

# 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

## 運用報告書(全体版)

第11期(決算日2022年12月19日)

作成対象期間(2022年6月21日~2022年12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。

|        |   |  |
|--------|---|--|
| 商品分類   | 追加型投信/海外/債券   |  |
| 信託期間   | 2017年8月18日から2027年6月18日までです。   |  |
| 運用方針   | 円建ての外国投資信託であるPIMCOパミュダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、米ドル建ての米国投資適格債券等(米国債、米国政府関連債、社債、モーゲージ関連証券、資産担保証券、優先証券等)および派生商品等を実質的な主要投資対象とし、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的として運用を行なうことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の場合においては、PIMCOパミュダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。 |  |
| 主な投資対象 | 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド<br>(為替ヘッジあり) 年2回決算型   | PIMCOパミュダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)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。 |
|        | PIMCOパミュダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス<br>野村マネー マザーファンド   | 米ドル建ての米国投資適格債券等(米国債、米国政府関連債、社債、モーゲージ関連証券、資産担保証券、優先証券等)および派生商品等を実質的な主要投資対象とします。<br>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PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド<br>(為替ヘッジあり) 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。   |
| 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利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、利子・配当等収益等および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              | 基準価額<br>(分配落) | 標準価額     |       | 債組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託<br>組入比率 | 純資産額  |
|------------------|---------------|----------|-------|-------|--------|--------------|-------|
|                  |               | 税金<br>分配 | 騰落率   |       |        |              |       |
|                  | 円             | 円        | %     | %     | %      | %            | 百万円   |
| 7期(2020年12月18日)  | 10,513        | 10       | 1.3   | 0.0   | —      | 99.1         | 2,615 |
| 8期(2021年6月18日)   | 10,268        | 10       | △2.2  | 0.0   | —      | 99.6         | 2,265 |
| 9期(2021年12月20日)  | 10,252        | 10       | △0.1  | 0.0   | —      | 99.4         | 2,165 |
| 10期(2022年6月20日)  | 8,833         | 0        | △13.8 | 0.0   | —      | 98.9         | 1,825 |
| 11期(2022年12月19日) | 8,591         | 0        | △2.7  | 0.0   | —      | 99.3         | 2,482 |

\* 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       | 標準価額   |          | 債組入比率  | 債券先物比率    | 投資信託<br>組入比率 |
|---------------------|------------|--------|----------|--------|-----------|--------------|
|                     |            | 騰落率    | 騰落率      |        |           |              |
| (期首)<br>2022年6月20日  | 円<br>8,833 | %<br>— | %<br>0.0 | %<br>— | %<br>98.9 |              |
| 6月末                 | 8,892      | 0.7    | 0.0      | —      | 99.1      |              |
| 7月末                 | 9,094      | 3.0    | 0.0      | —      | 99.2      |              |
| 8月末                 | 8,873      | 0.5    | 0.0      | —      | 99.3      |              |
| 9月末                 | 8,447      | △4.4   | 0.0      | —      | 97.7      |              |
| 10月末                | 8,272      | △6.4   | 0.0      | —      | 99.5      |              |
| 11月末                | 8,438      | △4.5   | 0.0      | —      | 99.4      |              |
| (期末)<br>2022年12月19日 | 8,591      | △2.7   | 0.0      | —      | 99.3      |              |

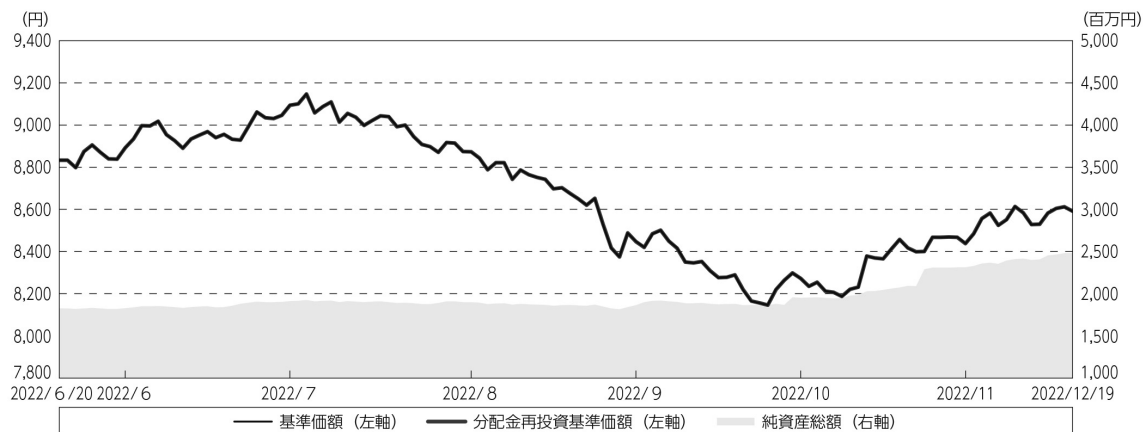
\* 騰落率は期首比です。

\* 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：8,833円

期 末：8,591円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△2.7%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作定期首（2022年6月20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債券等および派生商品等からのインカムゲイン（利息収入）

