

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

運用報告書(全体版)

第22期(決算日2023年5月22日)

作成対象期間(2022年11月23日～2023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・ファンドー通貨セレクト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・ファンドー通貨セレクト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(通貨セレクトコース) 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・ファンドー通貨セレクト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・ ファンドー通貨セレクトクラス | 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 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 プレミアム(通貨セレクトコース) 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ないません。 |
| | 野村マネー マザーファンド | 株式への投資は行ないません。 |
| 配分方針 | 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ないます。 | |

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 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 組 入 比 率 | 信 託 券 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|-------------|-----------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|------------------|------------------|
| | | 税 分 込 配 金 | 騰 落 率 | | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | % | | 百万円 |
| 18期(2021年5月24日) | 21,240 | 10 | 24.8 | 0.0 | — | 98.9 | | 5,233 |
| 19期(2021年11月22日) | 22,810 | 10 | 7.4 | 0.0 | — | 98.9 | | 5,128 |
| 20期(2022年5月23日) | 26,206 | 10 | 14.9 | 0.0 | — | 98.9 | | 5,621 |
| 21期(2022年11月22日) | 30,247 | 10 | 15.5 | 0.0 | — | 99.0 | | 6,214 |
| 22期(2023年5月22日) | 35,246 | 10 | 16.6 | 0.0 | — | 98.2 | | 7,197 |

*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 組 入 比 率 | 信 託 券 率 |
|-------------|--------|-------------|-----|-----------------------|-----------------------|----------------------------|------------------|
| | | 騰 落 率 | 率 | | | | |
| (期首) | 円 | % | % | % | % | | |
| 2022年11月22日 | 30,247 | — | 0.0 | — | 99.0 | | |
| 11月末 | 30,317 | 0.2 | 0.0 | — | 99.0 | | |
| 12月末 | 28,635 | △ 5.3 | 0.0 | — | 98.4 | | |
| 2023年1月末 | 29,597 | △ 2.1 | 0.0 | — | 97.7 | | |
| 2月末 | 31,124 | 2.9 | 0.0 | — | 96.7 | | |
| 3月末 | 30,824 | 1.9 | 0.0 | — | 96.9 | | |
| 4月末 | 32,317 | 6.8 | 0.0 | — | 98.3 | | |
| (期末) | | | | | | | |
| 2023年5月22日 | 35,256 | 16.6 | 0.0 | — | 98.2 | | |

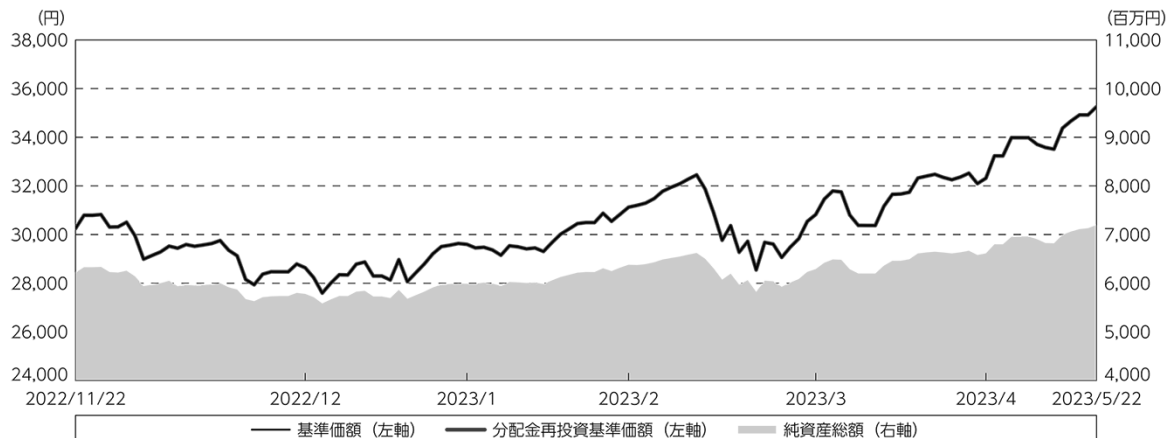
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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



期首：30,247円

期末：35,246円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：16.6%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2022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）※1

※1 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。

- ・ 円／選定通貨※2の為替変動

※2 選定通貨は、投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した通貨を指します。

○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3月下旬)

- (下 落) 日銀が、2022年12月の金融政策決定会合において現状維持との市場予想に反して長期金利の許容変動幅拡大などを決定し、金融政策の先行き不透明感や更なる政策修正への警戒感が強まったこと。この金融緩和政策の一部修正を事実上の利上げとする見方が広まるなか、金融関連を除く幅広い業種においては長期金利の上昇などによる業績への悪影響が懸念されたこと。
- (上 昇) 米国の一部主要経済指標の結果から米インフレ率にピークアウトの兆しが強まるなか、米国の金融引き締めへの過度な警戒感が和らいだこと。
- (上 昇) 中国のゼロコロナ政策の事実上の終了などを背景に、中国の景気回復が期待されたこと。
- (上 昇) 日銀が、2023年1月の金融政策決定会合において現行の金融緩和政策を維持したことを受けて、更なる政策修正への過度な警戒感が和らいだこと。
- (下 落) 1月の米主要経済指標の結果において一部指標が市場予想を上回ったことを受けて、米長期金利が上昇するなか、米インフレ率の高止まりや米利上げの長期化への警戒感が強まったこと。
- (上 昇) 植田次期日銀総裁候補が経済を支えるため金融緩和政策の継続が必要との意見を述べたこと。
- (下 落) 米中堅銀行の経営破綻やスイス大手金融機関の経営不安などを受けて、金融システムに対する懸念が強まったこと。
- (上 昇) 速やかに米金融当局が預金保護の意向を示したことやスイス大手金融機関による救済買収の合意などを受けて金融システムに対する懸念が和らいだこと。

(2023年4月上旬～当作成期末)

- (上 昇) 植田日銀新総裁が金融緩和政策の継続が適当との見解を示したことなどを受けて、早急な金融引き締めへの警戒感が後退したこと。
- (上 昇) 米著名投資家が日本株に対して追加投資検討と報道されたこと。
- (上 昇) 日銀が、4月の日銀金融政策決定会合において大規模な金融緩和政策の継続を決定したこと。
- (上 昇) 金融引き締めの悪影響が懸念される欧米に対して、金融緩和を継続する日本が相対的な資金の受け皿として見直され、海外資金流入が継続したこと。

