

# 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14期(決算日2019年5月22日)

作成対象期間(2018年11月23日～2019年5月22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<br>プレミアム(円コース)<br>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  | 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。  |
|        | 野村マネー<br>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 | 野村日本高配当株<br>プレミアム(円コース)<br>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。<br>外貨建て資産への直接投資は行いません。   |
|        | 野村マネー<br>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<br>(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  |           |           |                 |              |
| 10期(2017年5月22日)  | 円<br>16,809  | 円<br>10   | %<br>8.2 | %<br>0.0  | %<br>—    | %<br>98.9       | 百万円<br>4,553 |
| 11期(2017年11月22日) | 18,445       | 10        | 9.8      | 0.0       | —         | 98.2            | 3,857        |
| 12期(2018年5月22日)  | 19,020       | 10        | 3.2      | 0.0       | —         | 99.0            | 3,869        |
| 13期(2018年11月22日) | 16,793       | 10        | △11.7    | 0.0       | —         | 98.9            | 3,102        |
| 14期(2019年5月22日)  | 15,878       | 10        | △5.4     | 0.0       | —         | 98.7            | 2,670        |

\*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      | %     | %   | %         | %         | %               |
| 2018年11月22日 | 16,793 | —     | 0.0 | —         | 98.9      |                 |
| 11月末        | 17,145 | 2.1   | 0.0 | —         | 98.5      |                 |
| 12月末        | 15,622 | △7.0  | 0.0 | —         | 98.6      |                 |
| 2019年1月末    | 16,310 | △2.9  | 0.0 | —         | 99.1      |                 |
| 2月末         | 16,786 | △0.0  | 0.0 | —         | 99.2      |                 |
| 3月末         | 16,470 | △1.9  | 0.0 | —         | 99.3      |                 |
| 4月末         | 16,803 | 0.1   | 0.0 | —         | 97.9      |                 |
| (期 末)       |        |       |     |           |           |                 |
| 2019年5月22日  | 15,888 | △5.4  | 0.0 | —         | 98.7      |                 |

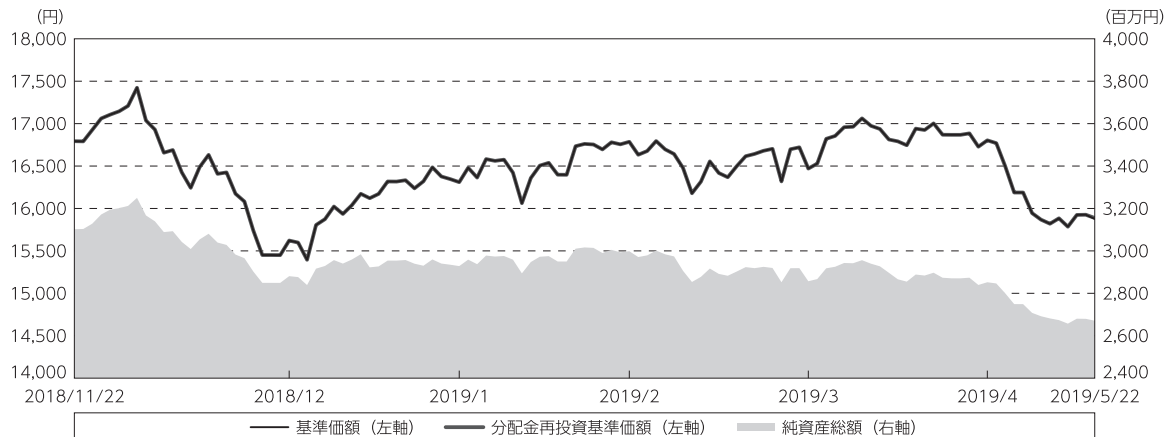
\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○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。作成年首（2018年11月22日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）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せんので、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。

#### (当作成期首～2018年12月下旬)

- (上 昇) 米中首脳会談において貿易摩擦緩和の動きが進むとの期待感が高まったこと。
- (上 昇) FRB（米連邦準備制度理事会）議長の講演での発言を受けて米国の利上げペースが鈍化するとの見方が広がり、投資家心理が改善したこと。
- (上 昇) 米中首脳会談において、米国が2019年1月1日に予定していた対中追加関税について一定の猶予を決定したこと。
- (下 落) 中国通信機器大手企業の幹部がカナダ当局に逮捕されたことにより、再び米中貿易摩擦への懸念が高まったこと。
- (下 落) FOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ決定を受けて景気減速への警戒感が高まったことや、米国の政府機関の一部閉鎖をめぐって混乱が生じたこと。
- (下 落) 為替市場において円高が進行したことや、新規上場した国内通信大手企業の初値が公開価格を下回ったことなどが嫌気されたこと。

#### (2019年1月上旬～2019年2月下旬)

- (上 昇) FRBが柔軟な金融政策運営方針を示したことで追加利上げ観測が後退したことや、米中通商協議進展への期待から貿易摩擦激化への警戒感が和らいだこと。
- (上 昇) 中国が景気支援策として大規模減税の実施を表明したことや、米国半導体関連企業の決算内容が好感されたこと。
- (下 落) 中国通信機器大手企業の幹部をめぐる問題が再燃し米中通商協議に対する期待がやや後退したことや、FOMCを控えて円高への警戒感が強まったこと。
- (上 昇) 米国経済指標の市場予想を上回る結果や為替市場で円安が進行したことなどが好感されたこと。
- (上 昇) トランプ米大統領の発言を受けて米中通商合意への楽観的な見方が広まったことや、米政府機関の再閉鎖回避に向け与野党が原則合意に達したことなどが好感されたこと。
- (上 昇) トランプ米大統領が対中追加関税の発動を延期すると表明したことなどが好感されたこと。

#### (2019年3月上旬～2019年4月下旬)

- (下 落) 欧州や中国の経済成長率見通しが下方修正されたことなどが嫌気されたこと。
- (上 昇) 中国が景気対策として行なう大型減税への期待が高まったことや、米国が金融引き締め姿勢を後退させたことなどが好感されたこと。
- (下 落) 3月の欧州や米国の製造業PMI（購買担当者景気指数）の悪化などを受けて世界景気の先行き不透明感が強まったこと。
- (下 落) トルコの信用不安や英国のEU（欧州連合）離脱交渉への懸念から投資家のリスク回避の動きが強まったこと。

(上 昇) 中国の一部経済指標の改善から中国経済回復への期待が高まったことや、米中貿易協議進展への期待が高まったこと。

### (2019年5月上旬～当作成期末)

(下 落) 米国の中国製品への関税引き上げが実施され、米中貿易摩擦が再燃したことなどにより、世界景気の減速が懸念されたこと。

(下 落) 景気の先行き不透明感が強まっていることを背景に企業の決算発表において、慎重な見方が広まったこと。

## ○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。<br>・カバー率：純資産に対するオプションのポジション<br>・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<br>・平均行使期間：権利行使日までの平均日数<br>・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。<br>（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）<br>・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<br>・プレミアム（年率）については、組み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       | 91.2%  |   |
| カバー率       | 21.5%  |   |
| 平均行使価格     | 106.6% |   |
| 平均行使期間     | 18.5日  |   |
| 配当利回り（年率）  | 3.4%   |   |
| プレミアム（年率）  | 0.7%   |   |

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9.8%、電気機器8.6%、銀行業8.2%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。

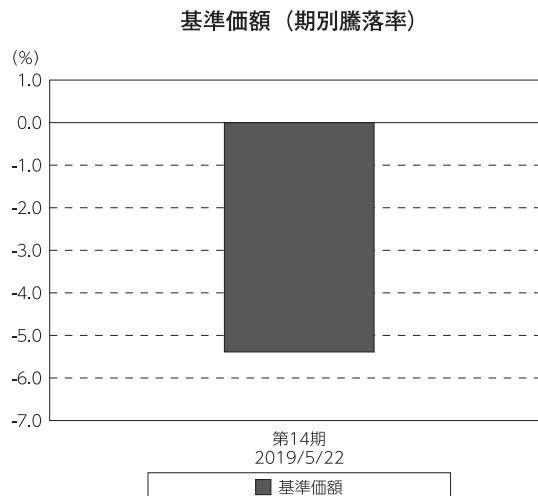
### [野村マネー マザーファンド]

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、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14期                       |
|-----------|----------------------------|
|           | 2018年11月23日～<br>2019年5月22日 |
| 当期分配金     | 10                         |
| (対基準価額比率) | 0.063%                     |
| 当期の収益     | 10                         |
| 当期の収益以外   | —                          |
| 翌期繰越分配対象額 | 10,069                     |

(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に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。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

### 【野村マネー マザーファンド】

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

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

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について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2018年11月23日～2019年5月22日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                    |
|-----------------------|---------|------------|--|
|                       | 金 額     | 比 率        |  |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>78 | %<br>0.471 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                      |
| （ 投 信 会 社 ）           | (22)    | (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 ）           | (53)    | (0.321)    | 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 ）           | ( 3 )   | (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                  |
| 合 計                   | 78      | 0.473      |  |
| 期中の平均基準価額は、16,522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

(2018年11月23日～2019年5月22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・エンハンスト・ファンド-日本円クラス | 16,529 | 200,908 | 33,728 | 419,303 |

- \* 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

(2018年11月23日～2019年5月22日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型&gt;

該当事項はございません。

&lt;野村マネー マザーファンド&gt;

| 区 分 | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     |               |                    |               |           |                    |               |
| 公社債 | 百万円<br>10,052 | 百万円<br>600         | %<br>6.0      | 百万円<br>-  | 百万円<br>-           | %<br>-        |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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

## ○組入資産の明細

(2019年5月22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・<br>ストック・エンハンスド・ファンド-日本円クラス | 口<br>240,419 | 口<br>223,220 | 千円<br>2,636,004 | %<br>98.7 |
| 合 計  | 240,419      | 223,220      | 2,636,004       | 98.7      |

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 親投資信託残高

| 銘 柄           | 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<br>982 | 千口<br>982 | 千円<br>1,002 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月22日現在)

| 項 目           | 当 期 末           |           |
|---------------|-----------------|-----------|
|               | 評 価 額           | 比 率       |
| 投資信託受益証券      | 千円<br>2,636,004 | %<br>98.0 |
| 野村マネー マザーファンド | 1,002           | 0.0       |
| コール・ローン等、その他  | 51,992          | 2.0       |
| 投資信託財産総額      | 2,688,998       | 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 (2019年5月22日現在)

| 項 目                | 当 期 末          |
|--------------------|----------------|
|                    | 円              |
| (A) 資産             | 2,688,998,061  |
| コール・ローン等           | 42,976,872     |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 2,636,004,980  |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,002,554      |
| 未収入金               | 9,013,655      |
| (B) 負債             | 18,077,703     |
| 未払収益分配金            | 1,682,137      |
| 未払解約金              | 2,532,604      |
| 未払信託報酬             | 13,815,848     |
| 未払利息               | 74             |
| その他未払費用            | 47,040         |
| (C) 純資産総額(A-B)     | 2,670,920,358  |
| 元本                 | 1,682,137,789  |
| 次期繰越損益金            | 988,782,569    |
| (D) 受益権総口数         | 1,682,137,789口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 15,878円        |

