

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23期(決算日2023年11月22日)

作成対象期間(2023年5月23日~2023年11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2027年5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	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。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村日本高配当株 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。 外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
	毎決算時に、原則として、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せん。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 配 分	騰 落 率				
19期(2021年11月22日)	円 20,091	円 10	% 4.2	% 0.0	% -	% 98.9	百万円 1,778
20期(2022年5月23日)	19,953	10	△ 0.6	0.0	-	98.8	1,668
21期(2022年11月22日)	21,114	10	5.9	0.0	-	98.9	1,879
22期(2023年5月22日)	23,531	10	11.5	0.0	-	98.7	2,196
23期(2023年11月22日)	26,892	10	14.3	0.0	-	98.2	2,672

*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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	率			
(期 首) 2023年5月22日	円 23,531	% -	% 0.0	% -	% 98.7	
5月末	23,680	0.6	0.0	-	98.3	
6月末	25,099	6.7	0.0	-	98.5	
7月末	25,318	7.6	0.0	-	99.1	
8月末	26,067	10.8	0.0	-	98.9	
9月末	27,033	14.9	0.0	-	98.8	
10月末	25,759	9.5	0.0	-	98.9	
(期 末) 2023年11月22日	26,902	14.3	0.0	-	98.2	

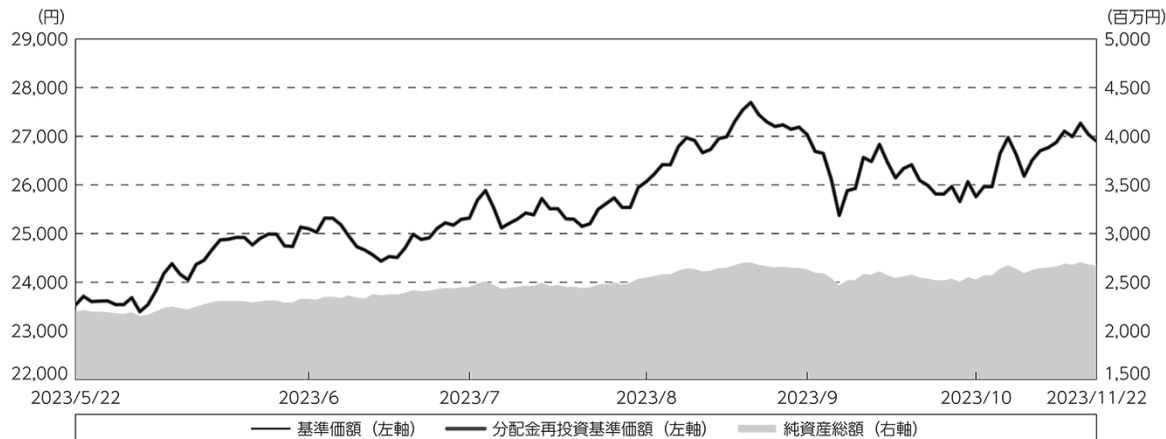
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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（2023年5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上昇要因となり、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上昇しました。

(当作成期首～2023年9月中旬)

- (上 昇) 金融引き締めによる景気後退が懸念される欧米に対して、日本は日銀の金融政策により緩和的な金融環境が維持される可能性が高いことや、国内景気は個人消費やインバウンド（訪日外国人）需要の回復への期待感が高まるなか相対的に良好な見通しであること、東京証券取引所が上場企業に対し資本コストや株価を意識した経営改革を要請していることなどを背景に、外国人投資家からの資金流入が続いたこと。
- (下 落) 米金融引き締め長期化への警戒感が強まったことや、日銀の金融緩和政策の修正観測が広まったこと。
- (上 昇) 6月の米CPI（消費者物価指数）の伸び率鈍化などを受けて米金融引き締め長期化への警戒感がやや弱まったことや、植田日銀総裁の発言を受けて金融緩和政策の修正観測が後退したこと。
- (上 昇) 日銀が金融政策決定会合で金融緩和政策の運用柔軟化を決定し一時的に金利上昇が警戒されたものの、日銀の緩和的な政策はなお続くとの見方が広まったこと。
- (下 落) 米主要経済指標の結果を受けて市場想定を上回る米経済の回復が示されたことなどを背景に、追加的な金融引き締めが必要との見方が広まったことや、米長期金利が上昇するなか金利の高止まりによる景気減速が警戒されたこと。
- (下 落) 中国の大手不動産会社の経営不安などを受けて、中国景気の先行き不透明感が強まったこと。
- (上 昇) 8月下旬のジャクソンホール会議におけるパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長の講演が概ね市場の想定内と受け止められたことや、8月の米雇用統計において賃金上昇率に鈍化の兆しが見られたことなどを背景に、米金融引き締めへの過度な警戒感が後退したこと。
- (上 昇) 日米金融政策の方向性の違いから日米金利差が意識されるなか円安（米ドル高）が進み、企業業績への期待感が高まったこと。

