
| 2016年 5月 | 30 |
| 6月 | 23 |
| 7月 | 4 |
| 8月 | 15、29 |
| 9月 | 5 |
| 10月 | － |
| 11月 | 1、11、24 |
| 12月 | 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。