実質的に投資している債券等および派生商品等からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）

為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）

## ○投資環境

当作成期間においては、米国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。

当作成期初は、7月の米国PMI（購買担当者景気指数）が低下し景気後退懸念が高まったことや、米国の4－6月期の実質GDP（国内総生産）成長率が2四半期連続のマイナス成長となったことなどを背景に、利回りは低下（価格は上昇）しました。しかしその後は、米国のCPI（消費者物価指数）の上昇率が市場予想を上回り、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締めが長期化するとの見方が強まったことなどを背景に利回りは上昇しました。

当作成期末にかけて、10月の米CPIや米PPI（生産者物価指数）の上昇率が市場予想を下回ったことを受けて、FRBが利上げペースを緩めるとの観測が強まったことを背景に、利回りが低下した局面もありましたが、当作成期間では利回りは上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [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]

[PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス]の受益証券および[野村マネー マザーファンド]の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする[PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス]の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

### [PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス]

米ドル建ての米国投資適格債券等（米国債、米国政府関連債、社債、モーゲージ関連証券、資産担保証券、優先証券等）および派生商品等を主要投資対象とし、トータルリターンの最大化を目指して運用を行ないました。

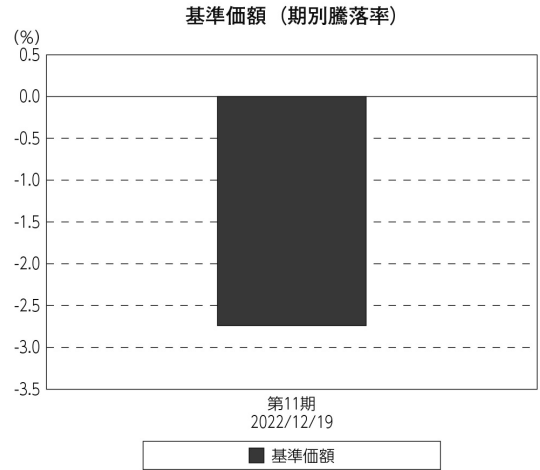
### [野村マネー マザーファンド]

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

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、決定しました。

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いません。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目       | 第11期                       |
|-----------|----------------------------|
|           | 2022年6月21日～<br>2022年12月19日 |
| 当期分配金     | —                          |
| (対基準価額比率) | —%                         |
| 当期の収益     | —                          |
| 当期の収益以外   | —                          |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,616                      |

(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】

[PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス]の受益証券および[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[PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス]受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

### 【PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス】

米ドル建ての米国投資適格債券等（米国債、米国政府関連債、社債、モーゲージ関連証券、資産担保証券、優先証券等）および派生商品等を主要投資対象とし、トータルリターンの最大化を図ることを目的としたポートフォリオを維持して運用を行ないます。また、原則として、純資産総額とほぼ同額程度の米ドルを売り、円を買う為替取引を行ないます。

インフレ圧力が根強く、主要中央銀行が引き締め的な金融政策を継続する中では、先進国は今後1年間で景気後退に陥る可能性が高いと考えています。先進国の中では英国は既に景気後退入りしている可能性が高く、次いでユーロ圏、そして米国とカナダも2023年前半には景気後退に転じると予想しています。過去のショック時と比較して既に政府債務や中央銀行のバランスシートが肥大化しているなか、金融・財政政策による景気へのサポート余地が限られていることから景気後退の期間は長期化し、その後の回復にも相応の時間を要するとみています。米国では、根強いインフレ圧力を背景にFRBによる積極的な利上げが続き、生活必需品の価格や借入コストの上昇が重しとなり消費の停滞が懸念されるなか、2023年前半には景気後退に陥る可能性が高いとみています。インフレ率については、住居費やサービスなどの幅広い項目において価格上昇が定着しつつあり、ピークアウトには相応の時間を要するものと考えております。一方、金融引き締めによるインフレ抑制の効果が現れるまでには時間を要することに加え、景気後退のリスクが高まっていることから、FRBは2022年12月以降、利上げペースを減速し、2023年には4.5%～5%程度の水準で利上げを休止すると予想しています。

運用戦略に関しては、米国の金利や主要先進国の金利などの市場動向に応じて、柔軟に変化させます。また、リスク及びリターン双方に配慮した資産配分を行ない、割安であると判断した債券の中から選別して投資を行ないます。

### 【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6月21日～2022年12月19日)

| 項 目                  | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                    |
|----------------------|---------|------------|--|
|                      | 金 額     | 比 率        |  |
| (a) 信 託 報 酬          | 円<br>61 | %<br>0.702 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                     |
| （ 投 信 会 社 ）          | (31)    | (0.357)    | 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 ）          | (29)    | (0.329)    | 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 ）          | ( 1)    | (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       | 0.001      | (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)    | (0.001)    | 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                  | 61      | 0.703      |  |
| 期中の平均基準価額は、8,669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。

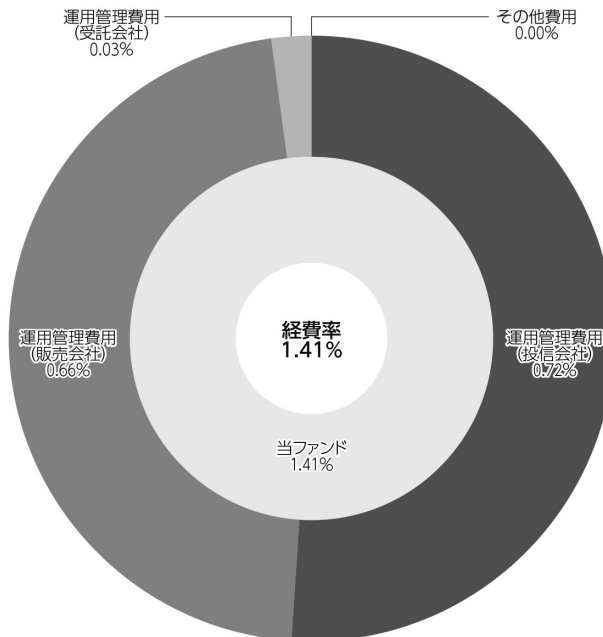
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 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1.41%です。