(注) 期首元本額は1,847,334,551円、期中追加設定元本額は39,413,409円、期中一部解約元本額は204,610,171円、1口当たり純資産額は1.5878円です。

## ○損益の状況 (2018年11月23日～2019年5月22日)

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | 66,713,148     |
| 受取配当金            | 66,731,054     |
| 支払利息             | △ 17,906       |
| (B) 有価証券売買損益     | △205,760,035   |
| 売買益              | 9,320,548      |
| 売買損              | △215,080,583   |
| (C) 信託報酬等        | △ 13,862,888   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △152,909,775   |
| (E) 前期繰越損益金      | 267,067,226    |
| (F) 追加信託差損益金     | 876,307,255    |
| (配当等相当額)         | ( 964,282,949) |
| (売買損益相当額)        | (△ 87,975,694) |
| (G) 計(D+E+F)     | 990,464,706    |
| (H) 収益分配金        | △ 1,682,137    |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 988,782,569    |
| 追加信託差損益金         | 876,307,255    |
| (配当等相当額)         | ( 964,282,955) |
| (売買損益相当額)        | (△ 87,975,700) |
| 分配準備積立金          | 729,622,285    |
| 繰越損益金            | △617,146,971   |

\*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（2018年11月23日～2019年5月22日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                        |
|------------------------------|----------------------------|
|                              | 2018年11月23日～<br>2019年5月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 52,851,988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             | 964,282,955円               |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 678,452,434円               |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 1,695,587,377円             |
| f. 分配対象収益(1万円当たり)            | 10,079円                    |
| g. 分配金                       | 1,682,137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

(2019年5月22日現在)

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

下記は、野村マネー マザーファンド全体(8,321,144千口)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<br>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               | 700,000<br>( 700,000)    | 700,738<br>( 700,738)    | 8.3<br>( 8.3)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 8.3<br>( 8.3)  |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 820,000<br>( 820,000)    | 820,157<br>( 820,157)    | 9.7<br>( 9.7)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 9.7<br>( 9.7)  |
| 金融債券                | 200,000<br>( 200,000)    | 200,029<br>( 200,029)    | 2.4<br>( 2.4)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 2.4<br>( 2.4)  |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 3,967,000<br>(3,967,000) | 3,969,972<br>(3,969,972) | 46.7<br>(46.7) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 46.7<br>(46.7) |
| 合 計                 | 5,687,000<br>(5,687,000) | 5,690,898<br>(5,690,898) | 67.0<br>(67.0) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 67.0<br>(67.0) |

\* ( )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                        | 利 率   | 当 期 末     |           |
|---------------------------|-------|-----------|-----------|
|                           |       | 額 面 金 額   | 評 価 額     |
| <b>地方債証券</b>              | %     | 千円        | 千円        |
| 東京都 公募第669回               | 1.63  | 200,000   | 200,236   |
| 東京都 公募第671回               | 1.42  | 300,000   | 300,308   |
| 北海道 公募平成21年度第2回           | 1.66  | 100,000   | 100,034   |
| 愛知県 公募平成21年度第3回           | 1.66  | 100,000   | 100,159   |
| 小 計                       |       | 700,000   | 700,738   |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>        |       |           |           |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第27回       | 0.372 | 60,000    | 60,061    |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回      | 0.573 | 100,000   | 100,049   |
| 日本学生支援債券 財投機関債第47回        | 0.001 | 100,000   | 100,001   |
| 東日本高速道路 第26回              | 0.305 | 100,000   | 100,028   |
| 東日本高速道路 第27回              | 0.248 | 60,000    | 60,012    |
| 東日本高速道路 第41回              | 0.005 | 100,000   | 100,001   |
| 東日本高速道路 第49回              | 0.001 | 300,000   | 300,003   |
| 小 計                       |       | 820,000   | 820,157   |
| <b>金融債券</b>               |       |           |           |
| しんきん中金債券 利付第294回          | 0.25  | 100,000   | 100,003   |
| しんきん中金債券 利付第295回          | 0.25  | 100,000   | 100,026   |
| 小 計                       |       | 200,000   | 200,029   |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>    |       |           |           |
| 中部電力 第490回                | 1.444 | 200,000   | 200,479   |
| 中国電力 第390回                | 0.14  | 327,000   | 327,012   |
| 北陸電力 第303回                | 0.756 | 400,000   | 400,256   |
| 四国電力 第288回                | 0.14  | 40,000    | 40,004    |
| 九州電力 第408回                | 1.672 | 400,000   | 400,628   |
| 三菱電機 第44回社債間限定同順位特約付      | 0.27  | 500,000   | 500,084   |
| デンソー 第9回社債間限定同順位特約付       | 0.203 | 600,000   | 600,125   |
| トヨタ自動車 第10回社債間限定同等特約付     | 1.772 | 400,000   | 400,526   |
| 三井住友信託銀行 第8回社債間限定同順位特約付   | 0.234 | 100,000   | 100,041   |
| トヨタファイナンス 第71回社債間限定同順位特約付 | 0.001 | 200,000   | 200,000   |
| 三菱UFJリース 第29回社債間限定同順位特約付  | 0.304 | 300,000   | 300,062   |
| 三菱地所 第108回担保提供制限等財務上特約無   | 0.631 | 300,000   | 300,049   |
| 電源開発 第28回社債間限定同順位特約付      | 1.474 | 200,000   | 200,702   |
| 小 計                       |       | 3,967,000 | 3,969,972 |
| 合 計                       |       | 5,687,000 | 5,690,898 |

\* 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<br>499,994 | %<br>5.9 |

\* 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・エンハンスド・ファンド  
(日本円クラス、通貨セレクトクラス)

2018年3月31日決算

(計算期間:2017年4月1日～2018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。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。 |
| 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<br>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

2018年3月31日に終了する計測期間  
(円)

## 収益

|                  |               |
|------------------|---------------|
| 銀行口座利息           | 105,358,125   |
| 受取配当金等(源泉徴収税控除後) | 3,152,133,964 |

|      |               |
|------|---------------|
| 収益合計 | 3,257,492,089 |
|------|---------------|

## 費用

|          |             |
|----------|-------------|
| 投資顧問報酬   | 688,777,566 |
| 事務管理代行報酬 | 150,015,494 |
| 保管費用     | 45,028,305  |
| 取引銀行報酬   | 20,653,863  |
| 受託報酬     | 30,017,491  |
| 法務報酬     | 3,020,606   |
| 立替費用     | 3,890,563   |
| 専門家報酬    | 2,479,397   |
| 当座借越利息   | 24,737,303  |
| 雑費用      | 10,475      |

|      |             |
|------|-------------|
| 費用合計 | 968,631,063 |
|------|-------------|

|       |               |
|-------|---------------|
| 純投資損益 | 2,288,861,026 |
|-------|---------------|

|                       |                 |
|-----------------------|-----------------|
| 投資有価証券売買に係る損益         | 16,482,199,081  |
| オプション取引契約に係る損益        | (1,719,710,554) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | 11,085,370,431  |

|         |                |
|---------|----------------|
| 当期実現純損益 | 25,847,858,958 |
|---------|----------------|

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| 投資有価証券評価差損益       | (1,255,293,882) |
| オプション取引契約に係る評価差損益 | (153,407,658)   |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損益 | (5,371,211,941) |

|         |                 |
|---------|-----------------|
| 当期評価差損益 | (6,779,913,481) |
|---------|-----------------|

|      |               |
|------|---------------|
| 為替差額 | (718,352,774) |
|------|---------------|

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 運用の結果による純資産の増減額 | 20,638,453,729 |
|-----------------|----------------|

## 組入資産明細

2018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       |                                     |               |          |
| 840,000   | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | 3,738,840,000 | 3.13     |
| 3,100,000 | NISSAN MOTOR CO LTD                 | 3,392,950,000 | 2.84     |
| 1,230,000 | NTT DOCOMO                          | 3,308,085,000 | 2.77     |
| 4,300,000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP      | 2,994,090,000 | 2.51     |
| 870,000   | MITSUBISHI CORP                     | 2,458,185,000 | 2.05     |
| 800,000   | JAPAN TOBACCO INC                   | 2,428,000,000 | 2.02     |
| 470,000   | TOKIO MARINE HOLDINGS INC           | 2,243,310,000 | 1.87     |
| 1,080,000 | ITOCHEU CORP                        | 2,215,620,000 | 1.85     |
| 3,400,000 | JXTG HOLDINGS                       | 2,167,840,000 | 1.81     |
| 615,000   | SUBARU CORP                         | 2,145,735,000 | 1.79     |
| 580,000   | KOMATSU LTD                         | 2,032,900,000 | 1.69     |
| 490,000   | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD         | 1,979,600,000 | 1.65     |
| 400,000   | NIPPON TELG & TEL CORP NTT          | 1,960,800,000 | 1.63     |
| 460,000   | SOMPO HOLDINGS INC                  | 1,950,860,000 | 1.63     |
| 380,000   | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD        | 1,945,600,000 | 1.62     |
| 255,000   | TOYOTA MOTOR CORP                   | 1,744,710,000 | 1.45     |
| 2,450,000 | YAMADA DENKI CO LTD                 | 1,570,450,000 | 1.31     |
| 320,000   | DENTSU                              | 1,488,000,000 | 1.24     |
| 810,000   | SUMITOMO CORP                       | 1,424,790,000 | 1.19     |
| 95,000    | MURATA MANUFACTURING CO LTD         | 1,376,550,000 | 1.15     |
| 1,000,000 | AMADA HOLDINGS CO LTD               | 1,275,000,000 | 1.06     |
| 635,000   | ORIX CORP                           | 1,192,847,500 | 0.99     |
| 730,000   | ASTELLAS PHARMA INC                 | 1,179,680,000 | 0.98     |
| 185,000   | TOYOTA INDUSTRIES CORP              | 1,176,600,000 | 0.98     |
| 1,940,000 | FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC         | 1,117,440,000 | 0.93     |
| 1,450,000 | MITSUBISHI MOTORS CORP              | 1,090,400,000 | 0.91     |
| 1,270,000 | CHIBA BANK LTD                      | 1,088,390,000 | 0.91     |
| 82,000    | SHIMAMURA CORP                      | 1,080,760,000 | 0.90     |
| 670,000   | ISUZU MOTORS LTD                    | 1,078,030,000 | 0.90     |
| 390,000   | HITACHI CAPITAL                     | 1,037,010,000 | 0.86     |
| 570,000   | MITSUMI & CO LTD                    | 1,031,700,000 | 0.86     |
| 830,000   | HITACHI METALS LTD                  | 1,025,880,000 | 0.86     |
| 172,000   | AISIN SEIKI CO LTD                  | 987,280,000   | 0.82     |
| 510,000   | SEKISUI HOUSE LTD                   | 985,320,000   | 0.82     |
| 1,290,000 | HITACHI LTD                         | 984,399,000   | 0.82     |
| 420,000   | LIXIL GROUP CORPORATION             | 980,700,000   | 0.82     |
| 180,000   | OTSUKA HOLDINGS CO LTD              | 952,740,000   | 0.79     |
| 350,000   | KDDI CORP                           | 946,925,000   | 0.79     |
| 400,000   | JSR CORPORATION                     | 945,200,000   | 0.79     |