(2023年9月下旬～2023年10月下旬)

- (下 落) FOMC（米連邦公開市場委員会）後のパウエルFRB議長の会見などを受けて、米金融引き締め長期化への警戒感が高まったことや、暫定予算の成立が危ぶまれ米政府機関閉鎖への懸念が高まったこと。
- (下 落) 米国において、好調な経済指標を背景に長期金利が上昇するなか金融引き締め長期化への警戒感が高まったことや、日本において、10月末の日銀金融政策決定会合を控えて日銀の金融政策修正への警戒感が高まったこと。
- (下 落) 中東情勢の緊迫化を受けて投資家のリスク回避の動きが強まったこと。

（2023年11月上旬～当作成期末）

（上 昇）10月末の日銀金融政策決定会合の結果を受けて、日銀は金融緩和政策を継続し緩和政策の修正も小さいものにとどめるとの見方が広まったこと。

（上 昇）FRBが政策金利を据え置いたことや、一部米主要経済指標から米インフレに鈍化の兆しが見られたことなどから、米金融引き締め長期化への過度な警戒感が後退したこと。

○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		
組入比率	93.0%	<ul style="list-style-type: none"> ・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。
カバー率	41.3%	
平均行使価格	116.8%	
平均行使期間	43.6日	
配当利回り（年率）	2.8%	
プレミアム（年率）	0.3%	

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、電気機器12.8%、輸送用機器10.6%、化学8.9%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。

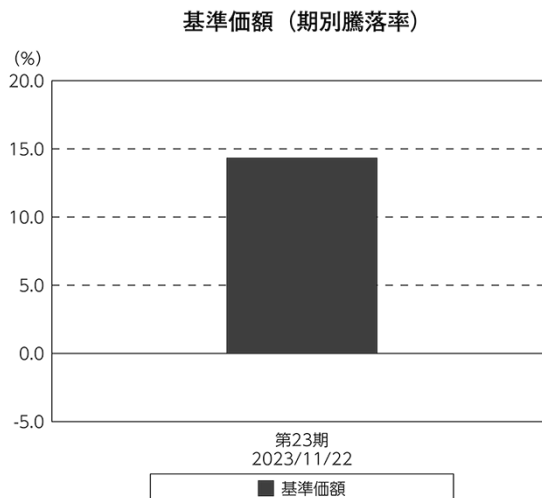
[野村マネー マザーファンド]

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23期
	2023年5月23日～ 2023年11月22日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.037%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	17,601

(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。高配当株からのインカムゲインに加えて、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、先行き不透明な市場環境であっても、株式プレミアムの安定的な収益化に努めて参ります。

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。

日銀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なか、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、よろしくお願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

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なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行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

（2023年5月23日～2023年11月22日）

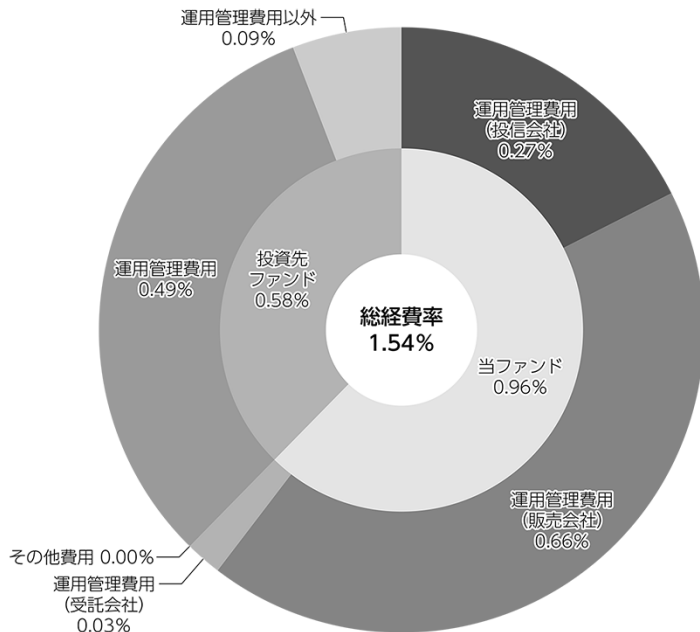
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 124	% 0.487	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	（ 35 ）	（ 0.138 ）	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	（ 85 ）	（ 0.332 ）	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	（ 4 ）	（ 0.017 ）	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(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	124	0.489	
期中の平均基準価額は、25,492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。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.54%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	1.54
①当ファンドの費用の比率	0.96
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.49
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社を知りうる情報をもとに作成しています。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年5月23日～2023年11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	17,831	295,785	7,567	125,185

*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

(2023年5月23日～2023年11月22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>

該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
公社債	百万円 1,534	百万円 17	% 1.1	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