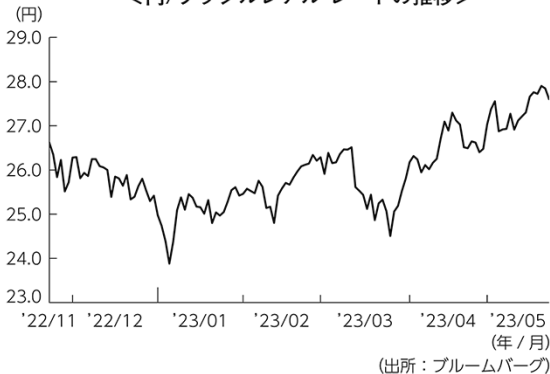
＜為替レート＞

新興国通貨市場においては、多くの新興国通貨は対円で上昇しました。金融政策決定会合における日銀の政策修正を事実上の利上げとする見方が広まり、新興国と日本の金利差縮小が意識されたことは、新興国通貨安（円高）要因となりました。しかしその後、米インフレ率にピークアウトの兆しが見え始めたことから米国の金融引き締めへの過度な警戒感が和らいだことや、中国のコロナ禍からの経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどは新興国通貨高（円安）要因となりました。また、世界各国の中央銀行がインフレ抑制のため金融引き締めの姿勢を継続するなか、植田日銀新総裁が大規模な金融緩和政策を継続する意向を表明し、新興国と日本の金利差縮小への過度な警戒感が和らいだことなども、新興国通貨高（円安）要因となりました。

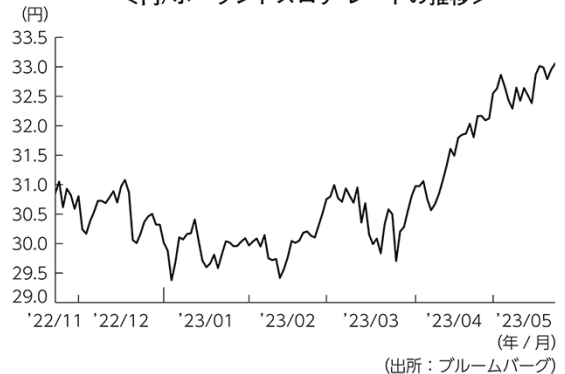
通貨セレクトコースについては、多くの選定通貨は対円で上昇しました。

新興国と日本の金利差縮小への過度な警戒感が和らいだことなどは、選定通貨高（円安）要因となりました。メキシコにおいては、同国中央銀行がインフレ抑制に向けて利上げを実施したことや利上げ継続の可能性を示唆したことなどを背景に、メキシコペソは対円で上昇しました。ポーランドにおいては、物価上昇率の高止まりが警戒されるなか、上昇率に鈍化の兆しが見られたことや、同国中央銀行が景気減速とこれまでの利上げによりインフレは徐々に抑制されるとの見方を示したことなどを背景に、ポーランドズロチは対円で上昇しました。一方、南アフリカにおいては、長引く電力供給不足や慢性的な経済活動の停滞が懸念されたことなどを背景に、南アフリカランドは対円で下落しました。

＜円/ブラジルレアル レートの推移＞



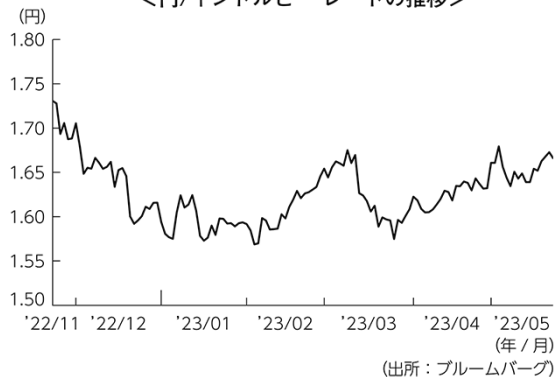
＜円/ポーランドズロチ レートの推移＞



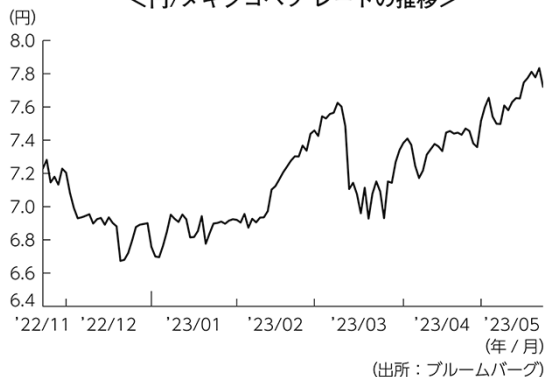
<円/南アフリカランド レートの推移>



<円/インドルピー レートの推移>



<円/メキシコペソ レートの推移>



※当作成期間中に一度でも投資した通貨はチャートに含めています。

○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（通貨セレクトコース）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・ファンドー通貨セレクトクラス〕 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・ファンドー通貨セレクトクラス〕 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・ファンドー通貨セレクトクラス]

[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 | 92.5% |
| カバー率 | 28.0% |
| 平均行使価格 | 109.0% |
| 平均行使期間 | 37.9日 |
| 配当利回り(年率) | 2.9% |
| プレミアム(年率) | 0.4% |

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

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13.8%、輸送用機器11.1%、化学7.6%となりました。

*業種は東証33業種分類によります。

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

なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ（基礎的諸条件）、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定し、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、原則として実質的に円を売り各選定通貨を買う為替取引を行ないました。選定通貨は定期的に見直しを行ないました。当作成期末時点ではブラジルレアル、ポーランドズロチ、南アフリカランド、インドルピー、メキシコペソを選定しています。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロードは、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建ての世界主要国の債券、現地通貨建ての新興国の債券をそれぞれ対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

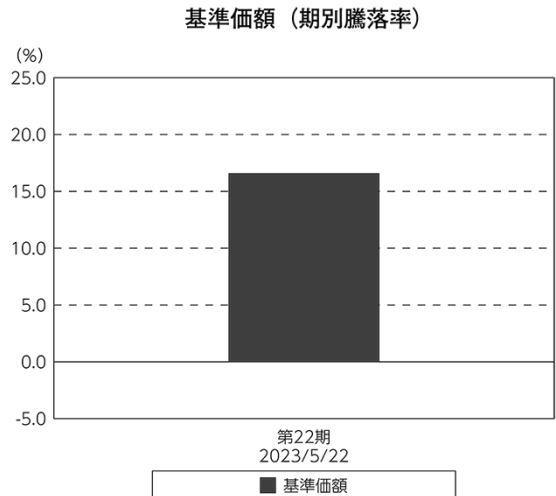
[野村マネー マザーファンド]