| 株数(株)     | 銘柄                                 | 評価額         | 純資産比率(%) |
|-----------|------------------------------------|-------------|----------|
| 215,000   | SUMITOMO METAL MINING CO LTD       | 929,875,000 | 0.78     |
| 610,000   | PANASONIC CORP                     | 917,135,000 | 0.76     |
| 500,000   | NGK INSULATORS LTD                 | 908,000,000 | 0.76     |
| 870,000   | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS       | 887,400,000 | 0.74     |
| 230,000   | CANON INC                          | 885,500,000 | 0.74     |
| 250,000   | DAIICHI SANKYO CO LTD              | 883,750,000 | 0.74     |
| 185,000   | PIGEON CORP                        | 881,525,000 | 0.73     |
| 500,000   | MITSUBISHI ELECTRIC CORP           | 849,750,000 | 0.71     |
| 940,000   | KONICA MINOLTA INC                 | 839,420,000 | 0.70     |
| 240,000   | SATO HOLDINGS CORP                 | 811,200,000 | 0.68     |
| 320,000   | NGK SPARK PLUG CO LTD              | 809,280,000 | 0.67     |
| 102,000   | KAO CORP                           | 809,064,000 | 0.67     |
| 420,000   | SONY FINANCIAL HOLDINGS INC        | 807,240,000 | 0.67     |
| 180,000   | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 774,540,000 | 0.65     |
| 480,000   | SUMITOMO ELECTRIC IND LTD          | 771,120,000 | 0.64     |
| 29,000    | FANUC CORPORATION                  | 770,530,000 | 0.64     |
| 228,000   | EXEDY CORP                         | 759,240,000 | 0.63     |
| 152,000   | AZBIL CORP                         | 753,160,000 | 0.63     |
| 450,000   | CASIO COMPUTER CO LTD              | 703,800,000 | 0.59     |
| 380,000   | SEIKO EPSON CORP                   | 692,360,000 | 0.58     |
| 36,000    | TOKYO ELECTRON LTD                 | 691,740,000 | 0.58     |
| 210,000   | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS     | 687,960,000 | 0.57     |
| 470,000   | TOHOKU ELEC POWER CO INC           | 674,450,000 | 0.56     |
| 160,000   | AOYAMA TRADING CO LTD              | 665,600,000 | 0.55     |
| 39,000    | HIKARI TSUSHIN INC                 | 661,830,000 | 0.55     |
| 510,000   | NTT URBAN DEVELOPMENT CORP         | 656,370,000 | 0.55     |
| 183,000   | DIC CORP                           | 645,990,000 | 0.54     |
| 130,000   | HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CORP     | 644,800,000 | 0.54     |
| 162,000   | TOKYO OHKA KOGYO CO LTD            | 619,650,000 | 0.52     |
| 100,000   | TREND MICRO INC                    | 617,000,000 | 0.51     |
| 280,000   | DAI NIPPON PRINTING CO LTD         | 611,240,000 | 0.51     |
| 1,070,000 | RESONA HOLDINGS INC                | 604,443,000 | 0.50     |
| 700,000   | TSUBAKIMOTO CHAIN CO               | 601,300,000 | 0.50     |
| 165,000   | HONDA MOTOR CO LTD                 | 600,765,000 | 0.50     |
| 285,000   | NIPPON PAPER INDUSTRIES CO LTD     | 556,035,000 | 0.46     |
| 56,000    | ROHM CO LTD                        | 554,400,000 | 0.46     |
| 130,000   | MITSUBISHI HEAVY IND LTD           | 527,670,000 | 0.44     |
| 270,000   | STAR MICRONICS CO LTD              | 526,230,000 | 0.44     |
| 175,000   | NEC CORP                           | 518,000,000 | 0.43     |
| 440,000   | DAICEL CORP                        | 507,760,000 | 0.42     |
| 1,480,000 | SOJITZ CORPORATION                 | 495,800,000 | 0.41     |
| 560,000   | LEOPALACE21 CORPORATION            | 484,960,000 | 0.40     |
| 640,000   | TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP        | 484,480,000 | 0.40     |
| 340,000   | NSK LIMITED                        | 478,720,000 | 0.40     |
| 370,000   | CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD      | 478,040,000 | 0.40     |
| 112,000   | AOZORA BANK LTD                    | 473,760,000 | 0.40     |

| 株数(株)     | 銘柄                                  | 評価額         | 純資産比率(%) |
|-----------|-------------------------------------|-------------|----------|
| 26,000    | DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD     | 468,260,000 | 0.39     |
| 370,000   | KANDENKO CO LTD                     | 447,330,000 | 0.37     |
| 100,000   | ASAHI GLASS CO LTD                  | 439,500,000 | 0.37     |
| 310,000   | SANWA HOLDINGS CORP                 | 418,190,000 | 0.35     |
| 95,000    | HANWA CO LTD                        | 413,725,000 | 0.34     |
| 120,000   | BANDAI NAMCO HOLDINGS INC           | 408,000,000 | 0.34     |
| 180,000   | RESORTTRUST INC                     | 401,580,000 | 0.33     |
| 140,000   | KYOWA EXEO CORP                     | 392,700,000 | 0.33     |
| 67,000    | NIPPON STEEL & SUMIKIN BUISSAN CORP | 389,940,000 | 0.33     |
| 120,000   | YAMAHA MOTOR CO LTD                 | 375,000,000 | 0.31     |
| 62,000    | MEITEC CORPORATION                  | 356,500,000 | 0.30     |
| 150,000   | HITACHI CHEMICAL CO LTD             | 351,600,000 | 0.29     |
| 730,000   | SKY PERFECT JSAT HOLDINGS INC       | 346,750,000 | 0.29     |
| 1,020,000 | SEVEN BANK LTD                      | 344,760,000 | 0.29     |
| 250,000   | KANSAI ELECTRIC POWER CO INC        | 344,750,000 | 0.29     |
| 200,000   | T&D HOLDINGS INC                    | 334,700,000 | 0.28     |
| 100,000   | MITSUI CHEMICALS INC                | 333,000,000 | 0.28     |
| 115,000   | STARTS CORP INC                     | 331,430,000 | 0.28     |
| 145,000   | NIHON UNISYS LTD                    | 329,730,000 | 0.27     |
| 93,000    | DENKA CO LTD                        | 329,685,000 | 0.27     |
| 138,000   | ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP        | 299,598,000 | 0.25     |
| 90,000    | KYUSHU RAILWAY COMPANY              | 297,000,000 | 0.25     |
| 135,000   | USS CO LTD                          | 290,790,000 | 0.24     |
| 95,000    | WACOAL HOLDINGS CORP                | 290,225,000 | 0.24     |
| 115,000   | JAPAN POST INSURANCE CO LTD         | 287,615,000 | 0.24     |
| 45,000    | TECHNOPRO HOLDINGS INC              | 285,750,000 | 0.24     |
| 65,000    | JAPAN AIRLINES                      | 278,785,000 | 0.23     |
| 1,000,000 | NIPPON LIGHT METAL HLDG CO LTD      | 274,000,000 | 0.23     |
| 70,000    | AICA KOGYO CO LTD                   | 270,550,000 | 0.23     |
| 430,000   | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD            | 261,440,000 | 0.22     |
| 90,000    | PARK24 CO LTD                       | 259,380,000 | 0.22     |
| 196,000   | RELIA INC                           | 252,448,000 | 0.21     |
| 350,000   | SUMITOMO WAREHOUSE CO LTD           | 245,350,000 | 0.20     |
| 125,000   | ASAHI HOLDINGS INC                  | 244,750,000 | 0.20     |
| 175,000   | ASAHI KASEI CORPORATION             | 244,737,500 | 0.20     |
| 50,000    | TAIYO HOLDINGS CO LTD               | 227,000,000 | 0.19     |
| 30,000    | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY          | 224,250,000 | 0.19     |
| 130,000   | MITSUI E AND S HOLDINGS             | 224,120,000 | 0.19     |
| 110,000   | TECMO KOEI HOLDINGS CO LTD          | 222,420,000 | 0.19     |
| 100,000   | TOKAI RIKA CO LTD                   | 214,300,000 | 0.18     |
| 210,000   | SENKO GROUP HOLDING                 | 173,250,000 | 0.14     |
| 32,000    | OTSUKA CORP                         | 171,520,000 | 0.14     |
| 90,000    | KONOIKE TRANSPORT CO LTD            | 163,080,000 | 0.14     |
| 31,000    | POLA ORBIS HOLDINGS INC             | 136,245,000 | 0.11     |
| 45,000    | SAKATA INX CORP                     | 70,605,000  | 0.06     |

| 株数(株)  | 銘柄               | 評価額                           | 純資産比率(%)            |
|--------|------------------|-------------------------------|---------------------|
| 30,000 | OSAKA GAS CO LTD | 62,910,000                    | 0.05                |
|        |                  | <u>109,765,347,000</u>        | <u>91.52</u>        |
|        | 日本計              | <u>109,765,347,000</u>        | <u>91.52</u>        |
|        | <b>組入資産合計</b>    | <b><u>109,765,347,000</u></b> | <b><u>91.52</u></b> |