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

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

○組入資産の明細

(2023年11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・ストック・エンハンスト・ファンド-日本円クラス	139,576	149,840	2,625,496	98.2
合計	139,576	149,840	2,625,496	98.2

*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 982	千口 982	千円 1,001

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年11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 2,625,496	% 97.7
野村マネー マザーファンド	1,001	0.0
コール・ローン等、その他	61,857	2.3
投資信託財産総額	2,688,354	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（2023年11月22日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,688,354,587
コール・ローン等	58,854,669
投資信託受益証券(評価額)	2,625,496,480
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,001,572
未収入金	3,001,866
(B) 負債	16,002,521
未払収益分配金	993,723
未払解約金	2,926,630
未払信託報酬	12,041,138
未払利息	43
その他未払費用	40,987
(C) 純資産総額(A-B)	2,672,352,066
元本	993,723,145
次期繰越損益金	1,678,628,921
(D) 受益権総口数	993,723,145口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,892円

(注) 期首元本額は933,577,333円、期中追加設定元本額は104,564,241円、期中一部解約元本額は44,418,429円、1口当たり純資産額は2.6892円です。

○損益の状況（2023年5月23日～2023年11月22日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	48,805,353
受取配当金	48,815,447
支払利息	△ 10,094
(B) 有価証券売買損益	280,196,877
売買益	286,787,695
売買損	△ 6,590,818
(C) 信託報酬等	△ 12,082,125
(D) 当期損益金(A+B+C)	316,920,105
(E) 前期繰越損益金	638,372,508
(F) 追加信託差損益金	724,330,031
(配当等相当額)	(794,799,623)
(売買損益相当額)	(△ 70,469,592)
(G) 計(D+E+F)	1,679,622,644
(H) 収益分配金	△ 993,723
次期繰越損益金(G+H)	1,678,628,921
追加信託差損益金	724,330,031
(配当等相当額)	(794,799,624)
(売買損益相当額)	(△ 70,469,593)
分配準備積立金	954,298,890

*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（2023年5月23日～2023年11月22日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年5月23日～ 2023年11月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	47,013,692円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	269,906,413円
c. 信託約款に定める収益調整金	794,799,624円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	638,372,508円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,750,092,237円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	17,611円
g. 分配金	993,723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。

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)

2023年3月31日決算
(計算期間:2022年4月1日～2023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な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 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

2023年3月31日に終了する計測期間
(円)

収益

銀行口座利息	72,212,386
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	1,204,071,173
収益合計	1,276,283,559

費用

投資顧問報酬	216,461,843
事務管理代行報酬	44,883,900
保管費用	13,507,005
取引銀行報酬	15,613,846
受託報酬	8,980,932
法務報酬	303,372
立替費用	4,190,397
専門家報酬	2,179,028
当座借越利息	1,810,690
雑費用	18,407,626
費用合計	326,338,639

純投資損益

純投資損益	949,944,920
投資有価証券売買に係る損益	1,839,219,587
オプション契約に係る損益	6,157,836
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	6,716,355,131

当期実現純損益

当期実現純損益	8,561,732,554
---------	---------------

投資有価証券評価差損益	603,754,305
オプション契約に係る評価差損益	(4,954,975)
外国為替先渡し契約に係る評価差損益	(1,501,843,475)

当期評価差損益

当期評価差損益	(903,044,145)
為替差額	11,013,801

運用の結果による純資産の増減額

運用の結果による純資産の増減額	8,619,647,130
-----------------	---------------

	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産
JPY Class Units (in JPY)	14,462	405,502	5,864,302,363
CRS Class Units (in JPY)	9,486	4,241,058	40,228,661,449

組入資産明細
2023年3月31日現在
(円)

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
	日本		
普通株			
338,000	NIPPON TELG & TEL CORP	1,339,156,000	2.90
703,000	TOYOTA MOTOR CORP	1,321,640,000	2.86
331,000	HONDA MOTOR CO LTD	1,161,810,000	2.52
1,310,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	1,110,749,000	2.41
255,000	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	1,090,125,000	2.37
263,000	mitsui & CO LTD	1,082,508,000	2.35
411,500	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	1,048,090,500	2.27
465,000	ORIX CORP	1,012,072,500	2.20
312,000	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	971,568,000	2.11
192,500	ASAHI GROUP HOLDINGS	947,870,000	2.06
493,000	ASTELLAS PHARMA INC	928,319,000	2.01
57,600	TOKYO ELECTRON LTD	923,904,000	2.00
165,900	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	878,938,200	1.91
94,300	DENSO CORP	701,874,900	1.52
72,700	MURATA MANUFACTURING CO LTD	584,508,000	1.27
348,000	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	549,318,000	1.19
113,500	MITSUBISHI CORP	539,238,500	1.17
72,000	TOYOTA INDUSTRIES CORP	529,200,000	1.15
149,500	KOMATSU LTD	489,911,500	1.06
373,000	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	481,543,000	1.04
139,000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	454,530,000	0.99
109,000	KDDI CORP	446,137,000	0.97
84,100	AGC INC	414,192,500	0.90
56,700	HITACHI LTD	411,188,400	0.89
256,500	ISUZU MOTORS LTD	405,013,500	0.88
117,300	mitsui CHEMICALS INC	399,993,000	0.87
277,500	INPEX CORP	387,667,500	0.84
438,000	CHIBA BANK LTD	374,490,000	0.81
77,700	TDK CORP	367,132,500	0.80
66,700	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	363,981,900	0.79
76,500	OTSUKA CORP	358,402,500	0.78
126,500	SOJITZ CORPORATION	349,519,500	0.76
88,500	MABUCHI MOTOR CO LTD	341,167,500	0.74
71,000	SUZUKI MOTOR CORP	341,084,000	0.74
214,000	NISSHIN SEIFUN GROUP INC	331,914,000	0.72
329,000	RICOH CO LTD	326,039,000	0.71
117,500	DENKA CO LTD	321,362,500	0.70