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22期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2022年11月23日～ 2023年5月22日 |
| 当期分配金 | 10 |
| (対基準価額比率) | 0.028% |
| 当期の収益 | 10 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 27,272 |

(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（通貨セレクトコース）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・ファンドー通貨セレクトクラス〕 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・ファンドー通貨セレクトクラス〕 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・ファンドー通貨セレクトクラス】

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、先行き不透明な相場環境であっても、株式プレミアムの安定的な収益化に努めて参ります。

また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、組入資産について、原則として実質的に円を売り、各選定通貨を買う為替取引を行ないます。

通貨の選択にあたっては、原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に（原則、毎月）見直すこととします。

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留意ください。

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うけ、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

(2022年11月23日～2023年5月22日)

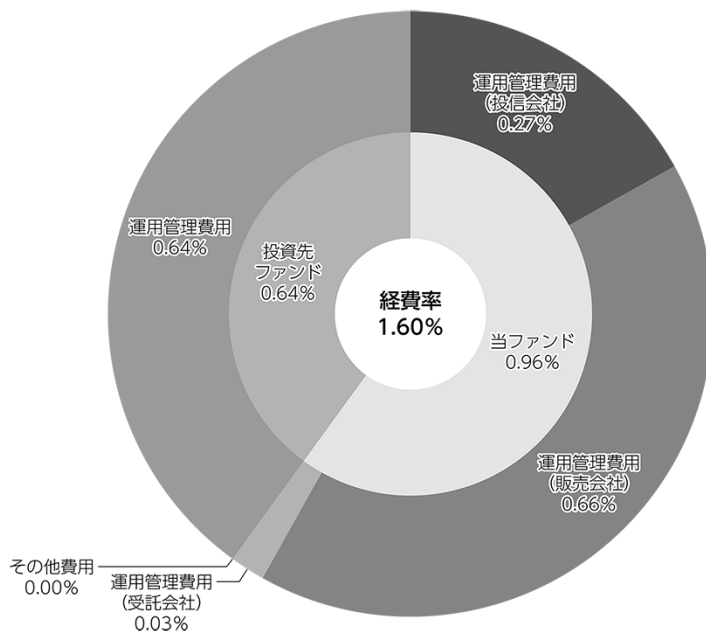
| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 146 | % 0.480 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (42) | (0.136) | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 |
| （ 販 売 会 社 ） | (100) | (0.327) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (5) | (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 | 146 | 0.482 | |
| 期中の平均基準価額は、30,469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）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は1.60%です。



(単位: %)

| | |
|--------------------|-------------|
| 経費率(①+②) | 1.60 |
| 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 | 0.64 |

(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、売買委託手数料及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、当ファンドが組入れている投資信託証券（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) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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

(2022年11月23日～2023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・ファンドー通貨セレクトクラス | 135,554 | 1,236,832 | 129,240 | 1,177,203 |

*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

(2022年11月23日～2023年5月22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・ファンドー通貨セレクトクラス | 662,897 | 669,211 | 7,067,537 | 98.2 |
| | 合計 | 662,897 | 669,211 | 7,067,537 | 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 | 982 | 982 | 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 7,067,537 | % 96.8 |
| 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 | 235,732 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 7,304,270 | 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5月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 7,304,270,686 |
| コール・ローン等 | 224,722,747 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 7,067,537,371 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,001,768 |
| 未収入金 | 11,008,800 |
| (B) 負債 | 106,917,086 |
| 未払金 | 51,991,803 |
| 未払収益分配金 | 2,042,010 |
| 未払解約金 | 22,982,406 |
| 未払信託報酬 | 29,799,110 |
| 未払利息 | 233 |
| その他未払費用 | 101,524 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,197,353,600 |
| 元本 | 2,042,010,330 |
| 次期繰越損益金 | 5,155,343,270 |
| (D) 受益権総口数 | 2,042,010,330口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 35,246円 |

(注) 期首元本額は2,054,673,244円、期中追加設定元本額は77,033,748円、期中一部解約元本額は89,696,662円、1口当たり純資産額は3.5246円です。

○損益の状況 (2022年11月23日～2023年5月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 194,279,159 |
| 受取配当金 | 194,298,180 |
| 受取利息 | 26 |
| 支払利息 | △ 19,047 |
| (B) 有価証券売買損益 | 850,194,464 |
| 売買益 | 893,992,478 |
| 売買損 | △ 43,798,014 |
| (C) 信託報酬等 | △ 29,900,634 |
| (D) 当期繰越損益金(A+B+C) | 1,014,572,989 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,657,547,932 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,485,264,359 |
| (配当等相当額) | (1,549,707,352) |
| (売買損益相当額) | (△ 64,442,993) |
| (G) 計(D+E+F) | 5,157,385,280 |
| (H) 収益分配金 | △ 2,042,010 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 5,155,343,270 |
| 追加信託差損益金 | 1,485,264,359 |
| (配当等相当額) | (1,549,707,353) |
| (売買損益相当額) | (△ 64,442,994) |
| 分配準備積立金 | 4,019,452,790 |
| 繰越損益金 | △ 349,373,879 |

*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（2022年11月23日～2023年5月22日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2022年11月23日～ 2023年5月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 188,718,457円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 1,549,707,353円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 3,832,776,343円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 5,571,202,153円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 27,282円 |
| g. 分配金 | 2,042,010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。

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)

2022年3月31日決算
(計算期間:2021年4月1日～2022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

2022年3月31日に終了する計測期間
(円)

収益

| | |
|------------------|---------------|
| 銀行口座利息 | 154,558 |
| 受取配当金等(源泉徴収税控除後) | 1,070,251,376 |
| 収益合計 | 1,070,405,934 |

費用

| | |
|----------|-------------|
| 投資顧問報酬 | 203,139,941 |
| 事務管理代行報酬 | 42,182,207 |
| 保管費用 | 12,693,953 |
| 取引銀行報酬 | 12,986,196 |
| 受託報酬 | 8,440,350 |
| 法務報酬 | 187,506 |
| 立替費用 | 3,894,822 |
| 専門家報酬 | 2,048,614 |
| 当座借越利息 | 1,851,279 |
| 雑費用 | 405,746 |
| 費用合計 | 287,830,614 |

純投資損益

| | |
|---------------|---------------|
| 純投資損益 | 782,575,320 |
| 投資有価証券売買に係る損益 | 3,024,621,495 |
| オプション契約に係る損益 | (20,649,923) |
| 外国通貨に係る損益 | 5,081,450,438 |
| 当期実現純損益 | 8,085,422,010 |