## 外国為替先渡し契約

2018年3月31日現在

| 通貨(買い)            | 通貨(売り)             | 満期             | 未実現損益(円)                      |
|-------------------|--------------------|----------------|-------------------------------|
| MXN 3,964,000,000 | USD 208,838,218    | April 26, 2018 | 707,939,715                   |
| ZAR 891,000,000   | USD 72,797,091     | April 26, 2018 | 250,320,545                   |
| USD 228,192,194   | JPY 24,000,000,000 | June 15, 2018  | 194,569,716                   |
| ZAR 1,844,000,000 | USD 153,207,681    | May 25, 2018   | 181,472,593                   |
| MXN 824,000,000   | USD 43,632,512     | May 25, 2018   | 100,794,909                   |
| USD 12,288,519    | TRY 48,000,000     | April 26, 2018 | 44,883,044                    |
| ZAR 295,000,000   | USD 24,699,337     | April 26, 2018 | 19,247,998                    |
| USD 11,207,447    | ZAR 131,000,000    | April 26, 2018 | 16,952,477                    |
| USD 50,873,565    | JPY 5,400,000,000  | May 16, 2018   | 5,166,548                     |
| INR 577,000,000   | USD 8,798,414      | April 26, 2018 | 2,509,843                     |
| USD 6,359,178     | INR 415,000,000    | April 26, 2018 | 1,501,856                     |
| INR 586,000,000   | USD 8,939,740      | May 25, 2018   | (1,194,708)                   |
| INR 6,603,000,000 | USD 100,652,419    | May 25, 2018   | (4,952,334)                   |
| JPY 2,200,000,000 | USD 20,745,909     | April 12, 2018 | (9,080,841)                   |
| USD 31,937,747    | JPY 3,400,000,000  | May 31, 2018   | (10,252,208)                  |
| USD 6,499,217     | MXN 122,000,000    | April 26, 2018 | (14,135,697)                  |
| USD 32,639,814    | JPY 3,500,000,000  | May 10, 2018   | (30,796,799)                  |
| INR 4,478,000,000 | USD 68,998,459     | April 26, 2018 | (56,770,327)                  |
| USD 76,702,180    | JPY 8,200,000,000  | May 31, 2018   | (59,272,391)                  |
| JPY 4,800,000,000 | USD 45,639,685     | April 12, 2018 | (59,872,303)                  |
| JPY 3,900,000,000 | USD 37,246,935     | April 12, 2018 | (66,198,282)                  |
| BRL 743,400,000   | USD 224,329,185    | May 03, 2018   | (118,585,921)                 |
| USD 57,685,766    | JPY 6,275,000,000  | May 10, 2018   | (143,965,613)                 |
| TRY 308,500,000   | USD 79,084,313     | May 25, 2018   | (372,075,585)                 |
| TRY 423,000,000   | USD 108,628,101    | April 26, 2018 | (431,290,319)                 |
| USD 258,946,888   | JPY 28,400,000,000 | April 26, 2018 | (852,225,160)                 |
| USD 314,266,911   | JPY 35,100,000,000 | April 12, 2018 | (1,637,551,307)               |
|                   |                    |                | <b><u>(2,342,860,551)</u></b> |

## オプション取引契約

2018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)    |
|----------------|-----------|-----------------------------------|----------------|-------------|-------------|-------------|
| <b>売建ポジション</b> |           |                                   |                |             |             |             |
| JPY            | (450,000) | C 8306 JT 843.7 03/04/18 OTC      | April 03, 2018 | (586,755)   | 0           | 586,755     |
| JPY            | (13,000)  | C 1878 JT 18635.1286 23/04/18 OTC | April 23, 2018 | (365,670)   | (2,990,503) | (2,624,833) |
| JPY            | (11,000)  | C 1878 JT 19310.4 13/04/18 OTC    | April 13, 2018 | (609,798)   | (392,434)   | 217,274     |
| JPY            | (90,000)  | C 1925 JT 4040.137 23/04/18 OTC   | April 23, 2018 | (1,097,694) | (9,080,724) | (7,983,030) |
| JPY            | (70,000)  | C 1925 JT 4212.8059 20/04/18 OTC  | April 20, 2018 | (870,646)   | (2,229,435) | (1,358,789) |
| JPY            | (75,000)  | C 1925 JT 4256.96 17/04/18 OTC    | April 17, 2018 | (753,000)   | (1,411,673) | (658,673)   |
| JPY            | (80,000)  | C 1925 JT 4280.0262 13/04/18 OTC  | April 13, 2018 | (815,240)   | (845,570)   | (30,330)    |
| JPY            | (80,000)  | C 1925 JT 4354.607 16/04/18 OTC   | April 16, 2018 | (854,488)   | (557,836)   | 296,652     |
| JPY            | (150,000) | C 1928 JT 1938.4231 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (1,052,280) | (5,846,855) | (4,794,575) |
| JPY            | (110,000) | C 1928 JT 2018.9407 13/04/18 OTC  | April 13, 2018 | (539,638)   | (958,555)   | (418,917)   |
| JPY            | (170,000) | C 1928 JT 2082.7368 27/04/18 OTC  | April 27, 2018 | (721,242)   | (1,250,751) | (529,509)   |
| JPY            | (120,000) | C 2914 JT 3026.3 23/04/18 OTC     | April 23, 2018 | (1,301,880) | (8,624,755) | (7,322,875) |
| JPY            | (130,000) | C 2914 JT 3027.3192 24/04/18 OTC  | April 24, 2018 | (2,248,870) | (9,436,331) | (7,187,461) |
| JPY            | (120,000) | C 2914 JT 3108.98 26/04/18 OTC    | April 26, 2018 | (1,020,684) | (4,685,822) | (3,665,138) |
| JPY            | (100,000) | C 2914 JT 3132.8346 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (835,420)   | (2,034,483) | (1,199,063) |
| JPY            | (110,000) | C 2914 JT 3199.08 13/04/18 OTC    | April 13, 2018 | (464,772)   | (672,108)   | (207,336)   |
| JPY            | (90,000)  | C 2914 JT 3232.47 05/04/18 OTC    | April 05, 2018 | (543,780)   | (33,416)    | 510,364     |
| JPY            | (260,000) | C 4188 JT 1047.492 26/04/18 OTC   | April 26, 2018 | (1,008,696) | (5,615,795) | (4,607,099) |
| JPY            | (300,000) | C 4188 JT 1103.7534 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (613,200)   | (1,117,146) | (503,946)   |
| JPY            | (240,000) | C 4188 JT 1129.1029 27/04/18 OTC  | April 27, 2018 | (537,096)   | (1,016,309) | (479,213)   |
| JPY            | (27,000)  | C 4452 JT 7757.08 17/04/18 OTC    | April 17, 2018 | (987,930)   | (7,460,392) | (6,472,462) |
| JPY            | (35,000)  | C 4452 JT 8422.5976 20/04/18 OTC  | April 20, 2018 | (703,171)   | (1,217,330) | (514,159)   |
| JPY            | (33,000)  | C 4452 JT 8588.8975 25/04/18 OTC  | April 25, 2018 | (813,558)   | (808,273)   | 5,285       |
| JPY            | (50,000)  | C 4502 JT 5761.35 23/04/18 OTC    | April 23, 2018 | (768,180)   | (87,542)    | 680,638     |
| JPY            | (55,000)  | C 4502 JT 5763.3063 20/04/18 OTC  | April 20, 2018 | (944,850)   | (61,696)    | 883,154     |
| JPY            | (50,000)  | C 4502 JT 5799.8267 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (920,165)   | (17,695)    | 902,470     |
| JPY            | (55,000)  | C 4502 JT 5874.75 26/04/18 OTC    | April 26, 2018 | (861,630)   | (55,519)    | 806,111     |
| JPY            | (50,000)  | C 4502 JT 5921.7968 13/04/18 OTC  | April 13, 2018 | (479,385)   | (1,630)     | 477,755     |
| JPY            | (55,000)  | C 4502 JT 6193.256 17/04/18 OTC   | April 17, 2018 | (986,870)   | (414)       | 986,456     |
| JPY            | (48,000)  | C 4502 JT 6234.1178 10/04/18 OTC  | April 10, 2018 | (592,828)   | (3)         | 592,825     |
| JPY            | (130,000) | C 4503 JT 1624.0272 11/04/18 OTC  | April 11, 2018 | (796,692)   | (3,522,704) | (2,726,012) |
| JPY            | (170,000) | C 4503 JT 1684.34 20/04/18 OTC    | April 20, 2018 | (702,338)   | (2,415,391) | (1,713,053) |
| JPY            | (200,000) | C 4503 JT 1694.88 24/04/18 OTC    | April 24, 2018 | (601,920)   | (2,831,942) | (2,230,022) |
| JPY            | (160,000) | C 4503 JT 1696.0688 23/04/18 OTC  | April 23, 2018 | (793,632)   | (2,128,552) | (1,334,920) |
| JPY            | (90,000)  | C 4568 JT 4030.6742 10/04/18 OTC  | April 10, 2018 | (671,778)   | (10,177)    | 661,601     |
| JPY            | (60,000)  | C 4568 JT 4038.6771 20/04/18 OTC  | April 20, 2018 | (960,138)   | (79,382)    | 880,756     |
| JPY            | (80,000)  | C 4568 JT 4142 16/04/18 OTC       | April 16, 2018 | (942,400)   | (13,238)    | 929,162     |
| JPY            | (480,000) | C 5020 JT 677.1492 16/04/18 OTC   | April 16, 2018 | (1,053,360) | (2,033,938) | (980,578)   |
| JPY            | (550,000) | C 5020 JT 690.2996 20/04/18 OTC   | April 20, 2018 | (1,184,260) | (1,809,500) | (625,240)   |
| JPY            | (520,000) | C 5020 JT 690.4698 13/04/18 OTC   | April 13, 2018 | (691,756)   | (899,059)   | (207,303)   |
| JPY            | (480,000) | C 5020 JT 695.1804 17/04/18 OTC   | April 17, 2018 | (803,328)   | (1,014,542) | (211,214)   |
| JPY            | (520,000) | C 5020 JT 714.3096 27/04/18 OTC   | April 27, 2018 | (803,140)   | (1,094,605) | (291,465)   |
| JPY            | (420,000) | C 5020 JT 727.3608 11/04/18 OTC   | April 11, 2018 | (577,962)   | (53,214)    | 524,748     |
| JPY            | (120,000) | C 5802 JT 1750.0702 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (667,320)   | (476,743)   | 190,577     |
| JPY            | (200,000) | C 5802 JT 1765.8936 12/04/18 OTC  | April 12, 2018 | (1,652,480) | (278,284)   | 1,374,196   |
| JPY            | (120,000) | C 5802 JT 1783.3839 11/04/18 OTC  | April 11, 2018 | (583,656)   | (83,161)    | 500,495     |
| JPY            | (90,000)  | C 5938 JT 2606.8716 13/04/18 OTC  | April 13, 2018 | (362,592)   | (137,553)   | 225,039     |