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
38,800	NIPPON EXPRESS H	309,236,000	0.67
82,400	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	305,292,000	0.66
235,000	CASIO COMPUTER CO LTD	305,030,000	0.66
242,500	AMADA CO LTD	300,215,000	0.65
65,400	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	296,981,400	0.64
185,000	KAJIMA CORP	295,630,000	0.64
90,800	BIPROGY INC	295,100,000	0.64
52,300	TOYOTA TSUSHO CORP	293,926,000	0.64
284,000	OBAYASHI CORP	287,692,000	0.62
65,500	ITOCHU CORP	281,715,500	0.61
247,000	SANTEN PHARM	279,110,000	0.61
63,700	COSMO ENERGY HD	272,954,500	0.59
112,500	KOEI TECMO HOLDI	268,650,000	0.58
57,500	DENTSU GROUP INC	267,375,000	0.58
177,500	RYOHIN KEIKAKU CO LTD	266,960,000	0.58
51,800	TOKYO SEIMITSU CO LTD	265,216,000	0.58
133,000	SUMCO CORP	263,473,000	0.57
413,000	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	261,016,000	0.57
15,100	HIROSE ELECTRIC	260,777,000	0.57
71,900	AZBIL CORP	259,559,000	0.56
22,200	SCREEN HOLDINGS CO LTD	258,630,000	0.56
80,000	MITSUI MINING & SMELTING CO LTD	257,200,000	0.56
127,500	BROTHER INDS LTD	253,980,000	0.55
33,000	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	253,770,000	0.55
178,000	ZEON CORPORATION	249,022,000	0.54
22,700	ROHM CO LTD	249,019,000	0.54
53,400	TAIYO YUDEN CO LTD	237,096,000	0.51
120,000	SG HOLDINGS CO L	235,200,000	0.51
25,200	NIPPON STEEL TRA	234,108,000	0.51
122,000	SEKISUI CHEM CO	228,872,000	0.50
111,500	PIGEON CORP	228,463,500	0.50
45,000	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	227,205,000	0.49
81,500	NICHIREI CORP	218,746,000	0.47
37,500	NIPPON SHINYAKU CO LTD	218,625,000	0.47
11,700	HIKARI TSUSHIN INC	217,269,000	0.47
75,900	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	216,201,150	0.47
69,000	JSR CORPORATION	214,935,000	0.47
96,000	SATO HOLDINGS CORP	210,144,000	0.46
91,500	USS CO LTD	209,992,500	0.46
68,500	AICA KOGYO CO	207,897,500	0.45
32,000	TREND MICRO INC	207,040,000	0.45
117,500	NGK INSULATORS LTD	205,860,000	0.45
272,000	SHIKOKU ELEC PWR	204,816,000	0.44
99,000	OSG CORPORATION	196,812,000	0.43