(単位：%)

| 経費率 (①+②)          | 1.41 |
|--------------------|------|
| ①当ファンドの費用の比率       | 1.41 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | —    |

(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6月21日～2022年12月19日)

## 投資信託証券

| 銘柄 |                                     | 買付      |         | 売付    |        |
|----|-------------------------------------|---------|---------|-------|--------|
|    |                                     | 口数      | 金額      | 口数    | 金額     |
| 国内 | PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス | 107,203 | 778,802 | 8,205 | 60,487 |

\*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6月21日～2022年12月19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

(2022年12月19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   |
| PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY,ヘッジ)クラス | 237,453 | 336,451 | 2,466,185 | 99.3 |
| 合計                                  | 237,453 | 336,451 | 2,466,185 | 99.3 |

\*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 | 9       | 9   | 9   |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年12月19日現在)

| 項 目           | 当 期 末           |           |
|---------------|-----------------|-----------|
|               | 評 価 額           | 比 率       |
| 投資信託受益証券      | 千円<br>2,466,185 | %<br>98.0 |
| 野村マネー マザーファンド | 9               | 0.0       |
| コール・ローン等、その他  | 50,073          | 2.0       |
| 投資信託財産総額      | 2,516,267       | 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12月19日現在)

| 項 目                | 当 期 末          |
|--------------------|----------------|
|                    | 円              |
| (A) 資産             | 2,516,267,561  |
| コール・ローン等           | 50,071,741     |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 2,466,185,830  |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 9,990          |
| (B) 負債             | 33,605,284     |
| 未払金                | 19,774,260     |
| 未払信託報酬             | 13,809,426     |
| 未払利息               | 79             |
| その他未払費用            | 21,519         |
| (C) 純資産総額(A-B)     | 2,482,662,277  |
| 元本                 | 2,889,741,512  |
| 次期繰越損益金            | △ 407,079,235  |
| (D) 受益権総口数         | 2,889,741,512口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 8,591円         |

(注) 期首元本額は2,066,260,115円、期中追加設定元本額は924,212,803円、期中一部解約元本額は100,731,406円、1口当たり純資産額は0.8591円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額3,889,138円。

## ○損益の状況 (2022年6月21日～2022年12月19日)

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | 31,411,863     |
| 受取配当金            | 31,421,193     |
| 支払利息             | △ 9,330        |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 55,086,038   |
| 売買益              | 3,019,827      |
| 売買損              | △ 58,105,865   |
| (C) 信託報酬等        | △ 13,830,945   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 37,505,120   |
| (E) 前期繰越損益金      | △212,040,606   |
| (F) 追加信託差損益金     | △157,533,509   |
| (配当等相当額)         | ( 215,006,370) |
| (売買損益相当額)        | (△372,539,879) |
| (G) 計(D+E+F)     | △407,079,235   |
| (H) 収益分配金        | 0              |
| 次期繰越損益金(G+H)     | △407,079,235   |
| 追加信託差損益金         | △157,533,509   |
| (配当等相当額)         | ( 215,006,370) |
| (売買損益相当額)        | (△372,539,879) |
| 分配準備積立金          | 252,126,314    |
| 繰越損益金            | △501,672,040   |

\*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6月21日～2022年12月19日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                        |
|------------------------------|----------------------------|
|                              | 2022年6月21日～<br>2022年12月19日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 17,580,935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             | 215,006,370円               |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 234,545,379円               |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 467,132,684円               |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 1,616円                     |
| g. 分配金                       | 0円                         |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 0円                         |

## ○分配金のお知らせ

|                |    |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金(税込み) | 0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。

# PIMCOバミューダ・US・コア・ファンド-J(JPY, ヘッジ)クラス

2022年6月30日決算

(計算期間：2021年7月1日～2022年6月30日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|                    |   |
|--------------------|---|
| 形態                 | 英領バミューダ諸島籍円建て外国投資信託   |
| 運用方針               | 米ドル建ての米国投資適格債券等(米国債、米国政府関連債、社債、モーゲージ関連証券、資産担保証券、優先証券等)および派生商品等に投資を行ない、トータルリターンの最大化を目指します。 |
| 投資対象               | 米ドル建ての米国投資適格債券等(米国債、米国政府関連債、社債、モーゲージ関連証券、資産担保証券、優先証券等)および派生商品等                            |
| 管理会社<br>投資顧問会社     | パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー   |
| 受託会社               | メイプルズ・トラスティ・サービシーズ(バミューダ)リミテッド  |
| 管理事務代行会社<br>保管受託銀行 | ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー   |
| 名義書換事務受託会社         | ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ)エス・シー・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6月30日に終了した期間