投資有価証券評価差損益

| | |
|-------------------|-----------------|
| 投資有価証券評価差損益 | (1,941,389,787) |
| オプション契約に係る評価差損益 | 3,339,829 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損益 | 1,533,764,837 |

当期評価差損益

| | |
|---------|---------------|
| 当期評価差損益 | (404,285,121) |
| 為替差額 | 222,986,622 |

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 | 8,686,698,831 |
|-----------------|---------------|

| | 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) | 13,882 | 369,151 | 5,124,462,036 |
| CRS Class Units (in JPY) | 8,256 | 4,735,611 | 39,099,553,857 |

組入資産明細
2022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 | | | |
| 668,000 | TOYOTA MOTOR CORP | 1,484,630,000 | 3.36 |
| 331,000 | NIPPON TELG & TEL CORP | 1,173,395,000 | 2.65 |
| 160,000 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | 1,140,480,000 | 2.58 |
| 452,500 | ORIX CORP | 1,107,493,750 | 2.50 |
| 314,000 | HONDA MOTOR CO LTD | 1,094,918,000 | 2.48 |
| 258,000 | KDDI CORP | 1,033,290,000 | 2.34 |
| 301,000 | MITSUI & CO LTD | 1,001,728,000 | 2.27 |
| 1,270,000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP | 965,581,000 | 2.18 |
| 498,000 | ASTELLAS PHARMA INC | 951,678,000 | 2.15 |
| 228,500 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | 892,749,500 | 2.02 |
| 38,000 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD | 714,020,000 | 1.61 |
| 156,000 | ASAHI GROUP HOLDINGS | 695,916,000 | 1.57 |
| 171,000 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 684,171,000 | 1.55 |
| 148,000 | MITSUBISHI CORP | 680,948,000 | 1.54 |
| 180,500 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | 577,780,500 | 1.31 |
| 70,500 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | 572,248,500 | 1.29 |
| 186,000 | KOMATSU LTD | 547,398,000 | 1.24 |
| 70,000 | HITACHI LTD | 431,550,000 | 0.98 |
| 305,000 | MITSUBISHI ELECTRIC CORP | 430,050,000 | 0.97 |
| 96,000 | SUZUKI MOTOR CORP | 404,448,000 | 0.91 |
| 550,000 | CHIBA BANK LTD | 398,750,000 | 0.90 |
| 46,000 | DENSO CORP | 361,560,000 | 0.82 |
| 227,000 | ISUZU MOTORS LTD | 360,476,000 | 0.82 |
| 86,500 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | 354,390,500 | 0.80 |
| 38,000 | BANDAI NAMCO HOLDINGS INC | 353,096,000 | 0.80 |
| 83,000 | ITOCHE CORP | 343,952,000 | 0.78 |
| 67,000 | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY | 341,097,000 | 0.77 |
| 69,000 | AGC INC | 338,445,000 | 0.77 |
| 91,500 | TAISEI CORP | 323,452,500 | 0.73 |
| 211,000 | SOFTBANK CORP | 301,308,000 | 0.68 |
| 51,000 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | 296,463,000 | 0.67 |
| 360,000 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 294,156,000 | 0.67 |
| 208,000 | CASIO COMPUTER CO LTD | 292,864,000 | 0.66 |
| 148,000 | NGK SPARK PLUG CO LTD | 292,596,000 | 0.66 |
| 34,700 | NIPPON EXPRESS H | 292,174,000 | 0.66 |

| 数量 | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|---------------------------------|-------------|----------|
| 370,000 | SHIKOKU ELEC PWR | 291,560,000 | 0.66 |
| 140,000 | SOJITZ CORPORATION | 282,380,000 | 0.64 |
| 28,500 | ROHM CO LTD | 273,315,000 | 0.62 |
| 235,000 | KANSAI ELECTRIC POWER CO INC | 270,015,000 | 0.61 |
| 124,500 | PIGEON CORP | 268,048,500 | 0.61 |
| 152,000 | SEKISUI CHEM CO | 267,368,000 | 0.60 |
| 137,000 | SUBARU CORP | 266,876,000 | 0.60 |
| 210,000 | SANWA HOLDINGS CORP | 261,240,000 | 0.59 |
| 84,000 | MITSUI CHEMICALS INC | 259,560,000 | 0.59 |
| 4,100 | TOKYO ELECTRON LTD | 259,325,000 | 0.59 |
| 67,000 | MABUCHI MOTOR CO LTD | 256,275,000 | 0.58 |
| 50,500 | TOYOTA TSUSHO CORP | 255,530,000 | 0.58 |
| 75,000 | DENKA CO LTD | 255,000,000 | 0.58 |
| 164,000 | ANRITSU CORPORATION | 254,692,000 | 0.58 |
| 100,000 | CANON MARKETING | 252,300,000 | 0.57 |
| 57,500 | OTSUKA CORP | 249,837,500 | 0.56 |
| 61,000 | AZBIL CORP | 249,490,000 | 0.56 |
| 80,000 | BIPROGY INC | 249,200,000 | 0.56 |
| 233,000 | NISSHINBO HOLDINGS INC | 247,679,000 | 0.56 |
| 215,000 | TOKAI CARBON CO LTD | 247,465,000 | 0.56 |
| 62,000 | MAKITA CORP | 243,970,000 | 0.55 |
| 155,000 | TOYO TIRE CORP | 242,265,000 | 0.55 |
| 39,000 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD | 240,357,000 | 0.54 |
| 80,000 | AICA KOGYO CO | 239,120,000 | 0.54 |
| 139,500 | NISSHIN SEIFUN GROUP INC | 237,987,000 | 0.54 |
| 50,000 | ABC-MART INC | 230,750,000 | 0.52 |
| 68,500 | MITSUI MINING & SMELTING CO LTD | 229,817,500 | 0.52 |
| 27,500 | NIPPON SHINYAKU CO LTD | 229,075,000 | 0.52 |
| 158,000 | INPEX CORP | 227,520,000 | 0.51 |
| 34,200 | MEITEC CORPORATION | 227,430,000 | 0.51 |
| 371,000 | PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD | 227,423,000 | 0.51 |
| 108,000 | SCSK CORP | 226,908,000 | 0.51 |
| 209,000 | AMADA CO LTD | 226,556,000 | 0.51 |
| 190,000 | PANASONIC HOLDIN | 225,815,000 | 0.51 |
| 78,000 | DAI NIPPON PRINTING CO LTD | 224,484,000 | 0.51 |
| 94,000 | NICHIREI CORP | 222,686,000 | 0.50 |
| 95,000 | GS YUASA CORP | 222,395,000 | 0.50 |
| 350,000 | OJI HOLDINGS CORPORATION | 212,450,000 | 0.48 |
| 29,000 | TREND MICRO INC | 207,640,000 | 0.47 |
| 120,000 | SATO HOLDINGS CORP | 206,280,000 | 0.47 |
| 146,000 | SANKI ENGINEERING CO LTD | 204,108,000 | 0.46 |