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
284,000	mitsubishi hc capital inc	194,256,000	0.42
159,000	anritsu corporation	194,139,000	0.42
125,000	toyota tire corp	193,125,000	0.42
254,000	kyushu elec pwr	192,278,000	0.42
70,500	inabata & co	189,433,500	0.41
36,500	sumitomo bakelit	188,340,000	0.41
78,000	gs yuasa corp	185,796,000	0.40
354,000	oji holdings corporation	185,496,000	0.40
25,400	fujimi inc	185,420,000	0.40
128,000	bellsystem24 holdings inc	184,832,000	0.40
44,700	eizo corp	183,046,500	0.40
24,000	abc-mart inc	175,680,000	0.38
107,000	t&d holdings inc	175,587,000	0.38
96,000	toyota seikan group holdings ltd	175,296,000	0.38
71,500	comsys holdings corp	174,674,500	0.38
121,000	sanwa holdings corp	171,336,000	0.37
86,000	scsk corp	166,410,000	0.36
172,000	senko group holdings	162,540,000	0.35
135,000	panasonic holdings	159,570,000	0.35
249,500	tokyu fudosan holdings corp	158,432,500	0.34
49,500	net one systems	156,667,500	0.34
61,500	taiyo holdings co ltd	153,750,000	0.33
52,000	inaba denkisangyo co ltd	150,280,000	0.33
83,300	star micronics co ltd	150,189,900	0.33
113,700	furukawa co	145,194,900	0.32
128,000	itochu enex co	144,512,000	0.31
58,500	dai-ichi life holdings inc	142,447,500	0.31
96,000	sanki engineering co ltd	140,544,000	0.30
36,700	nifco inc	137,625,000	0.30
67,000	marui group co ltd	135,541,000	0.29
61,000	kanamoto co ltd	132,919,000	0.29
55,000	meitec corporation	130,020,000	0.28
40,600	meiji holdings co ltd	128,093,000	0.28
52,000	nsd co ltd	123,968,000	0.27
112,000	sakata inx corp	115,920,000	0.25
37,700	kyowa kirin co ltd	108,802,200	0.24
20,500	kao corp	105,923,500	0.23
25,700	taisei corp	105,241,500	0.23
48,000	yokogawa bridge	103,872,000	0.23
31,500	izumi	99,067,500	0.21
18,300	noevir holding co ltd	98,820,000	0.21
41,000	exeo group inc	98,277,000	0.21
60,500	tokyo tatemono co ltd	97,707,500	0.21
29,500	itochu techno-solutions corp	96,022,500	0.21

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
102,500	KITZ CORP	95,120,000	0.21
176,000	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	85,888,000	0.19
25,000	NISSHIN OILLIO GRP	81,250,000	0.18
8,800	FUYO GENERAL LEASE	79,200,000	0.17
44,700	EIKEN CHEMICAL CO LTD	69,866,100	0.15
18,500	STARTS CORP INC	47,045,500	0.10
		<u>42,218,434,550</u>	<u>91.59</u>
	日本計	<u>42,218,434,550</u>	<u>91.59</u>
	組入資産合計	<u>42,218,434,550</u>	<u>91.59</u>

外国為替先渡し契約

2023年3月31日現在

通貨(買い)	通貨(売り)	満期日	未実現損益(円)
USD 38,371,740	JPY 4,945,000,000	April 05, 2023	159,549,515
MXN 319,500,000	USD 16,715,875	April 20, 2023	115,559,950
USD 33,488,886	JPY 4,350,000,000	April 12, 2023	99,938,514
BRL 91,700,000	USD 17,091,308	June 02, 2023	92,154,427
MXN 219,000,000	USD 11,410,588	April 05, 2023	90,239,022
MXN 225,000,000	USD 11,630,251	June 02, 2023	85,954,378
ZAR 266,000,000	USD 14,245,556	May 12, 2023	84,334,546
ZAR 267,000,000	USD 14,360,797	May 26, 2023	73,869,034
BRL 80,100,000	USD 15,183,107	April 20, 2023	64,712,719
BRL 79,700,000	USD 15,208,472	April 05, 2023	56,327,327
USD 37,948,523	JPY 4,945,000,000	June 07, 2023	56,269,208
PLN 50,300,000	USD 11,269,074	May 12, 2023	55,530,906
PLN 59,800,000	USD 13,477,978	May 26, 2023	53,572,525
BRL 73,000,000	USD 13,837,367	May 17, 2023	48,782,348
PLN 32,900,000	USD 7,354,429	April 28, 2023	39,442,239
USD 33,146,012	JPY 4,360,000,000	April 19, 2023	39,232,675
PLN 79,200,000	USD 18,207,223	April 13, 2023	30,270,383
ZAR 240,000,000	USD 13,240,058	April 28, 2023	26,903,751
MXN 418,500,000	USD 22,724,890	May 17, 2023	24,259,705
USD 37,553,478	JPY 4,930,000,000	May 31, 2023	24,077,704
BRL 83,700,000	USD 16,019,138	June 16, 2023	23,213,898
INR 1,007,500,000	USD 12,098,004	April 28, 2023	17,219,007
JPY 2,200,000,000	USD 16,520,713	May 11, 2023	14,749,238
MXN 269,000,000	USD 14,566,524	June 16, 2023	9,483,874
ZAR 33,000,000	USD 1,776,301	May 12, 2023	9,264,966
PLN 7,200,000	USD 1,614,565	April 28, 2023	7,954,636
MXN 50,000,000	USD 2,700,522	April 05, 2023	7,906,081