|                        | (単位：千) |         |
|------------------------|--------|---------|
| <b>収益</b>              |        |         |
| 受取利息(外国税額控除後)          | \$     | 618     |
| 配当金                    |        | 0       |
| 収益合計                   |        | 618     |
| <b>費用</b>              |        |         |
| 支払利息                   |        | 1       |
| 雑費用                    |        | 0       |
| 費用合計                   |        | 1       |
| <b>純投資損益</b>           |        | 617     |
| <b>当期実現損益</b>          |        |         |
| 投資有価証券(外国税額控除後)        |        | (763)   |
| 上場金融デリバティブ商品           |        | 11      |
| 店頭金融デリバティブ商品           |        | (4,837) |
| 外貨通貨                   |        | (3)     |
| 当期実現損益                 |        | (5,592) |
| <b>当期未実現評価損益</b>       |        |         |
| 投資有価証券(外国税額控除後)        |        | (3,055) |
| 上場金融デリバティブ商品           |        | (19)    |
| 店頭金融デリバティブ商品           |        | (864)   |
| 外貨建資産および負債             |        | 0       |
| 当期未実現評価損益              |        | (3,938) |
| 当期実現および未実現評価損益         |        | (9,530) |
| <b>運用の結果による純資産の増減額</b> | \$     | (8,913) |
| * 外国税額                 | \$     | 0       |

|                     | (単位：千 1口単位を除く) |        |
|---------------------|----------------|--------|
| <b>期末純資産総額</b>      |                |        |
| J (JPY, Hedged)     | \$             | 21,963 |
| <b>期末現在発行済受益証券数</b> |                |        |
| J (JPY, Hedged)     |                | 388    |
| <b>期末1口当たり純資産価格</b> |                |        |
| J (JPY, Hedged)     | \$             | 56.64  |