| 数量 | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|--------------------------------|-------------|----------|
| 14,500 | HIKARI TSUSHIN INC | 202,565,000 | 0.46 |
| 144,500 | BELLSYSTEM24 HOLDINGS INC | 198,687,500 | 0.45 |
| 40,500 | TOKYO SEIMITSU CO LTD | 197,640,000 | 0.45 |
| 95,000 | INABATA & CO | 195,985,000 | 0.44 |
| 117,000 | T&D HOLDINGS INC | 195,507,000 | 0.44 |
| 78,000 | DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC | 194,922,000 | 0.44 |
| 61,000 | HITACHI CONST MACH CO LTD | 194,895,000 | 0.44 |
| 214,000 | SENKO GROUP HOLDINGS | 192,172,000 | 0.43 |
| 105,000 | TOSOH CORP | 190,470,000 | 0.43 |
| 10,500 | HIROSE ELECTRIC | 187,530,000 | 0.42 |
| 176,000 | RICOH CO LTD | 186,912,000 | 0.42 |
| 10,100 | FUJITSU LTD | 185,991,500 | 0.42 |
| 82,000 | MARUI GROUP CO LTD | 184,500,000 | 0.42 |
| 135,800 | FURUKAWA CO | 175,046,200 | 0.40 |
| 84,000 | USS CO LTD | 172,956,000 | 0.39 |
| 100,000 | EIKEN CHEMICAL CO LTD | 172,700,000 | 0.39 |
| 24,000 | EAST JAPAN RAILWAY CO | 170,640,000 | 0.39 |
| 372,000 | ENEOS HOLDINGS INC | 170,376,000 | 0.39 |
| 97,000 | NGK INSULATORS LTD | 170,041,000 | 0.38 |
| 109,000 | STAR MICRONICS CO LTD | 167,860,000 | 0.38 |
| 294,000 | mitsubishi HC CAPITAL INC | 167,580,000 | 0.38 |
| 31,500 | NIPPON STEEL TRA | 167,265,000 | 0.38 |
| 46,500 | EIZO CORP | 166,935,000 | 0.38 |
| 162,000 | ITOCHU ENEX CO | 166,374,000 | 0.38 |
| 22,500 | TOKYO OHKA KOGYO CO LTD | 165,600,000 | 0.37 |
| 82,000 | KANAMOTO CO LTD | 164,164,000 | 0.37 |
| 24,700 | MEIJI HOLDINGS CO LTD | 163,267,000 | 0.37 |
| 58,500 | NIFCO INC | 163,215,000 | 0.37 |
| 116,000 | TOYO SEIKAN GROUP HOLDINGS LTD | 163,096,000 | 0.37 |
| 61,000 | COMSYS HOLDINGS CORP | 162,748,000 | 0.37 |
| 241,000 | TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP | 162,434,000 | 0.37 |
| 64,500 | INABA DENKISANGYO CO LTD | 160,218,000 | 0.36 |
| 71,000 | BROTHER INDS LTD | 158,827,000 | 0.36 |
| 106,000 | MARUBENI CORP | 151,156,000 | 0.34 |
| 185,000 | KYUSHU ELEC PWR | 151,145,000 | 0.34 |
| 46,500 | TAIYO HOLDINGS CO LTD | 151,125,000 | 0.34 |
| 187,000 | TANSEISHA CO LTD | 149,413,000 | 0.34 |
| 16,200 | NITTO DENKO CORP | 142,884,000 | 0.32 |
| 28,000 | NOEVIR HOLDING CO LTD | 138,460,000 | 0.31 |
| 68,000 | SUMCO CORP | 137,836,000 | 0.31 |
| 73,000 | MITSUBISHI ESTATE CO LTD | 132,787,000 | 0.30 |

| 数量 | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|-------------------------------|------------------------------|---------------------|
| 135,000 | SAKATA INX CORP | 130,545,000 | 0.30 |
| 19,300 | FUJIMI INC | 129,696,000 | 0.29 |
| 54,000 | STARTS CORP INC | 129,546,000 | 0.29 |
| 25,300 | KAO CORP | 127,132,500 | 0.29 |
| 39,000 | IZUMI | 125,580,000 | 0.28 |
| 43,000 | KYOWA KIRIN CO LTD | 122,464,000 | 0.28 |
| 42,500 | NISSHIN OILLIO GRP | 121,082,500 | 0.27 |
| 43,000 | YAMAHA MOTOR CO LTD | 118,508,000 | 0.27 |
| 171,000 | KITZ CORP | 117,477,000 | 0.27 |
| 36,500 | ITOCHEU TECHNO-SOLUTIONS CORP | 114,610,000 | 0.26 |
| 50,500 | EXEO GROUP INC | 114,180,500 | 0.26 |
| 22,500 | DENTSU GROUP INC | 112,950,000 | 0.26 |
| 12,900 | TOYOTA INDUSTRIES CORP | 109,263,000 | 0.25 |
| 46,000 | KEWPIE CORP | 107,732,000 | 0.24 |
| 225,000 | CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD | 103,050,000 | 0.23 |
| 41,000 | DIC CORP | 102,787,000 | 0.23 |
| 44,000 | LIXIL CORP | 100,760,000 | 0.23 |
| 110,000 | OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD | 93,060,000 | 0.21 |
| 21,500 | JSR CORPORATION | 78,045,000 | 0.18 |
| 72,000 | OBAYASHI CORP | 64,800,000 | 0.15 |
| | | <u>40,718,639,450</u> | <u>92.07</u> |
| | 日本計 | <u>40,718,639,450</u> | <u>92.07</u> |
| | 組入資産合計 | <u>40,718,639,450</u> | <u>92.07</u> |