通貨(買い)		通貨(売り)		満期日	未実現損益(円)
INR	799,000,000	USD	9,634,329	May 26, 2023	6,228,071
BRL	8,900,000	USD	1,696,113	May 17, 2023	4,736,958
PLN	4,600,000	USD	1,037,997	April 28, 2023	4,220,812
ZAR	35,000,000	USD	1,944,888	April 13, 2023	2,396,181
BRL	4,000,000	USD	771,050	April 05, 2023	1,793,280
INR	442,500,000	USD	5,362,141	May 12, 2023	470,564
INR	73,000,000	USD	885,342	April 28, 2023	81,077
USD	1,939,546	INR	160,000,000	April 13, 2023	(546,953)
INR	1,398,000,000	USD	16,991,671	April 13, 2023	(1,196,387)
USD	14,771,941	MXN	269,000,000	April 05, 2023	(10,165,460)
USD	6,393,204	JPY	870,000,000	May 11, 2023	(24,469,851)
USD	16,220,930	BRL	83,700,000	April 05, 2023	(25,980,805)
USD	38,420,937	JPY	5,110,000,000	May 24, 2023	(37,079,366)
USD	36,069,107	JPY	4,820,000,000	April 26, 2023	(38,615,956)
ZAR	359,000,000	USD	20,524,359	April 13, 2023	(52,022,784)
JPY	4,945,000,000	USD	37,602,961	April 05, 2023	(57,198,073)
USD	31,855,672	JPY	4,300,000,000	May 11, 2023	(86,716,970)
USD	32,138,402	JPY	4,370,000,000	May 17, 2023	(123,156,135)
					973,550,779

オプション契約

2023年3月31日現在

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
売建ポジション						
JPY	(32,000)	C 6201 JT 9071.2 03/04/23 OTC	April 03, 2023	(175,168)	0	175,168
JPY	(160,000)	C 7267 JT 3883.98 03/04/23 OTC	April 03, 2023	(381,584)	0	381,584
JPY	(35,000)	C 7269 JT 5820.29 03/04/23 OTC	April 03, 2023	(102,711)	0	102,711
JPY	(110,000)	C 8031 JT 4712.4 03/04/23 OTC	April 03, 2023	(435,600)	0	435,600
JPY	(270,000)	C 8035 JT 19091.4167 03/04/23 OTC	April 03, 2023	(305,786)	0	305,786
JPY	(190,000)	C 8766 JT 3286.04 06/04/23 OTC	April 06, 2023	(442,016)	0	442,016
JPY	(88,000)	C 2502 JT 5343.0881 02/05/23 OTC	May 02, 2023	(395,120)	(2,794,718)	(2,399,598)
JPY	(88,000)	C 2502 JT 5537.25 14/04/23 OTC	April 14, 2023	(211,860)	(82,112)	129,748
JPY	(16,000)	C 2670 JT 7858.8 03/04/23 OTC	April 03, 2023	(45,312)	(214)	45,098
JPY	(120,000)	C 2768 JT 2913.14 13/04/23 OTC	April 13, 2023	(309,360)	(1,679)	307,681
JPY	(115,000)	C 4063 JT 4496.0573 14/04/23 OTC	April 14, 2023	(1,325,761)	(1,862,865)	(537,104)
JPY	(115,000)	C 4063 JT 4729.05 26/04/23 OTC	April 26, 2023	(192,510)	(916,038)	(723,528)
JPY	(60,000)	C 4185 JT 3536.9 24/04/23 OTC	April 24, 2023	(131,460)	(60,541)	70,919
JPY	(35,000)	C 4768 JT 5364.75 27/04/23 OTC	April 27, 2023	(114,292)	(90,011)	24,281
JPY	(32,000)	C 6201 JT 9548.469 21/04/23 OTC	April 21, 2023	(348,435)	(28,703)	319,732
JPY	(135,000)	C 6301 JT 3657.92 28/04/23 OTC	April 28, 2023	(176,364)	(560,207)	(383,843)
JPY	(52,000)	C 6501 JT 8122.44 28/04/23 OTC	April 28, 2023	(186,888)	(518,272)	(331,384)

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(45,000)	C 6902 JT 8784.68 21/04/23 OTC	April 21, 2023	(204,471)	(14,007)	190,464
JPY	(45,000)	C 6902 JT 8866.69 27/04/23 OTC	April 27, 2023	(234,706)	(32,170)	202,536
JPY	(66,500)	C 6981 JT 8975.22 25/04/23 OTC	April 25, 2023	(366,488)	(509,967)	(143,479)
JPY	(160,000)	C 7267 JT 4019.41 14/04/23 OTC	April 14, 2023	(284,560)	(5,835)	278,725
JPY	(35,000)	C 7269 JT 5894.07 11/04/23 OTC	April 11, 2023	(86,677)	(5)	86,672
JPY	(20,000)	C 7735 JT 13756.4 08/05/23 OTC	May 08, 2023	(115,600)	(568,903)	(453,303)
JPY	(60,000)	C 8001 JT 4699.52 08/05/23 OTC	May 08, 2023	(100,704)	(459,685)	(358,981)
JPY	(25,500)	C 8035 JT 19588 02/05/23 OTC	May 02, 2023	(499,494)	(375,229)	124,265
JPY	(105,000)	C 8058 JT 5305.1268 02/05/23 OTC	May 02, 2023	(342,037)	(640,954)	(298,917)
JPY	(215,000)	C 8591 JT 2834.8765 10/05/23 OTC	May 10, 2023	(371,004)	(7,734)	363,270
JPY	(190,000)	C 8766 JT 3340.75 02/05/23 OTC	May 02, 2023	(386,365)	(34)	386,331
JPY	(145,000)	C 9432 JT 4359.2304 02/05/23 OTC	May 02, 2023	(395,052)	(162,967)	232,085
JPY	(150,000)	C 9432 JT 4396.7 09/06/23 OTC	June 09, 2023	(359,730)	(1,171,236)	(811,506)
				<u>(9,027,115)</u>	<u>(10,864,086)</u>	<u>(1,836,971)</u>
				<u>(9,027,115)</u>	<u>(10,864,086)</u>	<u>(1,836,971)</u>