## 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 | (75,000)  | C 5938 JT 2609.46 16/04/18 OTC    | April 16, 2018 | (251,370)   | (181,002)   | 70,368      |
| JPY | (90,000)  | C 5938 JT 2658.0085 12/04/18 OTC  | April 12, 2018 | (1,250,973) | (40,940)    | 1,210,033   |
| JPY | (100,000) | C 6301 JT 3797.56 20/04/18 OTC    | April 20, 2018 | (1,742,000) | (1,980,742) | (238,742)   |
| JPY | (90,000)  | C 6301 JT 3848.0815 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (953,199)   | (955,517)   | (2,318)     |
| JPY | (70,000)  | C 6301 JT 3887.22 06/04/18 OTC    | April 06, 2018 | (588,336)   | (44,833)    | 543,503     |
| JPY | (90,000)  | C 6301 JT 3912.5841 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (1,001,475) | (492,218)   | 509,257     |
| JPY | (80,000)  | C 6301 JT 3915.28 13/04/18 OTC    | April 13, 2018 | (689,664)   | (271,956)   | 417,708     |
| JPY | (80,000)  | C 6301 JT 3955.2494 05/04/18 OTC  | April 05, 2018 | (1,035,560) | (8,010)     | 1,027,550   |
| JPY | (380,000) | C 6501 JT 828.3827 23/04/18 OTC   | April 23, 2018 | (924,122)   | (1,354,187) | (430,065)   |
| JPY | (380,000) | C 6501 JT 849.7749 20/04/18 OTC   | April 20, 2018 | (622,136)   | (476,174)   | 145,962     |
| JPY | (400,000) | C 6501 JT 857.9206 13/04/18 OTC   | April 13, 2018 | (699,040)   | (121,252)   | 577,788     |
| JPY | (180,000) | C 6503 JT 1838.3976 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (643,446)   | (679,585)   | (36,139)    |
| JPY | (140,000) | C 6503 JT 1861.38 20/04/18 OTC    | April 20, 2018 | (579,096)   | (459,766)   | 119,330     |
| JPY | (140,000) | C 6503 JT 1886.3416 12/04/18 OTC  | April 12, 2018 | (720,244)   | (76,913)    | 643,331     |
| JPY | (220,000) | C 6752 JT 1758.7417 05/04/18 OTC  | April 05, 2018 | (745,448)   | (13)        | 745,435     |
| JPY | (200,000) | C 6752 JT 1768.8421 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (661,240)   | (11,310)    | 649,930     |
| JPY | (160,000) | C 6752 JT 1782.06/04/18 OTC       | April 06, 2018 | (388,800)   | (8)         | 388,792     |
| JPY | (20,000)  | C 6981 JT 15713.378 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (881,124)   | (854,482)   | 26,642      |
| JPY | (15,000)  | C 6981 JT 15897.65 20/04/18 OTC   | April 20, 2018 | (656,325)   | (568,625)   | 87,700      |
| JPY | (25,000)  | C 6981 JT 15913.3712 05/04/18 OTC | April 05, 2018 | (1,021,960) | (31,522)    | 990,438     |
| JPY | (17,000)  | C 6981 JT 16313.06/04/18 OTC      | April 06, 2018 | (403,376)   | (5,362)     | 398,014     |
| JPY | (60,000)  | C 7011 JT 4148.363 26/04/18 OTC   | April 26, 2018 | (845,328)   | (4,558,606) | (3,713,278) |
| JPY | (60,000)  | C 7011 JT 4357.6143 23/04/18 OTC  | April 23, 2018 | (532,596)   | (1,100,794) | (568,198)   |
| JPY | (300,000) | C 7201 JT 1142.3776 26/04/18 OTC  | April 26, 2018 | (856,770)   | (2,663,847) | (1,807,077) |
| JPY | (330,000) | C 7201 JT 1149.1515 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (883,608)   | (1,376,354) | (492,746)   |
| JPY | (300,000) | C 7201 JT 1155.8387 11/04/18 OTC  | April 11, 2018 | (1,100,280) | (542,031)   | 558,249     |
| JPY | (300,000) | C 7201 JT 1156.46 23/04/18 OTC    | April 23, 2018 | (720,060)   | (1,533,138) | (813,078)   |
| JPY | (350,000) | C 7201 JT 1157.8992 05/04/18 OTC  | April 05, 2018 | (1,363,880) | (122,525)   | 1,241,355   |
| JPY | (300,000) | C 7201 JT 1163.4 24/04/18 OTC     | April 24, 2018 | (332,400)   | (1,295,967) | (963,567)   |
| JPY | (330,000) | C 7201 JT 1165.84 27/04/18 OTC    | April 27, 2018 | (776,853)   | (1,548,895) | (772,042)   |
| JPY | (300,000) | C 7201 JT 1178.8 13/04/18 OTC     | April 13, 2018 | (471,510)   | (232,866)   | 238,644     |
| JPY | (150,000) | C 7202 JT 1722.8335 27/04/18 OTC  | April 27, 2018 | (924,645)   | (2,212,827) | (1,288,182) |
| JPY | (150,000) | C 7202 JT 1754.2122 23/04/18 OTC  | April 23, 2018 | (531,090)   | (1,144,229) | (613,139)   |
| JPY | (150,000) | C 7202 JT 1760.9312 26/04/18 OTC  | April 26, 2018 | (624,330)   | (1,241,951) | (617,621)   |
| JPY | (40,000)  | C 7203 JT 7135.83 24/04/18 OTC    | April 24, 2018 | (453,492)   | (2,072,560) | (1,619,068) |
| JPY | (40,000)  | C 7203 JT 7162.05 23/04/18 OTC    | April 23, 2018 | (572,964)   | (1,747,968) | (1,175,004) |
| JPY | (45,000)  | C 7203 JT 7209.06 20/04/18 OTC    | April 20, 2018 | (673,299)   | (1,293,611) | (620,312)   |
| JPY | (50,000)  | C 7203 JT 7250.4 06/04/18 OTC     | April 06, 2018 | (649,800)   | (119,896)   | 529,904     |
| JPY | (60,000)  | C 7203 JT 7275.84 13/04/18 OTC    | April 13, 2018 | (411,840)   | (556,981)   | (145,141)   |
| JPY | (380,000) | C 7211 JT 823.3581 13/04/18 OTC   | April 13, 2018 | (717,592)   | (592,671)   | 124,921     |
| JPY | (400,000) | C 7211 JT 830.8707 27/04/18 OTC   | April 27, 2018 | (845,960)   | (1,565,116) | (719,156)   |
| JPY | (450,000) | C 7211 JT 831.6 16/04/18 OTC      | April 16, 2018 | (884,520)   | (720,293)   | 164,227     |
| JPY | (80,000)  | C 7267 JT 3840.23 24/04/18 OTC    | April 24, 2018 | (803,936)   | (2,042,158) | (1,238,222) |
| JPY | (70,000)  | C 7267 JT 3883.6137 23/04/18 OTC  | April 23, 2018 | (736,799)   | (1,195,393) | (458,594)   |
| JPY | (100,000) | C 7270 JT 3622.2126 23/04/18 OTC  | April 23, 2018 | (1,069,420) | (4,246,513) | (3,177,093) |
| JPY | (110,000) | C 7270 JT 3703.35 24/04/18 OTC    | April 24, 2018 | (775,940)   | (2,687,310) | (1,911,370) |
| JPY | (100,000) | C 7270 JT 3754.8665 26/04/18 OTC  | April 26, 2018 | (869,180)   | (1,808,078) | (938,898)   |
| JPY | (90,000)  | C 7270 JT 3795.75 16/04/18 OTC    | April 16, 2018 | (618,165)   | (504,836)   | 113,329     |
| JPY | (90,000)  | C 7270 JT 3853.0512 13/04/18 OTC  | April 13, 2018 | (621,576)   | (155,540)   | 466,036     |
| JPY | (55,000)  | C 7751 JT 4005.74 23/04/18 OTC    | April 23, 2018 | (581,966)   | (1,572,897) | (990,931)   |
| JPY | (65,000)  | C 7751 JT 4084.922 24/04/18 OTC   | April 24, 2018 | (576,127)   | (975,479)   | (399,352)   |