外国為替先渡し契約

2022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 | 38,137,061.00 | JPY | 4,370,000,000.00 | April 08, 2022 | 268,483,602 |
| USD | 38,238,656.00 | JPY | 4,410,000,000.00 | April 22, 2022 | 239,596,552 |
| USD | 37,730,464.00 | JPY | 4,350,000,000.00 | May 13, 2022 | 235,398,786 |
| USD | 36,844,744.00 | JPY | 4,250,000,000.00 | April 14, 2022 | 230,787,219 |
| USD | 37,450,647.00 | JPY | 4,325,000,000.00 | April 28, 2022 | 228,260,364 |
| MXN | 416,500,000.00 | USD | 19,574,484.00 | May 20, 2022 | 150,905,132 |
| BRL | 49,000,000.00 | USD | 9,070,210.00 | April 08, 2022 | 143,400,285 |
| BRL | 77,700,000.00 | USD | 15,016,233.00 | April 28, 2022 | 139,961,393 |
| USD | 22,382,396.00 | JPY | 2,600,000,000.00 | May 18, 2022 | 119,730,688 |
| ZAR | 198,000,000.00 | USD | 12,679,224.00 | May 13, 2022 | 116,916,306 |
| ZAR | 187,000,000.00 | USD | 12,084,255.00 | April 08, 2022 | 104,396,609 |
| BRL | 46,700,000.00 | USD | 8,960,779.00 | April 13, 2022 | 96,637,672 |
| USD | 32,233,147.00 | JPY | 3,820,000,000.00 | May 25, 2022 | 95,817,127 |
| BRL | 59,000,000.00 | USD | 11,454,531.00 | May 20, 2022 | 89,846,534 |
| MXN | 474,000,000.00 | USD | 23,177,895.00 | April 13, 2022 | 82,111,379 |
| MXN | 287,500,000.00 | USD | 13,826,750.00 | April 08, 2022 | 79,506,676 |
| ZAR | 142,000,000.00 | USD | 9,167,257.00 | April 22, 2022 | 78,207,129 |
| USD | 12,903,723.00 | JPY | 1,500,000,000.00 | April 22, 2022 | 69,011,893 |
| ZAR | 146,000,000.00 | USD | 9,586,281.00 | May 25, 2022 | 55,357,951 |
| MXN | 223,000,000.00 | USD | 10,744,616.00 | April 28, 2022 | 54,459,053 |
| MXN | 287,500,000.00 | USD | 14,072,855.00 | June 03, 2022 | 31,226,959 |
| USD | 7,995,636.00 | JPY | 950,000,000.00 | May 18, 2022 | 21,541,906 |
| INR | 1,089,000,000.00 | USD | 14,130,085.00 | May 25, 2022 | 21,096,139 |
| USD | 6,833,862.00 | JPY | 810,000,000.00 | May 18, 2022 | 20,378,146 |
| BRL | 49,000,000.00 | USD | 9,982,886.00 | June 03, 2022 | 12,193,208 |
| ZAR | 22,000,000.00 | USD | 1,422,553.00 | April 08, 2022 | 12,175,384 |
| INR | 1,088,500,000.00 | USD | 14,251,019.00 | May 13, 2022 | 8,035,280 |
| IDR | 219,898,000,000.00 | USD | 15,239,263.00 | April 08, 2022 | 7,185,822 |
| ZAR | 14,000,000.00 | USD | 921,090.00 | May 13, 2022 | 5,276,872 |
| IDR | 246,037,500,000.00 | USD | 17,053,961.00 | May 13, 2022 | 4,560,475 |
| USD | 6,775,877.00 | JPY | 820,000,000.00 | April 22, 2022 | 3,890,027 |
| IDR | 180,735,500,000.00 | USD | 12,533,668.00 | April 22, 2022 | 3,797,195 |
| USD | 21,725,968.00 | IDR | 311,898,000,000.00 | April 08, 2022 | 3,306,249 |
| ZAR | 209,000,000.00 | USD | 14,320,069.00 | June 10, 2022 | 3,060,217 |
| USD | 8,256,332.00 | JPY | 1,000,000,000.00 | May 25, 2022 | 2,984,477 |
| INR | 120,000,000.00 | USD | 1,561,280.00 | April 22, 2022 | 2,521,568 |
| INR | 1,675,000,000.00 | USD | 21,956,990.00 | June 10, 2022 | 926,820 |
| IDR | 20,000,000,000.00 | USD | 1,386,193.00 | April 08, 2022 | 633,694 |
| IDR | 72,000,000,000.00 | USD | 5,006,257.00 | April 08, 2022 | 339,699 |
| USD | 22,116,736.00 | INR | 1,675,000,000.00 | April 08, 2022 | 312,018 |
| INR | 120,000,000.00 | USD | 1,591,089.00 | April 08, 2022 | (826,095) |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期日 | 未実現損益(円) |
|--------|--------------------|--------|------------------|----------------|---------------|
| INR | 140,000,000.00 | USD | 1,855,902.00 | April 08, 2022 | (918,876) |
| IDR | 24,000,000,000.00 | USD | 1,676,563.00 | April 22, 2022 | (980,808) |
| USD | 14,437,618.00 | ZAR | 209,000,000.00 | April 08, 2022 | (3,343,646) |
| IDR | 311,898,000,000.00 | USD | 21,685,183.00 | June 10, 2022 | (5,606,478) |
| INR | 952,500,000.00 | USD | 12,616,144.00 | April 22, 2022 | (7,170,614) |
| IDR | 197,905,000,000.00 | USD | 13,803,698.00 | May 25, 2022 | (7,762,366) |
| USD | 8,149,271.00 | JPY | 1,000,000,000.00 | April 14, 2022 | (8,962,251) |
| INR | 1,415,000,000.00 | USD | 18,761,601.00 | April 08, 2022 | (9,741,029) |
| USD | 35,503,772.00 | JPY | 4,330,000,000.00 | June 01, 2022 | (18,006,193) |
| USD | 13,857,843.00 | MXN | 287,500,000.00 | April 08, 2022 | (75,724,249) |
| JPY | 1,800,000,000.00 | USD | 15,588,062.00 | April 22, 2022 | (95,416,034) |
| USD | 9,144,350.00 | BRL | 49,000,000.00 | April 08, 2022 | (134,381,612) |
| | | | | | 2,475,394,254 |