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日2023年8月21日）

作成対象期間（2022年8月20日～2023年8月21日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、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ないます。
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	株式への投資は行ないません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<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	落中率			
17期(2019年8月19日)	円 10,205		% △0.0	% 59.3	% —	百万円 8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159
20期(2022年8月19日)	10,199		△0.0	57.5	—	7,850
21期(2023年8月21日)	10,196		△0.0	5.7	—	6,733

*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

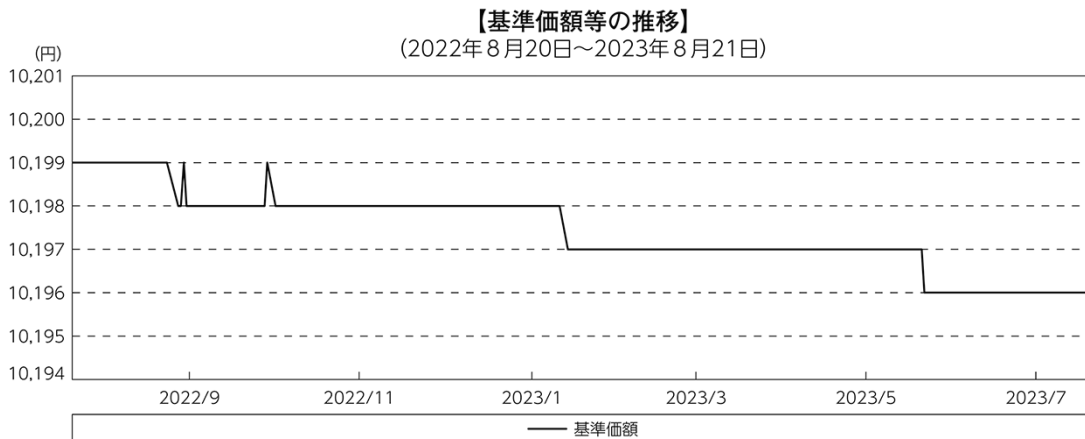
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2022年8月19日	円 10,199		% —	% 57.5	% —
8月末	10,199		0.0	58.4	—
9月末	10,198		△0.0	48.5	—
10月末	10,198		△0.0	44.4	—
11月末	10,198		△0.0	34.4	—
12月末	10,198		△0.0	20.7	—
2023年1月末	10,198		△0.0	16.4	—
2月末	10,197		△0.0	25.4	—
3月末	10,197		△0.0	22.8	—
4月末	10,197		△0.0	26.2	—
5月末	10,197		△0.0	14.3	—
6月末	10,196		△0.0	9.1	—
7月末	10,196		△0.0	4.3	—
(期末) 2023年8月21日	10,196		△0.0	5.7	—

*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、消費や雇用環境など景気全般に持ち直しの動きが見られました。このような中、日銀は2022年12月の金融政策決定会合で、長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を一部見直し、長期金利の許容変動幅を±0.5%と、従来の±0.25%から拡大することを決定しました。また、2023年7月には、イールドカーブ・コントロールの運用を更に柔軟化し、従前の上限であった+0.5%からの上振れを容認し、実質的な長期金利の上限を+1%とすることを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通じて-0.10%～-0.30%程度で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01%～-0.08%程度で推移しました。

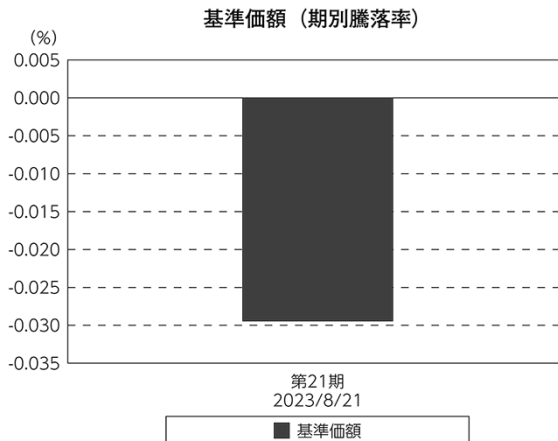
○当ファンドのポートフォリオ

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。

日銀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

(2022年 8 月20日～2023年 8 月21日)