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 | (90,000)  | C 7751 JT 4156.3788 17/04/18 OTC | April 17, 2018 | (1,083,762) | (345,536)   | 738,226     |
| JPY | (160,000) | C 8001 JT 2048.3234 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (1,102,944) | (7,952,883) | (6,849,939) |
| JPY | (160,000) | C 8001 JT 2086.506 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (1,027,200) | (4,653,317) | (3,626,117) |
| JPY | (180,000) | C 8001 JT 2094.3734 12/04/18 OTC | April 12, 2018 | (924,678)   | (3,699,270) | (2,774,592) |
| JPY | (170,000) | C 8001 JT 2112.7614 16/04/18 OTC | April 16, 2018 | (957,780)   | (3,261,921) | (2,304,141) |
| JPY | (170,000) | C 8001 JT 2132.55 26/04/18 OTC   | April 26, 2018 | (932,229)   | (3,751,283) | (2,819,054) |
| JPY | (160,000) | C 8001 JT 2209.1088 27/04/18 OTC | April 27, 2018 | (720,000)   | (1,304,226) | (584,226)   |
| JPY | (120,000) | C 8031 JT 1850.7305 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (960,960)   | (3,009,782) | (2,048,822) |
| JPY | (130,000) | C 8031 JT 1936.44 27/04/18 OTC   | April 27, 2018 | (722,579)   | (1,187,337) | (464,758)   |
| JPY | (130,000) | C 8031 JT 1975.84 09/04/18 OTC   | April 09, 2018 | (726,960)   | (46,345)    | 680,615     |
| JPY | (160,000) | C 8031 JT 1995.6431 13/04/18 OTC | April 13, 2018 | (566,992)   | (88,554)    | 478,438     |
| JPY | (200,000) | C 8053 JT 1855.8582 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (1,979,580) | (2,053,588) | (74,008)    |
| JPY | (150,000) | C 8053 JT 1869.525 16/04/18 OTC  | April 16, 2018 | (827,940)   | (892,652)   | (64,712)    |
| JPY | (180,000) | C 8053 JT 1871.3189 27/04/18 OTC | April 27, 2018 | (1,372,302) | (2,052,063) | (679,761)   |
| JPY | (110,000) | C 8058 JT 3003.8925 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (1,038,488) | (1,413,550) | (375,062)   |
| JPY | (120,000) | C 8058 JT 3020.4288 17/04/18 OTC | April 17, 2018 | (1,139,136) | (1,009,020) | 130,116     |
| JPY | (110,000) | C 8058 JT 3035.5471 23/04/18 OTC | April 23, 2018 | (985,831)   | (1,191,523) | (205,692)   |
| JPY | (120,000) | C 8058 JT 3045.1441 25/04/18 OTC | April 25, 2018 | (642,864)   | (1,315,723) | (672,859)   |
| JPY | (90,000)  | C 8058 JT 3117.98 13/04/18 OTC   | April 13, 2018 | (734,328)   | (97,785)    | 636,543     |
| JPY | (110,000) | C 8058 JT 3152.6292 16/04/18 OTC | April 16, 2018 | (421,333)   | (116,075)   | 305,258     |
| JPY | (500,000) | C 8306 JT 742.245 13/04/18 OTC   | April 13, 2018 | (1,201,750) | (731,500)   | 470,250     |
| JPY | (500,000) | C 8306 JT 744.3289 17/04/18 OTC  | April 17, 2018 | (1,098,750) | (988,600)   | 110,150     |
| JPY | (500,000) | C 8306 JT 745.2 24/04/18 OTC     | April 24, 2018 | (552,000)   | (1,558,625) | (1,006,625) |
| JPY | (500,000) | C 8306 JT 746.346 23/04/18 OTC   | April 23, 2018 | (739,300)   | (1,396,400) | (657,100)   |
| JPY | (450,000) | C 8306 JT 747.3 20/04/18 OTC     | April 20, 2018 | (856,575)   | (978,507)   | (121,932)   |
| JPY | (500,000) | C 8306 JT 747.468 27/04/18 OTC   | April 27, 2018 | (795,900)   | (1,660,020) | (864,120)   |
| JPY | (126,000) | C 8316 JT 4665.06 26/04/18 OTC   | April 26, 2018 | (2,051,746) | (5,064,105) | (3,012,359) |
| JPY | (75,000)  | C 8316 JT 4745.62 23/04/18 OTC   | April 23, 2018 | (906,592)   | (1,568,773) | (662,181)   |
| JPY | (80,000)  | C 8316 JT 4750.8 24/04/18 OTC    | April 24, 2018 | (745,920)   | (1,708,136) | (962,216)   |
| JPY | (80,000)  | C 8316 JT 4767.2117 27/04/18 OTC | April 27, 2018 | (706,256)   | (1,790,190) | (1,083,934) |
| JPY | (80,000)  | C 8316 JT 4770.15 13/04/18 OTC   | April 13, 2018 | (835,912)   | (568,334)   | 267,578     |
| JPY | (80,000)  | C 8316 JT 4805.0378 25/04/18 OTC | April 25, 2018 | (747,448)   | (1,248,678) | (501,230)   |
| JPY | (70,000)  | C 8316 JT 4848.44 11/04/18 OTC   | April 11, 2018 | (416,234)   | (145,145)   | 271,089     |
| JPY | (75,000)  | C 8316 JT 5002.01 05/04/18 OTC   | April 05, 2018 | (550,680)   | (518)       | 550,162     |
| JPY | (75,000)  | C 8316 JT 5130.63 03/04/18 OTC   | April 03, 2018 | (388,327)   | (1)         | 388,326     |
| JPY | (150,000) | C 8591 JT 2004.5018 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (680,775)   | (1,230,438) | (549,663)   |
| JPY | (160,000) | C 8591 JT 2011.7013 05/04/18 OTC | April 05, 2018 | (531,536)   | (81,678)    | 449,858     |
| JPY | (130,000) | C 8591 JT 2019.3962 13/04/18 OTC | April 13, 2018 | (368,017)   | (394,239)   | (26,222)    |
| JPY | (140,000) | C 8591 JT 2040.3609 25/04/18 OTC | April 25, 2018 | (524,132)   | (904,680)   | (380,548)   |
| JPY | (80,000)  | C 8725 JT 3484.7679 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (1,141,680) | (1,769,210) | (627,530)   |
| JPY | (85,000)  | C 8725 JT 3520.2195 12/04/18 OTC | April 12, 2018 | (427,456)   | (663,689)   | (236,233)   |
| JPY | (65,000)  | C 8766 JT 5099.3356 26/04/18 OTC | April 26, 2018 | (1,084,206) | (2,291,566) | (1,207,360) |
| JPY | (70,000)  | C 8766 JT 5136.1792 25/04/18 OTC | April 25, 2018 | (932,120)   | (1,934,060) | (1,001,940) |
| JPY | (65,000)  | C 8766 JT 5200.0656 12/04/18 OTC | April 12, 2018 | (997,919)   | (333,237)   | 664,682     |
| JPY | (70,000)  | C 8766 JT 5217.48 24/04/18 OTC   | April 24, 2018 | (743,974)   | (1,148,405) | (404,431)   |
| JPY | (65,000)  | C 8766 JT 5222.62 16/04/18 OTC   | April 16, 2018 | (736,586)   | (497,359)   | 239,227     |
| JPY | (70,000)  | C 8766 JT 5344.92 23/04/18 OTC   | April 23, 2018 | (727,503)   | (478,746)   | 248,757     |
| JPY | (60,000)  | C 9201 JT 4376.4 26/04/18 OTC    | April 26, 2018 | (875,280)   | (4,144,270) | (3,268,990) |
| JPY | (70,000)  | C 9432 JT 5082 26/04/18 OTC      | April 26, 2018 | (948,640)   | (3,516,555) | (2,567,915) |
| JPY | (80,000)  | C 9432 JT 5133.45 27/04/18 OTC   | April 27, 2018 | (899,576)   | (3,100,101) | (2,200,525) |
| JPY | (65,000)  | C 9432 JT 5181.28 24/04/18 OTC   | April 24, 2018 | (603,668)   | (1,639,914) | (1,036,246) |

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 | (70,000)  | C 9432 JT 5192.0717 23/04/18 OTC | April 23, 2018 | (908,614)            | (1,556,262)          | (647,648)            |
| JPY | (70,000)  | C 9432 JT 5261.2422 20/04/18 OTC | April 20, 2018 | (1,227,625)          | (753,604)            | 474,021              |
| JPY | (150,000) | C 9433 JT 2828.5943 13/04/18 OTC | April 13, 2018 | (1,360,920)          | (1,691,799)          | (330,879)            |
| JPY | (130,000) | C 9433 JT 2888.2253 16/04/18 OTC | April 16, 2018 | (385,996)            | (792,046)            | (406,050)            |
| JPY | (120,000) | C 9437 JT 2805.92 26/04/18 OTC   | April 26, 2018 | (809,400)            | (2,324,018)          | (1,514,618)          |
| JPY | (130,000) | C 9437 JT 2828.072 09/04/18 OTC  | April 09, 2018 | (813,072)            | (418,237)            | 394,835              |
| JPY | (120,000) | C 9437 JT 2840.5422 17/04/18 OTC | April 17, 2018 | (551,880)            | (841,916)            | (290,036)            |
| JPY | (120,000) | C 9437 JT 2849.0685 10/04/18 OTC | April 10, 2018 | (525,984)            | (283,596)            | 242,388              |
| JPY | (150,000) | C 9437 JT 2871.0331 12/04/18 OTC | April 12, 2018 | (1,066,380)          | (309,545)            | 756,835              |
| JPY | (120,000) | C 9437 JT 2876.576 23/04/18 OTC  | April 23, 2018 | (531,060)            | (764,039)            | (232,979)            |
| JPY | (120,000) | C 9437 JT 2877.525 24/04/18 OTC  | April 24, 2018 | (328,860)            | (808,097)            | (479,237)            |
| JPY | (130,000) | C 9437 JT 2883.4 20/04/18 OTC    | April 20, 2018 | (684,814)            | (581,291)            | 103,523              |
| JPY | (330,000) | C 9831 JT 671.84 23/04/18 OTC    | April 23, 2018 | (426,360)            | (1,721,402)          | (1,295,042)          |
| JPY | (320,000) | C 9831 JT 682.1134 20/04/18 OTC  | April 20, 2018 | (545,696)            | (872,483)            | (326,787)            |
| JPY | (330,000) | C 9831 JT 685.36 24/04/18 OTC    | April 24, 2018 | (456,687)            | (980,922)            | (524,235)            |
| JPY | (350,000) | C 9831 JT 712.6609 03/04/18 OTC  | April 03, 2018 | (455,700)            | (84)                 | 455,616              |
| JPY | (380,000) | C 9831 JT 716.1 17/04/18 OTC     | April 17, 2018 | (621,984)            | (93,096)             | 528,888              |
| JPY | (400,000) | C 9831 JT 721.2407 11/04/18 OTC  | April 11, 2018 | (577,000)            | (14,436)             | 562,564              |
|     |           |                                  |                | (132,995,314)        | (237,223,712)        | (104,228,398)        |
|     |           |                                  |                | <b>(132,995,314)</b> | <b>(237,223,712)</b> | <b>(104,228,398)</b> |

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日2018年8月20日）

作成対象期間（2017年8月22日～2018年8月20日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | 本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。                          |
| 主な投資制限 | 株式への投資は行いません。                                      |

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>



## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額        | 騰落率 |          | 債組入比率     | 債券先物比率 | 純総資産額        |
|-----------------|-------------|-----|----------|-----------|--------|--------------|
|                 |             | 期騰  | 中率       |           |        |              |
| 12期(2014年8月19日) | 円<br>10,199 |     | %<br>0.1 | %<br>59.7 | %<br>— | 百万円<br>8,648 |
| 13期(2015年8月19日) | 10,206      |     | 0.1      | 44.7      | —      | 22,034       |
| 14期(2016年8月19日) | 10,211      |     | 0.0      | 68.6      | —      | 19,722       |
| 15期(2017年8月21日) | 10,208      |     | △0.0     | 64.0      | —      | 17,754       |
| 16期(2018年8月20日) | 10,206      |     | △0.0     | 38.7      | —      | 13,511       |