オプション契約

2022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 | (45,000) | C 3382 JT 6605.64 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (377,865) | (31,317) | 346,548 |
| JPY | (120,000) | C 6301 JT 3582 20/04/22 OTC | April 20, 2022 | (358,200) | (7,534) | 350,666 |
| JPY | (62,000) | C 6448 JT 2557.22 13/04/22 OTC | April 13, 2022 | (109,343) | (48,426) | 60,917 |
| JPY | (200,000) | C 7203 JT 2525.18 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (424,400) | (163,824) | 260,576 |
| JPY | (200,000) | C 7203 JT 2617.405 20/04/22 OTC | April 20, 2022 | (395,920) | (47,646) | 348,274 |
| JPY | (100,000) | C 7267 JT 4219.27 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (69,740) | (10,866) | 58,874 |
| JPY | (3,800) | C 8035 JT 74237.5 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (406,227) | (97,628) | 308,599 |
| JPY | (400,000) | C 8306 JT 971.608 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (159,280) | (64) | 159,216 |
| JPY | (400,000) | C 8306 JT 992.226 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (162,680) | (20) | 162,660 |
| JPY | (57,000) | C 8309 JT 5032.5 22/04/22 OTC | April 22, 2022 | (47,025) | (3,189) | 43,836 |
| JPY | (57,000) | C 8309 JT 5083.74 20/04/22 OTC | April 20, 2022 | (47,503) | (1,294) | 46,209 |
| JPY | (140,000) | C 8591 JT 3090 21/04/22 OTC | April 21, 2022 | (103,824) | (2,808) | 101,016 |
| JPY | (140,000) | C 8591 JT 3095 20/04/22 OTC | April 20, 2022 | (103,992) | (1,837) | 102,155 |
| JPY | (75,000) | C 8750 JT 3245.97 28/04/22 OTC | April 28, 2022 | (39,585) | (5,474) | 34,111 |
| JPY | (52,000) | C 8766 JT 9035.07 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (194,142) | (7) | 194,135 |
| JPY | (52,000) | C 8766 JT 9064.11 20/04/22 OTC | April 20, 2022 | (272,672) | (10) | 272,662 |
| JPY | (100,000) | C 9432 JT 3905.44 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (104,610) | (122,961) | (18,351) |
| JPY | (110,000) | C 9432 JT 4050.39 20/04/22 OTC | April 20, 2022 | (120,417) | (17,430) | 102,987 |
| JPY | (80,000) | C 9433 JT 4474.4 13/04/22 OTC | April 13, 2022 | (63,920) | (2,069) | 61,851 |
| JPY | (80,000) | C 9433 JT 4497.4 19/04/22 OTC | April 19, 2022 | (127,360) | (6,297) | 121,063 |
| | | | | (3,688,705) | (570,701) | 3,118,004 |
| | | | | (3,688,705) | (570,701) | 3,118,004 |

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日2022年8月19日）

作成対象期間（2021年8月20日～2022年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、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 | 中率 | | | |
| 16期(2018年8月20日) | 円 10,206 | | % △0.0 | % 38.7 | % — | 百万円 13,511 |
| 17期(2019年8月19日) | 10,205 | | △0.0 | 59.3 | — | 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 |

*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

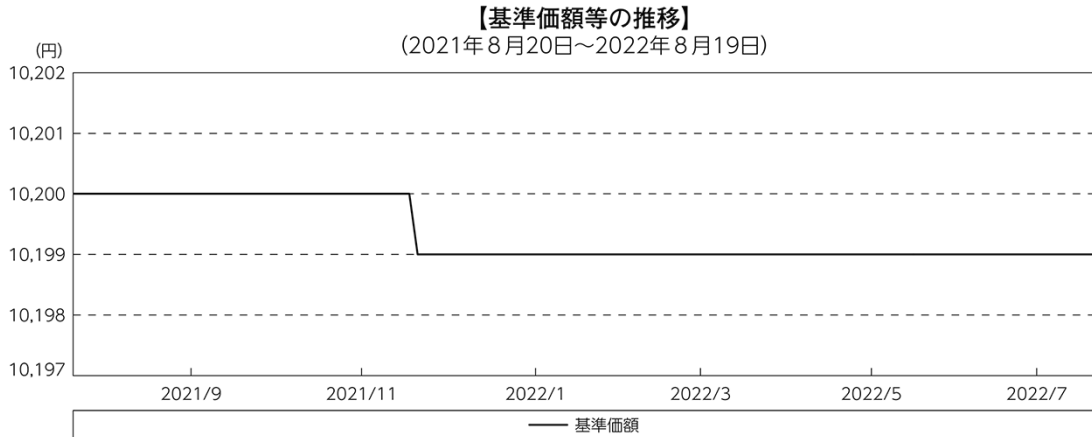
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落率 | | |
| (期首) 2021年8月19日 | 円 10,200 | | % — | % 60.1 | % — |
| 8月末 | 10,200 | | 0.0 | 56.8 | — |
| 9月末 | 10,200 | | 0.0 | 55.1 | — |
| 10月末 | 10,200 | | 0.0 | 51.6 | — |
| 11月末 | 10,200 | | 0.0 | 54.5 | — |
| 12月末 | 10,199 | | △0.0 | 52.1 | — |
| 2022年1月末 | 10,199 | | △0.0 | 57.1 | — |
| 2月末 | 10,199 | | △0.0 | 57.5 | — |
| 3月末 | 10,199 | | △0.0 | 59.5 | — |
| 4月末 | 10,199 | | △0.0 | 60.1 | — |
| 5月末 | 10,199 | | △0.0 | 62.0 | — |
| 6月末 | 10,199 | | △0.0 | 55.6 | — |
| 7月末 | 10,199 | | △0.0 | 53.7 | — |
| (期末) 2022年8月19日 | 10,199 | | △0.0 | 57.5 | — |

*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、新型コロナウイルス感染症による厳しい状況が緩和される中で、消費や雇用環境などには持ち直しの動きが見られました。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、2021年12月には、2022年3月末が期限となっていた「新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム」について中小企業向けに部分的な延長を決定しました。

TDB(国庫短期証券)3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね-0.1%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は0~-0.05%程度で推移しました。

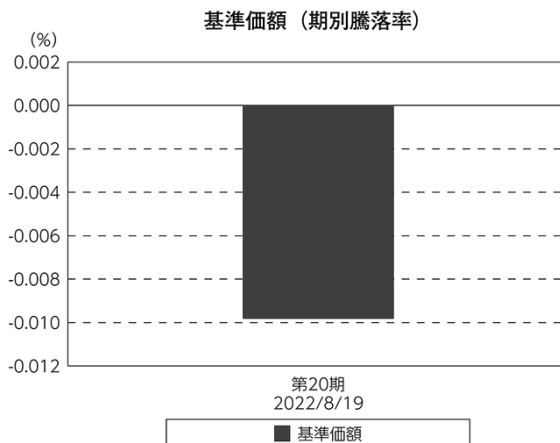
○当ファンドのポートフォリオ

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

(2021年8月20日～2022年8月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2021年8月20日～2022年8月19日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|----------------|-----------------|------------------------|
| 国内 | 地方債証券 | 千円 4,055,682 | 千円 — (4,600,000) |
| | 特殊債券 | 7,031,417 | — (6,457,000) |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 2,136,048 | — (3,130,000) |