※PIMCOバミューダ・US・コア・ファンドの期末純資産額は21,973千米ドル。

## 組入資産の明細

2022年6月30日現在

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|----------------|---------------|
| <b>投資有価証券 128.7%</b>  |                |               |                |               |
| <b>社債・約束手形 41.4%</b>  |                |               |                |               |
| <b>銀行・金融 16.6%</b>  |                |               |                |               |
| <b>Alexandria Real Estate Equities, Inc.</b>                |                |               |                |               |
| 3.375% due 08/15/2031                                       | \$ 100         | \$ 89         |                |               |
| <b>American Campus Communities Operating Partnership LP</b> |                |               |                |               |
| 3.625% due 11/15/2027                                       | 90             | 88            |                |               |
| <b>AvalonBay Communities, Inc.</b>                          |                |               |                |               |
| 2.300% due 03/01/2030                                       | 100            | 86            |                |               |
| <b>Aviation Capital Group LLC</b>                           |                |               |                |               |
| 4.375% due 01/30/2024                                       | 100            | 98            |                |               |
| 4.875% due 10/01/2025                                       | 100            | 97            |                |               |
| <b>Bank of America Corp.</b>                                |                |               |                |               |
| 0.981% due 09/25/2025                                       | 100            | 93            |                |               |
| <b>Boston Properties LP</b>                                 |                |               |                |               |
| 2.750% due 10/01/2026                                       | 100            | 93            |                |               |
| <b>Citigroup, Inc.</b>                                      |                |               |                |               |
| 2.603% due 06/01/2024                                       | 100            | 99            |                |               |
| <b>CubeSmart LP</b>   |                |               |                |               |
| 3.000% due 02/15/2030                                       | 100            | 88            |                |               |
| <b>Equinix, Inc.</b>  |                |               |                |               |
| 1.550% due 03/15/2028                                       | 100            | 84            |                |               |
| <b>Franklin Resources, Inc.</b>                             |                |               |                |               |
| 1.600% due 10/30/2030                                       | 100            | 79            |                |               |
| <b>GLP Capital LP</b>                                       |                |               |                |               |
| 5.250% due 06/01/2025                                       | 100            | 98            |                |               |
| <b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>                            |                |               |                |               |
| 2.581% due 05/15/2026                                       | 100            | 98            |                |               |
| <b>Hanover Insurance Group, Inc.</b>                        |                |               |                |               |
| 2.500% due 09/01/2030                                       | 100            | 84            |                |               |
| <b>Intercontinental Exchange, Inc.</b>                      |                |               |                |               |
| 2.100% due 06/15/2030                                       | 100            | 84            |                |               |
| <b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>                             |                |               |                |               |
| 0.697% due 03/16/2024                                       | 100            | 98            |                |               |
| <b>LXP Industrial Trust</b>                                 |                |               |                |               |
| 2.375% due 10/01/2031                                       | 100            | 77            |                |               |
| <b>Mid-America Apartments LP</b>                            |                |               |                |               |
| 3.950% due 03/15/2029                                       | 100            | 96            |                |               |
| 4.200% due 06/15/2028                                       | 100            | 98            |                |               |
| <b>Morgan Stanley</b>                                       |                |               |                |               |
| 2.584% due 10/24/2023                                       | 100            | 100           |                |               |
| <b>New York Life Global Funding</b>                         |                |               |                |               |
| 1.200% due 08/07/2030                                       | 100            | 79            |                |               |
| <b>Nuveen Finance LLC</b>                                   |                |               |                |               |
| 4.125% due 11/01/2024                                       | 150            | 149           |                |               |
| <b>Physicians Realty LP</b>                                 |                |               |                |               |
| 4.300% due 03/15/2027                                       | 100            | 98            |                |               |
| <b>Public Storage</b>                                       |                |               |                |               |
| 3.094% due 09/15/2027                                       | 90             | 86            |                |               |
| <b>Realty Income Corp.</b>                                  |                |               |                |               |
| 4.875% due 06/01/2026                                       | 100            | 102           |                |               |
| <b>Reliance Standard Life Global Funding II</b>             |                |               |                |               |
| 3.850% due 09/19/2023                                       | 150            | 150           |                |               |
| <b>RGA Global Funding</b>                                   |                |               |                |               |
| 2.000% due 11/30/2026                                       | 100            | 91            |                |               |
| <b>Santander Holdings USA, Inc.</b>                         |                |               |                |               |
| 3.244% due 10/05/2026                                       | 200            | 188           |                |               |
| <b>SBA Tower Trust</b>                                      |                |               |                |               |
| 2.328% due 01/15/2028                                       | 100            | 89            |                |               |
| 3.869% due 10/08/2024                                       | 100            | 99            |                |               |
| <b>SL Green Operating Partnership LP</b>                    |                |               |                |               |
| 3.250% due 10/15/2022                                       | 100            | 100           |                |               |
| <b>Synchrony Financial</b>                                  |                |               |                |               |
| 5.150% due 03/19/2029                                       | 140            | 131           |                |               |
| <b>UDR, Inc.</b>  |                |               |                |               |
| 3.200% due 01/15/2030                                       | 100            | 90            |                |               |
| <b>Ventas Realty LP</b>                                     |                |               |                |               |
| 3.000% due 01/15/2030                                       | 100            | 88            |                |               |
| <b>Wells Fargo &amp; Co.</b>                                |                |               |                |               |
| 3.000% due 02/19/2025                                       | 100            | 98            |                |               |
| <b>Welltower, Inc.</b>                                      |                |               |                |               |
| 2.750% due 01/15/2031                                       | 100            | 84            |                |               |
| <b>WP Carey, Inc.</b>                                       |                |               |                |               |
| 4.250% due 10/01/2026                                       | 100            | 99            |                |               |
|   |                |               |                | <b>3,648</b>  |
| <b>工業 13.6%</b>   |                |               |                |               |
| <b>Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust</b>    |                |               |                |               |
| 4.800% due 08/15/2027                                       | 176            | 174           |                |               |
| <b>American Airlines 2019-1 Class A Pass-Through Trust</b>  |                |               |                |               |
| 3.500% due 02/15/2032                                       | 223            | 186           |                |               |
| <b>Amgen, Inc.</b>  |                |               |                |               |
| 2.600% due 08/19/2026                                       | 100            | 95            |                |               |
| <b>Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.</b>                 |                |               |                |               |
| 4.350% due 06/01/2040                                       | 100            | 90            |                |               |
| <b>Baptist Healthcare System Obligated Group</b>            |                |               |                |               |
| 3.540% due 08/15/2050                                       | 100            | 80            |                |               |
| <b>Beth Israel Lahey Health, Inc.</b>                       |                |               |                |               |
| 3.080% due 07/01/2051                                       | 100            | 73            |                |               |
| <b>British Airways 2019-1 Class A Pass-Through Trust</b>    |                |               |                |               |
| 3.350% due 06/15/2029                                       | 118            | 103           |                |               |
| <b>Broadcom, Inc.</b>                                       |                |               |                |               |
| 3.137% due 11/15/2035                                       | 201            | 153           |                |               |
| <b>CommonSpirit Health</b>                                  |                |               |                |               |
| 2.782% due 10/01/2030                                       | 100            | 87            |                |               |
| <b>Dell International LLC</b>                               |                |               |                |               |