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

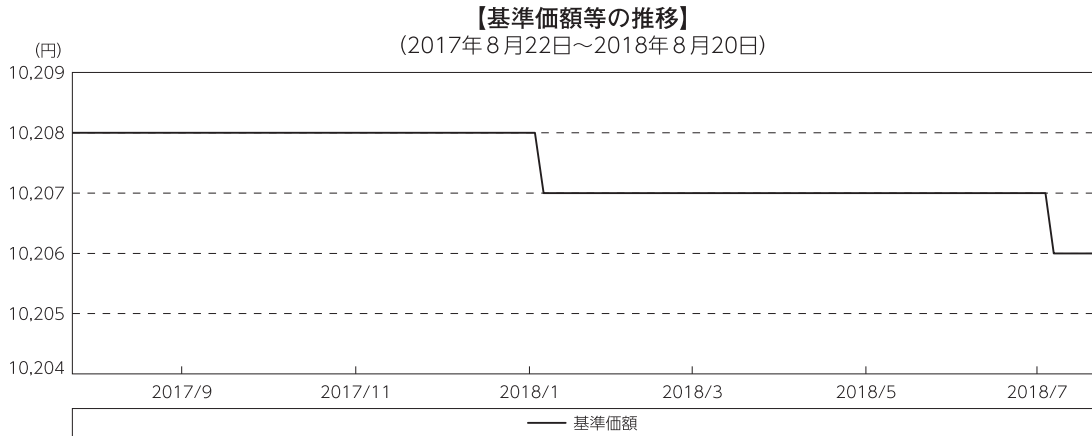
| 年月日                | 基準価額        | 騰落率 |        | 債組入比率     | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|
|                    |             | 騰   | 落率     |           |        |
| (期首)<br>2017年8月21日 | 円<br>10,208 |     | %<br>— | %<br>64.0 | %<br>— |
| 8月末                | 10,208      |     | 0.0    | 56.6      | —      |
| 9月末                | 10,208      |     | 0.0    | 63.9      | —      |
| 10月末               | 10,208      |     | 0.0    | 51.7      | —      |
| 11月末               | 10,208      |     | 0.0    | 66.0      | —      |
| 12月末               | 10,208      |     | 0.0    | 51.5      | —      |
| 2018年1月末           | 10,208      |     | 0.0    | 46.2      | —      |
| 2月末                | 10,207      |     | △0.0   | 55.1      | —      |
| 3月末                | 10,207      |     | △0.0   | 45.2      | —      |
| 4月末                | 10,207      |     | △0.0   | 46.3      | —      |
| 5月末                | 10,207      |     | △0.0   | 40.7      | —      |
| 6月末                | 10,207      |     | △0.0   | 24.4      | —      |
| 7月末                | 10,207      |     | △0.0   | 35.3      | —      |
| (期末)<br>2018年8月20日 | 10,206      |     | △0.0   | 38.7      | —      |

\*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



### ○基準価額の主な変動要因

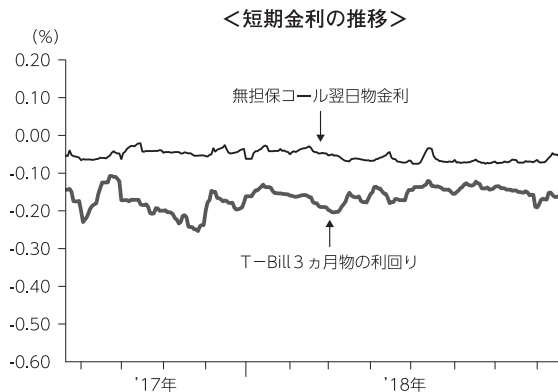
投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

## ○投資環境

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

このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2018年7月には金融緩和の持続性を高める観点から、政策金利の「フォワードガイダンス」追加、長期金利目標の柔軟化等の「強力な金融緩和継続のための枠組み強化」を導入しました。

マイナス金利政策のもと、無担保コール翌日物金利は-0.05%程度、T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは概ね-0.1%台で推移しました。



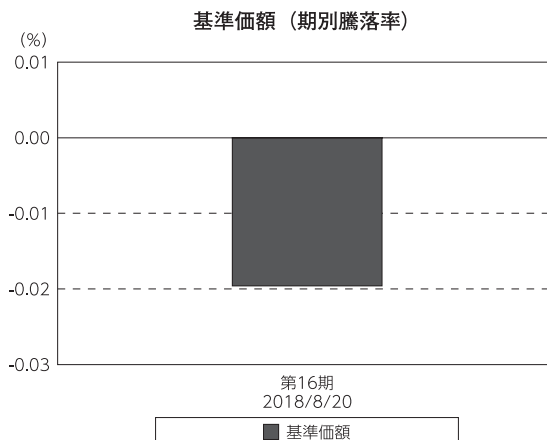
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年8月22日～2018年8月20日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2017年8月22日～2018年8月20日)

### 公社債

|   |                | 買付額        | 売付額               |
|---|----------------|------------|-------------------|
|   |                | 千円         | 千円                |
| 国 | 国債証券           | 690,234    | 690,233           |
|   | 地方債証券          | 3,695,131  | —<br>(7,082,100)  |
| 内 | 特殊債券           | 13,257,967 | —<br>(13,445,000) |
|   | 社債券（投資法人債券を含む） | 7,946,048  | —<br>(10,449,000) |

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

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

### その他有価証券

|   |             | 買付額        | 売付額               |
|---|-------------|------------|-------------------|
|   |             | 千円         | 千円                |
| 内 | コマーシャル・ペーパー | 22,599,981 | —<br>(19,100,000) |

\*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

(2017年8月22日～2018年8月20日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     |           | 百万円                | 百万円           |           | 百万円                | 百万円           |
| 公社債 | 24,899    | 1,719              | 6.9           | —         | —                  | —             |

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

## ○組入資産の明細

(2018年8月20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         |             |         | 未                   |           |      |        |
|---------------------|-------------|-------------|---------|---------------------|-----------|------|--------|
|                     | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 組 入 比 率 | うちB B格以下<br>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               | 622,000     | 624,351     | 4.6     | —                   | —         | —    | 4.6    |
|                     | ( 622,000)  | ( 624,351)  | ( 4.6)  | (—)                 | (—)       | (—)  | ( 4.6) |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 1,340,000   | 1,342,467   | 9.9     | —                   | —         | —    | 9.9    |
|                     | (1,340,000) | (1,342,467) | ( 9.9)  | (—)                 | (—)       | (—)  | ( 9.9) |
| 金融債券                | 1,750,000   | 1,751,319   | 13.0    | —                   | —         | —    | 13.0   |
|                     | (1,750,000) | (1,751,319) | (13.0)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (13.0) |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 1,500,000   | 1,505,675   | 11.1    | —                   | —         | —    | 11.1   |
|                     | (1,500,000) | (1,505,675) | (11.1)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (11.1) |
| 合 計                 | 5,212,000   | 5,223,813   | 38.7    | —                   | —         | —    | 38.7   |
|                     | (5,212,000) | (5,223,813) | (38.7)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (38.7) |

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社よりデータを入手しています。

\* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄                          | 利 率   | 当 期 末     |           |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|
|                             |       | 額 面 金 額   | 評 価 額     |
| <b>地方債証券</b>                | %     | 千円        | 千円        |
| 神奈川県 公募第158回                | 1.53  | 30,000    | 30,150    |
| 大阪府 公募第322回                 | 1.62  | 252,000   | 253,785   |
| 大阪府 公募(5年)第100回             | 0.244 | 300,000   | 300,210   |
| 横浜市 公募公債平成20年度5回            | 1.58  | 40,000    | 40,205    |
| 小 計                         |       | 622,000   | 624,351   |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>          |       |           |           |
| 地方公営企業等金融機構債券 政府保証第1回       | 1.6   | 110,000   | 110,259   |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第44回 | 1.62  | 130,000   | 130,696   |
| 地方公共団体金融機構債券 F39回           | 0.808 | 100,000   | 100,026   |
| 中日本高速道路債券 財投機関債第5回          | 1.86  | 1,000,000 | 1,001,484 |
| 小 計                         |       | 1,340,000 | 1,342,467 |
| <b>金融債券</b>                 |       |           |           |
| 農林債券 利付第762回い号              | 0.3   | 700,000   | 700,563   |
| しんきん中金債券 利付第287回            | 0.3   | 450,000   | 450,266   |
| しんきん中金債券 利付第288回            | 0.3   | 600,000   | 600,489   |
| 小 計                         |       | 1,750,000 | 1,751,319 |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>      |       |           |           |
| 関西電力 第469回                  | 1.7   | 300,000   | 300,916   |
| トヨタ自動車 第8回社債間限定同等特約付        | 2.01  | 100,000   | 100,664   |
| みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付     | 0.285 | 200,000   | 200,244   |
| 住友不動産 第91回社債間限定同順位特約付       | 0.355 | 100,000   | 100,065   |
| N T T ドコモ 第17回社債間限定同順位特約付   | 1.77  | 200,000   | 200,305   |
| N T T データ 第22回社債間限定同順位特約付   | 1.78  | 600,000   | 603,478   |
| 小 計                         |       | 1,500,000 | 1,505,675 |
| 合 計                         |       | 5,212,000 | 5,223,813 |

\*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<br>4,399,994 | %<br>32.6 |

\*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

(2018年8月20日現在)

| 項 目          | 当 期 末           |           |
|--------------|-----------------|-----------|
|              | 評 価 額           | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>5,223,813 | %<br>38.7 |
| その他有価証券      | 4,399,994       | 32.6      |
| コール・ローン等、その他 | 3,887,777       | 28.7      |
| 投資信託財産総額     | 13,511,584      | 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 (2018年8月20日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 13,511,584,519  |
| コール・ローン等        | 3,870,450,958   |
| 公社債(評価額)        | 5,223,813,703   |
| その他有価証券         | 4,399,994,713   |
| 未収利息            | 7,275,528       |
| 前払費用            | 10,049,617      |
| (B) 負債          | 7,765           |
| 未払利息            | 7,765           |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 13,511,576,754  |
| 元本              | 13,238,234,160  |
| 次期繰越損益金         | 273,342,594     |
| (D) 受益権総口数      | 13,238,234,160口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,206円         |

(注) 期首元本額は17,392,173,897円、期中追加設定元本額は3,349,850,829円、期中一部解約元本額は7,503,790,566円、1口当たり純資産額は1.0206円です。

## ○損益の状況 (2017年8月22日～2018年8月20日)

| 項目             | 当期            |
|----------------|---------------|
|                | 円             |
| (A) 配当等収益      | 61,118,125    |
| 受取利息           | 63,841,658    |
| 支払利息           | △ 2,723,533   |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 63,824,623  |
| 売買損            | △ 63,824,623  |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 2,706,498   |
| (D) 前期繰越損益金    | 361,951,541   |
| (E) 追加信託差損益金   | 69,639,721    |
| (F) 解約差損益金     | △ 155,542,170 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 273,342,594   |
| 次期繰越損益金(G)     | 273,342,594   |