該当事項はございません。

○ 売買及び取引の状況

(2022年 8 月20日～2023年 8 月21日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	地方債証券	千円 4,557,523	千円 503,685 (4,569,320)
	特殊債券	2,284,885	— (5,187,000)
	社債券 (投資法人債券を含む)	300,407	— (1,000,000)

*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。

○ 利害関係人との取引状況等

(2022年 8 月20日～2023年 8 月21日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2023年8月21日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
地方債証券	230,000 (230,000)	230,079 (230,079)	3.4 (3.4)	— (—)	— (—)	— (—)	3.4 (3.4)
特殊債券 (除く金融債)	54,000 (54,000)	54,051 (54,051)	0.8 (0.8)	— (—)	— (—)	— (—)	0.8 (0.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	100,000 (100,000)	100,043 (100,043)	1.5 (1.5)	— (—)	— (—)	— (—)	1.5 (1.5)
合 計	384,000 (384,000)	384,175 (384,175)	5.7 (5.7)	— (—)	— (—)	— (—)	5.7 (5.7)

* ()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	額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円		
東京都 公募第724回	0.7	10,000	10,005		2023/9/20
大阪府 公募(5年)第155回	0.001	100,000	100,000		2023/10/30
京都府 公募平成25年度第7回	0.8	90,000	90,058		2023/9/19
愛知県 公募平成25年度第15回	0.699	10,000	10,012		2023/10/25
福岡県 公募平成25年度第4回	0.816	20,000	20,003		2023/8/25
小 計		230,000	230,079		
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200回	0.801	34,000	34,030		2023/9/29
地方公共団体金融機構債券 第54回	0.73	10,000	10,019		2023/11/28
西日本高速道路 第47回	0.07	10,000	10,002		2023/12/20
小 計		54,000	54,051		
普通社債券(含む投資法人債券)					
三井住友ファイナンス&リース 第21回社債間限定同順位特約付	0.18	100,000	100,043		2023/11/27
小 計		100,000	100,043		
合 計		384,000	384,175		

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 384,175	% 5.7
コール・ローン等、その他	6,358,969	94.3
投資信託財産総額	6,743,144	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 (2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,743,144,910
コール・ローン等	6,358,433,056
公社債(評価額)	384,175,187
未収利息	210,342
前払費用	326,325
(B) 負債	10,011,425
未払金	10,002,200
未払利息	9,225
(C) 純資産総額(A-B)	6,733,133,485
元本	6,603,862,387
次期繰越損益金	129,271,098
(D) 受益権総口数	6,603,862,387口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,196円

(注) 期首元本額は7,697,164,972円、期中追加設定元本額は6,899,643,779円、期中一部解約元本額は7,992,946,364円、1口当たり純資産額は1.0196円です。

○損益の状況 (2022年8月20日～2023年8月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	10,224,214
受取利息	11,704,539
その他収益金	26,370
支払利息	△ 1,506,695
(B) 有価証券売買損益	△ 12,018,108
売買損	△ 12,018,108
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,793,894
(D) 前期繰越損益金	153,116,866
(E) 追加信託差損益金	135,776,221
(F) 解約差損益金	△ 157,828,095
(G) 計(C+D+E+F)	129,271,098
次期繰越損益金(G)	129,271,098

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	2,663,398,020
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Kプライス(適格機関投資家専用)	1,486,454,639
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)	1,248,281,712
野村アンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2210(適格機関投資家転売制限付)	730,584,834
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)	158,756,834
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	68,496,125
野村世界高金利通貨投信	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
ネクストコア	2,282,012

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)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・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(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信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
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	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)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(ブラジルリアルコース)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(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)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・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(インドネシアピアコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
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	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信(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信(豪ドルコース)年2回決算型	982,607
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	982,607
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	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プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029
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	982,029
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	982,029
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	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信(米ドルコース)毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)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
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 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
グローバル・ストック Bコース	979,528
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	626,503
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信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	398,357
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	373,897
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	177,539
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	149,947
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	123,377
グローバル・ストック Dコース	116,529
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	100,946
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	98,262
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	98,261
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	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)毎月分配型	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(インドネシアルピアコース)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(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・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
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
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98,078
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース	98,078
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース	98,059
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース	98,059
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
マイライフ・エール(資産成長型)	98,049
マイライフ・エール(年2%目標払出型)	98,049
マイライフ・エール(年6%目標払出型)	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
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(インドルピアコース)年2回決算型	63,772
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	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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	18,851
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	14,308
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	13,042
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
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PIMCO・トレンド戦略ファンド(米ドル売り円買い)(野村SMA・EW向け)	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
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	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

〇お知らせ

該当事項はございません。