| 5.450% due 06/15/2023                                       | 26             | 26            |                |               |
| <b>Fidelity National Information Services, Inc.</b>         |                |               |                |               |
| 1.150% due 03/01/2026                                       | 100            | 89            |                |               |
| <b>Fortune Brands Home &amp; Security, Inc.</b>             |                |               |                |               |
| 3.250% due 09/15/2029                                       | 100            | 87            |                |               |
| <b>GE Capital Funding LLC</b>                               |                |               |                |               |
| 4.400% due 05/15/2030                                       | 100            | 94            |                |               |
| <b>General Electric Co.</b>                                 |                |               |                |               |
| 1.743% due 05/05/2026                                       | 95             | 90            |                |               |
| <b>Hyundai Capital America</b>                              |                |               |                |               |
| 5.875% due 04/07/2025                                       | 80             | 83            |                |               |
| <b>Integrus Baptist Medical Center, Inc.</b>                |                |               |                |               |
| 3.875% due 08/15/2050                                       | 100            | 85            |                |               |
| <b>JetBlue 2019-1 Class AA Pass-Through Trust</b>           |                |               |                |               |
| 2.750% due 05/15/2032                                       | 89             | 77            |                |               |
| <b>Kraft Heinz Foods Co.</b>                                |                |               |                |               |
| 7.125% due 08/01/2039                                       | 100            | 112           |                |               |
| <b>Mylan, Inc.</b>  |                |               |                |               |
| 3.125% due 01/15/2023                                       | 200            | 199           |                |               |
| <b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>                      |                |               |                |               |
| 2.650% due 07/13/2022                                       | 200            | 200           |                |               |
| <b>Oracle Corp.</b>   |                |               |                |               |
| 2.800% due 04/01/2027                                       | 100            | 91            |                |               |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>Penske Truck Leasing Co. LP</b>                        |                |               |
| 4.125% due 08/01/2023                                     | 200            | 201           |
| <b>Reliance Steel &amp; Aluminum Co.</b>                  |                |               |
| 2.150% due 08/15/2030                                     | 100            | 81            |
| <b>Spirit AeroSystems, Inc.</b>                           |                |               |
| 3.950% due 06/15/2023                                     | 100            | 94            |
| <b>United Airlines 2012-1 Class A Pass-Through Trust</b>  |                |               |
| 4.150% due 04/11/2024                                     | 84             | 82            |
| <b>United Airlines 2019-1 Class AA Pass-Through Trust</b> |                |               |
| 4.150% due 08/25/2031                                     | 80             | 75            |
| <b>VMware, Inc.</b>                                       |                |               |
| 1.800% due 08/15/2028                                     | 100            | 83            |
| 3.900% due 08/21/2027                                     | 100            | 96            |
|   |                | <u>2,986</u>  |
| <b>公益事業 11.2%</b>   |                |               |
| <b>Ameren Illinois Co.</b>                                |                |               |
| 1.550% due 11/15/2030                                     | 100            | 81            |
| <b>American Water Capital Corp.</b>                       |                |               |
| 3.450% due 06/01/2029                                     | 100            | 94            |
| <b>Arizona Public Service Co.</b>                         |                |               |
| 2.600% due 08/15/2029                                     | 100            | 88            |
| 2.650% due 09/15/2050                                     | 100            | 64            |
| <b>AT&amp;T, Inc.</b>                                     |                |               |
| 2.750% due 06/01/2031                                     | 100            | 86            |
| 4.500% due 05/15/2035                                     | 100            | 95            |
| <b>Atmos Energy Corp.</b>                                 |                |               |
| 0.625% due 03/09/2023                                     | 100            | 98            |
| 1.500% due 01/15/2031                                     | 100            | 80            |
| <b>Avangrid, Inc.</b>                                     |                |               |
| 3.800% due 06/01/2029                                     | 100            | 94            |
| <b>Black Hills Corp.</b>                                  |                |               |
| 2.500% due 06/15/2030                                     | 100            | 84            |
| <b>Boston Gas Co.</b>                                     |                |               |
| 3.001% due 08/01/2029                                     | 150            | 133           |
| <b>CenterPoint Energy Resources Corp.</b>                 |                |               |
| 2.111% due 03/02/2023                                     | 56             | 56            |
| <b>Charter Communications Operating LLC</b>               |                |               |
| 2.250% due 01/15/2029                                     | 100            | 82            |
| <b>Continental Resources, Inc.</b>                        |                |               |
| 4.375% due 01/15/2028                                     | 100            | 94            |
| <b>Duke Energy Florida LLC</b>                            |                |               |
| 2.400% due 12/15/2031                                     | 100            | 86            |
| <b>Entergy Louisiana LLC</b>                              |                |               |
| 1.600% due 12/15/2030                                     | 100            | 80            |
| <b>Exelon Corp.</b>                                       |                |               |
| 3.950% due 06/15/2025                                     | 100            | 100           |
| <b>Georgia Power Co.</b>                                  |                |               |
| 3.250% due 03/15/2051                                     | 100            | 74            |
| <b>MidAmerican Energy Co.</b>                             |                |               |
| 2.700% due 08/01/2052                                     | 100            | 72            |
| <b>National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.</b> |                |               |
| 1.350% due 03/15/2031                                     | 100            | 78            |
| <b>New York State Electric &amp; Gas Corp.</b>            |                |               |
| 2.150% due 10/01/2031                                     | 90             | 74            |
| <b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>              |                |               |
| 1.775% due 02/22/2023                                     | 100            | 99            |
| 3.550% due 05/01/2027                                     | 150            | 145           |
| <b>Occidental Petroleum Corp.</b>                         |                |               |
| 6.950% due 07/01/2024                                     | 100            | 103           |
| <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>                     |                |               |
| 1.700% due 11/15/2023                                     | 80             | 77            |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>Rochester Gas &amp; Electric Corp.</b>   |                |               |
| 1.850% due 12/01/2030   | 100            | 80            |
| <b>Southern Power Co.</b>   |                |               |
| 0.900% due 01/15/2026   | 100            | 89            |
| <b>WEC Energy Group, Inc.</b>   |                |               |
| 1.800% due 10/15/2030   | 100            | 81            |
|   |                | <u>2,467</u>  |
| <b>社債・約束手形合計<br/>(取得原価 \$10,099)</b>  |                |               |
| <b>地方債・約束手形 2.0%</b>  |                |               |
| <b>Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015</b>                                 |                |               |
| 7.750% due 01/01/2042   | 16             | 17            |
| <b>Chicago, Illinois, Sales Tax Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2020</b>             |                |               |
| 3.057% due 01/01/2034   | 100            | 88            |
| <b>Florida, State Board of Administration Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2020</b>          |                |               |
| 1.705% due 07/01/2027   | 100            | 91            |
| <b>New York State Urban Development Corp. Income Tax Revenue Bonds, Series 2020</b>             |                |               |
| 1.827% due 03/15/2029   | 100            | 87            |
| <b>Sacramento, California, Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2020</b> |                |               |
| 1.979% due 06/01/2030   | 200            | 171           |
|   |                | <u>454</u>    |
| <b>地方債・約束手形合計<br/>(取得原価 \$517)</b>  |                |               |
| <b>米国政府機関債 49.2%</b>  |                |               |
| <b>Fannie Mae</b>   |                |               |
| 2.074% due 06/25/2059   | 182            | 182           |
| 2.358% due 01/25/2031 (b)   | 590            | 69            |
| 3.500% due 09/01/2047   | 218            | 213           |
| 3.500% due 10/01/2047   | 238            | 233           |
| <b>Fannie Mae, TBA (c)</b>  |                |               |
| 3.000% due 07/01/2052   | 3,200          | 2,981         |
| 3.500% due 08/01/2052   | 2,600          | 2,498         |
| 4.000% due 08/01/2052   | 700            | 689           |
| 4.500% due 07/01/2052   | 100            | 100           |
| <b>Federal Home Loan Bank</b>   |                |               |
| 0.960% due 03/05/2026   | 800            | 737           |
| 1.115% due 02/26/2027   | 1,100          | 1,002         |
| <b>Freddie Mac</b>  |                |               |
| 0.650% due 10/27/2025   | 400            | 368           |
| 0.800% due 10/28/2026   | 400            | 359           |
| 3.500% due 02/01/2046   | 420            | 410           |
| <b>Ginnie Mae</b>   |                |               |
| 1.032% due 09/20/2067   | 116            | 116           |
| 1.253% due 04/20/2065   | 32             | 32            |
| 1.303% due 07/20/2067   | 90             | 90            |
| 1.383% due 07/20/2062   | 39             | 39            |
| 1.412% due 05/20/2047   | 55             | 55            |
| 1.433% due 03/20/2065   | 142            | 141           |
| 1.503% due 04/20/2070   | 125            | 123           |
| 1.653% due 04/20/2066   | 217            | 216           |
| 2.053% due 08/20/2070   | 148            | 151           |
| 4.500% due 08/20/2048   | 5              | 5             |
|   |                | <u>10,809</u> |
| <b>米国政府機関債合計<br/>(取得原価 \$11,140)</b>  |                |               |