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年8月20日～2022年8月19日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|-----|---------------|--------------------|----------|-----------|--------------------|--------|
| | | 百万円 | % | | 百万円 | % |
| 公社債 | 百万円 13,223 | 百万円 30 | % 0.2 | 百万円 — | 百万円 — | % — |

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

(2022年8月19日現在)

○組入資産の明細

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | 末 | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------------------------|----------------|--------------------|-----------|----------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地方債証券 | 750,000 (750,000) | 750,520 (750,520) | 9.6 (9.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 9.6 (9.6) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 2,430,000 (2,430,000) | 2,431,889 (2,431,889) | 31.0 (31.0) | — (—) | — (—) | — (—) | 31.0 (31.0) |
| 金融債券 | 530,000 (530,000) | 530,049 (530,049) | 6.8 (6.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 6.8 (6.8) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 800,000 (800,000) | 800,923 (800,923) | 10.2 (10.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 10.2 (10.2) |
| 合 計 | 4,510,000 (4,510,000) | 4,513,382 (4,513,382) | 57.5 (57.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 57.5 (57.5) |

* () 内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*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 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 |
| 東京都 公募第711回 | 0.82 | 300,000 | 300,218 |
| 福岡県 公募平成24年度第4回 | 0.84 | 50,000 | 50,007 |
| 千葉県 公募平成24年度第5回 | 0.82 | 100,000 | 100,074 |
| 共同発行市場地方債 公募第114回 | 0.82 | 300,000 | 300,220 |
| 小 計 | | 750,000 | 750,520 |
| 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 財投機関債第96回 | 0.796 | 300,000 | 300,221 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回 | 2.28 | 150,000 | 150,305 |
| 地方公共団体金融機構債券 第40回 | 0.825 | 110,000 | 110,101 |
| 地方公共団体金融機構債券 第41回 | 0.801 | 100,000 | 100,146 |
| 地方公共団体金融機構債券 第42回 | 0.801 | 40,000 | 40,086 |
| 日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債 | 0.825 | 300,000 | 300,456 |
| 都市再生債券 財投機関債第68回 | 0.854 | 200,000 | 200,159 |
| 都市再生債券 財投機関債第71回 | 0.767 | 200,000 | 200,131 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第60回 | 0.001 | 300,000 | 300,000 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第61回 | 0.001 | 100,000 | 100,000 |
| 国際協力機構債券 第14回財投機関債 | 0.825 | 300,000 | 300,221 |
| 東日本高速道路 第48回 | 0.09 | 100,000 | 100,032 |
| 西日本高速道路 第37回 | 0.09 | 130,000 | 130,016 |
| 西日本高速道路 第38回 | 0.09 | 100,000 | 100,010 |
| 小 計 | | 2,430,000 | 2,431,889 |
| 金融債券 | | | |
| 商工債券 利付第811回い号 | 0.17 | 30,000 | 30,018 |
| しんきん中金債券 利付第333回 | 0.09 | 200,000 | 200,011 |
| 商工債券 利付(3年)第236回 | 0.02 | 300,000 | 300,019 |
| 小 計 | | 530,000 | 530,049 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | |
| 伊藤忠商事 第67回社債間限定同順位特約付 | 0.964 | 100,000 | 100,052 |
| 東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付 | 2.22 | 100,000 | 100,408 |
| 三井不動産 第46回社債間限定同順位特約付 | 0.964 | 200,000 | 200,063 |
| 三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無 | 0.929 | 300,000 | 300,205 |
| 電源開発 第35回社債間限定同順位特約付 | 1.126 | 100,000 | 100,193 |
| 小 計 | | 800,000 | 800,923 |
| 合 計 | | 4,510,000 | 4,513,382 |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 4,513,382 | 57.5 |
| コール・ローン等、その他 | 3,340,370 | 42.5 |
| 投資信託財産総額 | 7,853,752 | 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 (2022年8月19日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 7,853,752,692 |
| コール・ローン等 | 3,326,621,034 |
| 公社債(評価額) | 4,513,382,357 |
| 未収利息 | 7,215,305 |
| 前払費用 | 6,533,996 |
| (B) 負債 | 3,470,854 |
| 未払解約金 | 3,470,000 |
| 未払利息 | 854 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,850,281,838 |
| 元本 | 7,697,164,972 |
| 次期繰越損益金 | 153,116,866 |
| (D) 受益権総口数 | 7,697,164,972口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,199円 |

(注) 期首元本額は8,979,256,768円、期中追加設定元本額は3,202,453,404円、期中一部解約元本額は4,484,545,200円、1口当たり純資産額は1.0199円です。

○損益の状況 (2021年8月20日~2022年8月19日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 23,315,784 |
| 受取利息 | 23,990,043 |
| 支払利息 | △ 674,259 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 24,456,523 |
| 売買損 | △ 24,456,523 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 1,140,739 |
| (D) 前期繰越損益金 | 179,893,174 |
| (E) 追加信託差損益金 | 63,852,596 |
| (F) 解約差損益金 | △ 89,488,165 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 153,116,866 |
| 次期繰越損益金(G) | 153,116,866 |

* 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 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)プライス(適格機関投資家専用) | 1,997,050,289 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Rプライス(適格機関投資家専用) | 1,941,761,887 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)ハイブリッド30(適格機関投資家専用) | 1,503,668,510 |
| 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 |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド) | 441,709,194 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家販売制限付) | 188,174,367 |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド) | 128,372,175 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 85,180,134 |
| 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 |
| 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 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型 | 984,252 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|--------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 野村ドイツ・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 |
| 野村ドイツ・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 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型 | 984,252 |
| 野村ドイツ・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 |
| 野村ドイツ・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 |
| 野村テンプレートン・トータル・リターン Aコース | 983,381 |
| 野村テンプレートン・トータル・リターン Cコース | 983,381 |
| 野村テンプレートン・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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--------------------------------------|---------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 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 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型 | 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・イールド債券投信(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信(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信(中国元コース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村アジアCP投信(毎月分配型) | 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(中国元コース)毎月分配型 | 982,607 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--------------------------------------|---------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 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(豪ドルコース)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 |
| グローバル・ストック D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(ブラジルレアルコース)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(インドネシアルピアコース)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 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 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 |
| 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(豪ドルコース)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(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(豪ドルコース)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 |
| 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 |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース | 98,020 |

| ファンド名 | 当期末 |
|----------------------------------|--------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 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(インドルピーコース)年2回決算型 | 63,772 |
| 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(中国元コース)年2回決算型 | 41,054 |
| 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 |
| 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(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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|-------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 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。