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

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

\*損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                  | 当期末<br>元本額    |
|--|---------------|
|  | 円             |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用) | 5,423,785,404 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家専ら制限付) | 3,324,627,145 |
| 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) | 3,161,244,481 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用) | 389,222,673   |
| 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          | 184,452,030   |
| 野村世界高金利通貨投信                            | 151,953,753   |
| 野村日経225 ショート・ファンド(適格機関投資家専用)           | 120,493,731   |
| 野村DC運用戦略ファンド                           | 85,180,134    |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)              | 68,081,734    |
| 野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)                    | 49,354,623    |
| 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      | 21,108,661    |
| ネクストコア                                 | 19,922,154    |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)             | 15,498,603    |
| 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  | 13,341,293    |
| 野村新中国株投資 マネーボール・ファンド                   | 12,802,829    |
| 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        | 11,360,223    |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                     | 7,492,405     |
| 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      | 6,950,162     |
| 第12回 野村短期公社債ファンド                       | 6,664,982     |
| 第9回 野村短期公社債ファンド                        | 5,094,831     |
| 野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド               | 5,061,963     |
| 第2回 野村短期公社債ファンド                        | 3,919,169     |
| 野村グローバルCB投信(マネーボールファンド)年2回決算型          | 3,907,760     |
| 野村ビクテ・ヘルスケア マネーボール・ファンド                | 3,546,551     |

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額 |
|---------------------------------------|------------|
|                                       | 円          |
| 第1回 野村短期公社債ファンド                       | 3,037,421  |
| 米国変動好金利ファンド Aコース                      | 2,952,997  |
| 第5回 野村短期公社債ファンド                       | 1,959,729  |
| 第10回 野村短期公社債ファンド                      | 1,959,728  |
| 第11回 野村短期公社債ファンド                      | 1,861,757  |
| 第3回 野村短期公社債ファンド                       | 1,371,897  |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型 | 1,230,043  |
| 第4回 野村短期公社債ファンド                       | 1,077,981  |
| 第6回 野村短期公社債ファンド                       | 1,077,981  |
| 野村・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド            | 1,019,915  |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型        | 984,834    |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型    | 984,834    |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型    | 984,834    |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型       | 984,834    |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型   | 984,834    |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型   | 984,834    |
| 野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型                | 984,543    |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型            | 984,543    |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型            | 984,543    |
| 野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型               | 984,543    |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型           | 984,543    |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型           | 984,543    |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型        | 984,252    |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型      | 984,252    |

| ファンド名                                  | 当期末     |
|--|---------|
|  | 元本額     |
|  | 円       |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型  | 984,252 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース) 年2回決算型       | 984,252 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース) 年2回決算型     | 984,252 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型 | 984,252 |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型            | 983,768 |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型            | 983,768 |
| 野村米国ブランド株投資(円コース) 年2回決算型               | 983,768 |
| 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           | 983,768 |
| 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           | 983,768 |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 毎月分配型              | 983,672 |
| 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          | 983,672 |
| 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          | 983,672 |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 年2回決算型             | 983,672 |
| 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         | 983,672 |
| 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         | 983,672 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース                | 983,381 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース                | 983,381 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース                | 983,381 |
| 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           | 983,091 |
| 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      | 983,091 |
| 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          | 983,091 |
| 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     | 983,091 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型           | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型      | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型   | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース) 年2回決算型          | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型     | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース) 年2回決算型  | 982,898 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム 毎月分配型                 | 982,801 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)            | 982,609 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)               | 982,609 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)             | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(円コース) 毎月分配型                | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型            | 982,609 |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型            | 982,609 |
| 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           | 982,609 |
| 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           | 982,609 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型       | 982,609 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型   | 982,608 |
| 野村新世界高金利通貨投資                           | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型            | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース) 毎月分配型          | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型      | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型     | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース) 毎月分配型        | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース) 年2回決算型         | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型     | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(豪ドルコース) 毎月分配型              | 982,608 |
| 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          | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(円コース) 年2回決算型               | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(豪ドルコース) 年2回決算型             | 982,608 |
| 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         | 982,608 |
| 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           | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型           | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース) 毎月分配型         | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型     | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型    | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース) 毎月分配型       | 982,608 |

| ファンド名                               | 当期末     |
|-------------------------------------|---------|
|                                     | 元本額     |
|                                     | 円       |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型 | 982,608 |
| 野村PMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース       | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投資(円コース) 毎月分配型           | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型     | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース) 毎月分配型   | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投資(円コース) 年2回決算型          | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型    | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投資(中国元コース) 年2回決算型        | 982,608 |
| 野村アジアCB投資(毎月分配型)                    | 982,608 |
| 野村PMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース) 毎月分配型 | 982,608 |
| 野村グローバルREITプレミアム(円コース) 毎月分配型        | 982,608 |
| 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   | 982,608 |
| 野村グローバルREITプレミアム(円コース) 年2回決算型       | 982,608 |
| 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  | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(トルコリラコース) 毎月分配型         | 982,607 |
| 野村新エマージング債券投資(豪ドルコース) 毎月分配型         | 982,607 |
| 野村新エマージング債券投資(中国元コース) 毎月分配型         | 982,607 |
| 野村PMCO新興国インフラ関連債券投資(円コース) 毎月分配型     | 982,607 |
| 野村PMCO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース) 毎月分配型 | 982,607 |
| 野村日本高配当株プレミアム(円コース) 毎月分配型           | 982,415 |
| 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      | 982,415 |
| 野村日本高配当株プレミアム(円コース) 年2回決算型          | 982,415 |
| 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     | 982,415 |
| 野村高配当インフラ関連株投資(円コース) 毎月分配型          | 982,029 |
| 野村高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型     | 982,029 |
| 野村高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース) 年2回決算型       | 982,029 |
| 野村高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型    | 982,029 |
| 野村カルミニャック・ファンド Aコース                 | 981,547 |
| 野村カルミニャック・ファンド Bコース                 | 981,547 |
| 野村通貨選択日本株投資(米ドルコース) 毎月分配型           | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型       | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型        | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投資(米ドルコース) 年2回決算型          | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型       | 981,451 |
| 野村エマージング債券プレミアム 毎月分配型               | 981,451 |
| 野村エマージング債券プレミアム 年2回決算型              | 981,451 |
| ノムラ THE USA Aコース                    | 981,258 |
| ノムラ THE USA Bコース                    | 981,258 |
| 米国変動好金利ファンド Bコース                    | 981,066 |
| 野村グローバルボンド投資 Bコース                   | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投資 Dコース                   | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投資 Fコース                   | 980,489 |
| 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      | 980,297 |
| 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   | 980,297 |
| 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     | 980,297 |
| ノムラ THE ASIA Bコース                   | 979,912 |
| グローバル・ストック Bコース                     | 979,528 |
| グローバル・ストック Dコース                     | 979,528 |
| 第7回 野村短期公社債ファンド                     | 686,093 |
| 野村通貨選択日本株投資(インドルビーコース) 毎月分配型        | 568,479 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム 年2回決算型             | 491,401 |
| 野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース) 毎月分配型           | 457,265 |
| 野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース) 年2回決算型          | 434,099 |
| 野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型      | 406,687 |
| 野村通貨選択日本株投資(インドルビーコース) 年2回決算型       | 220,902 |
| 野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース) 毎月分配型         | 123,377 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型   | 98,262  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース) 毎月分配型       | 98,261  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース) 毎月分配型       | 98,261  |



| ファンド名                                | 当期末    |
|--------------------------------------|--------|
|                                      | 元本額    |
|                                      | 円      |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型          | 98,261 |
| 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        | 98,261 |
| 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      | 98,261 |
| 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        | 98,261 |
| 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         | 98,261 |
| 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  | 98,261 |
| 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          | 98,261 |
| 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      | 98,261 |
| 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          | 98,261 |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアピアコース)年2回決算型     | 98,261 |
| 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     | 98,261 |
| 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    | 98,261 |
| 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     | 98,261 |
| 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 | 98,261 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 98,261 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型             | 98,261 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース              | 98,261 |
| 野村ドイチェ・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 | 98,261 |
| 第8回 野村短期社債ファンド                       | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型   | 98,260 |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型       | 98,260 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型       | 98,260 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型     | 98,260 |
| 野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース       | 98,260 |
| 野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型          | 98,260 |
| ノムラ THE EUROPE Aコース                  | 98,117 |
| ノムラ THE EUROPE Bコース                  | 98,117 |
| 野村グローバルボンド投信 Aコース                    | 98,049 |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース                    | 98,049 |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース                    | 98,049 |
| ノムラ THE ASIA Aコース                    | 97,992 |
| グローバル・ストック Aコース                      | 97,953 |
| グローバル・ストック Cコース                      | 97,953 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアピアコース)毎月分配型        | 80,956 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型             | 58,906 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型            | 57,201 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型          | 52,622 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型         | 48,092 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアピアコース)年2回決算型       | 36,702 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型        | 13,741 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA1向け)               | 10,000 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型        | 9,826  |

| ファンド名                                    | 当期末   |
|--|-------|
|  | 元本額   |
|  | 円     |
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型         | 9,826 |
| 野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース                | 9,818 |
| 野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース                | 9,818 |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型                 | 9,809 |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型              | 9,809 |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型                | 9,809 |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型             | 9,809 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型            | 9,808 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型           | 9,808 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型          | 9,808 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型         | 9,808 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型                 | 9,807 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型                | 9,807 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型        | 9,807 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型       | 9,807 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型            | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型         | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型           | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型        | 9,805 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型              | 9,803 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型             | 9,803 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型        | 9,803 |
| 野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型           | 9,803 |
| ビムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)                   | 9,803 |
| ビムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)                 | 9,803 |
| ビムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)              | 9,803 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)                 | 9,801 |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)         | 9,801 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型      | 9,797 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型     | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース                  | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース                  | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース                  | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース                  | 9,797 |
| 野村ファンドラップ債券プレミア                          | 9,795 |
| 野村ファンドラップオルタナティブプレミア                     | 9,795 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)      | 9,794 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)      | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型                | 4,908 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型                 | 1,963 |

## ○お知らせ

該当事項はございません。

### <お申し込み時の留意点>

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

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

(2019年5月22日現在)

| 年 月     | 日        |
|---------|----------|
| 2019年5月 | 27、30    |
| 6月      | 10       |
| 7月      | 4        |
| 8月      | 15、26    |
| 9月      | 2        |
| 10月     | －        |
| 11月     | 1、11、28  |
| 12月     | 24、25、26 |

※ 2019年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

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

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