|  | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|--|----------------|---------------|
| <b>国庫債券 18.9%</b>  |                |               |
| <b>U.S. Treasury Bonds</b>                                       |                |               |
| 1.375% due 11/15/2040  | 100            | 72            |
| 1.375% due 08/15/2050  | 300            | 198           |
| 2.375% due 02/15/2042  | 100            | 85            |
| 2.500% due 02/15/2046  | 50             | 42            |
| 2.875% due 05/15/2049  | 240            | 224           |
| 3.000% due 02/15/2048  | 340            | 320           |
| 3.125% due 08/15/2044  | 300            | 284           |
| 3.250% due 05/15/2042  | 140            | 137           |
| 3.375% due 05/15/2044  | 100            | 99            |
| 3.625% due 08/15/2043  | 350            | 360           |
| 4.375% due 05/15/2041  | 1,350          | 1,547         |
| <b>U.S. Treasury Notes</b>                                       |                |               |
| 2.875% due 05/15/2032  | 800            | 791           |
| <b>国庫債券合計</b>  |                | <b>4,159</b>  |
| (取得原価 \$4,650)   |                |               |
| <b>モーゲージ担保証券 11.8%</b>   |                |               |
| <b>Ashford Hospitality Trust</b>                                 |                |               |
| 2.325% due 06/15/2035  | 200            | 194           |
| <b>BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust</b>                |                |               |
| 2.374% due 04/15/2036  | 100            | 98            |
| 2.374% due 09/15/2038  | 100            | 97            |
| <b>BBCMS Trust</b>   |                |               |
| 2.324% due 07/15/2037  | 100            | 97            |
| <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>                |                |               |
| 2.524% due 12/25/2042  | 7              | 7             |
| <b>BX Trust</b>  |                |               |
| 2.411% due 10/15/2036  | 100            | 97            |
| <b>Commercial Mortgage Trust</b>                                 |                |               |
| 3.545% due 02/10/2036  | 100            | 95            |
| <b>CRSNT Trust</b>   |                |               |
| 2.150% due 04/15/2036  | 100            | 97            |
| <b>CSAIL Commercial Mortgage Trust</b>                           |                |               |
| 3.903% due 03/15/2052  | 100            | 99            |
| <b>DBGS Mortgage Trust</b>                                       |                |               |
| 3.843% due 04/10/2037  | 150            | 141           |
| <b>Downey Savings &amp; Loan Association Mortgage Loan Trust</b> |                |               |
| 2.699% due 07/19/2044  | 13             | 12            |
| <b>DROP Mortgage Trust</b>                                       |                |               |
| 2.470% due 10/15/2043  | 100            | 97            |
| <b>Extended Stay America Trust</b>                               |                |               |
| 2.405% due 07/15/2038  | 99             | 97            |
| <b>GCT Commercial Mortgage Trust</b>                             |                |               |
| 2.124% due 02/15/2038  | 100            | 97            |
| <b>GS Mortgage-Backed Securities Trust</b>                       |                |               |
| 3.000% due 08/26/2052  | 98             | 87            |
| <b>Home Equity Asset Trust</b>                                   |                |               |
| 2.404% due 10/25/2034  | 44             | 44            |
| 2.404% due 01/25/2035  | 9              | 9             |
| <b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>       |                |               |
| 2.774% due 12/15/2031  | 53             | 53            |
| <b>JPMorgan Mortgage Trust</b>                                   |                |               |
| 3.500% due 10/25/2048  | 54             | 51            |
| <b>LUXE Trust</b>  |                |               |
| 2.374% due 10/15/2038  | 100            | 96            |
| <b>Manhattan West Mortgage Trust</b>                             |                |               |
| 2.130% due 09/10/2039  | 100            | 88            |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                    |                |               |
| 2.244% due 08/25/2028  | 16             | 15            |

|   | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |
|---|----------------|---------------|
| <b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b> |                |               |
| 3.732% due 05/15/2048                                     | 100            | 98            |
| <b>Morgan Stanley Capital I</b>                           |                |               |
| 3.587% due 12/15/2050                                     | 100            | 97            |
| <b>Morgan Stanley Capital II Trust</b>                    |                |               |
| 2.509% due 04/05/2042                                     | 100            | 84            |
| <b>Ready Capital Mortgage Financing LLC</b>               |                |               |
| 2.574% due 07/25/2036                                     | 100            | 96            |
| <b>SREIT Trust</b>  |                |               |
| 2.024% due 10/15/2038                                     | 100            | 95            |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments II Trust</b>     |                |               |
| 2.285% due 10/19/2034                                     | 15             | 13            |
| <b>Towd Point HE Trust</b>                                |                |               |
| 0.918% due 02/25/2063                                     | 64             | 61            |
| <b>UWM Mortgage Trust</b>                                 |                |               |
| 1.926% due 09/25/2051                                     | 93             | 88            |
| <b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>              |                |               |
| 3.311% due 06/15/2052                                     | 100            | 94            |
| <b>Worldwide Plaza Trust</b>                              |                |               |
| 3.526% due 11/10/2036                                     | 100            | 93            |
| <b>モーゲージ担保証券合計</b>  |                | <b>2,587</b>  |
| (取得原価 \$2,763)  |                |               |
| <b>資産担保証券 2.5%</b>  |                |               |
| <b>GLS Auto Receivables Issuer Trust</b>                  |                |               |
| 1.580% due 08/15/2024                                     | 8              | 8             |
| <b>Hertz Vehicle Financing LLC</b>                        |                |               |
| 3.730% due 09/25/2026                                     | 100            | 98            |
| 3.890% due 09/25/2028                                     | 100            | 97            |
| <b>SLC Student Loan Trust</b>                             |                |               |
| 1.939% due 03/15/2027                                     | 3              | 3             |
| <b>SLM Private Credit Student Loan Trust</b>              |                |               |
| 2.159% due 06/15/2039                                     | 96             | 92            |
| <b>SLM Student Loan Trust</b>                             |                |               |
| 1.304% due 01/25/2027                                     | 35             | 34            |
| 1.334% due 10/25/2029                                     | 128            | 127           |
| <b>Sunrun Demeter Issuer LLC</b>                          |                |               |
| 2.270% due 01/30/2057                                     | 98             | 82            |
| <b>資産担保証券合計</b>   |                | <b>541</b>    |
| (取得原価 \$566)  |                |               |
| <b>短期金融商品 2.9%</b>  |                |               |
| <b>短期約束手形 0.8%</b>  |                |               |
| <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>                     |                |               |
| 1.415% due 11/14/2022 (d)                                 | 100            | 100           |
| <b>Southern California Edison Co.</b>                     |                |               |
| 0.868% due 12/02/2022 (d)                                 | 80             | 80            |
|   |                | <b>180</b>    |
| <b>定期預金 2.1%</b>  |                |               |
| <b>Australia and New Zealand Banking Group Ltd.</b>       |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                                     | 11             | 11            |
| <b>Bank of Nova Scotia</b>                                |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                                     | 16             | 16            |
| <b>Citibank N.A.</b>                                      |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                                     | 63             | 63            |
| <b>DBS Bank Ltd.</b>                                      |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                                     | 54             | 54            |
| <b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>                           |                |               |
| 1.060% due 07/01/2022                                     | 127            | 127           |



|  | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千) |                            | 額面金額<br>(単位：千) | 評価額<br>(単位：千)    |
|--|----------------|---------------|----------------------------|----------------|------------------|
| <b>MUFG Bank Ltd.</b>                  |                |               |                            |                |                  |
| (0.360%) due 07/01/2022                | ¥              | 30            |                            |                |                  |
| <b>Royal Bank of Canada</b>            |                |               | <b>投資有価証券合計 (a)</b>        | <b>128.7%</b>  | <b>\$ 28,286</b> |
| 1.060% due 07/01/2022                  | \$             | 6             | (取得原価 \$30,371)            |                |                  |
| <b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>   |                |               | <b>金融デリバティブ商品 (6.6%)</b>   |                | <b>(1,445)</b>   |
| (0.360%) due 07/01/2022                | ¥              | 26            | (取得原価またはプレミアム \$(32))      |                |                  |
| 1.060% due 07/01/2022                  | \$             | 56            | <b>その他の資産および負債 (22.1%)</b> |                | <b>(4,868)</b>   |
| <b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b> |                |               | <b>純資産 100.0%</b>          |                | <b>\$ 21,973</b> |
| (0.360%) due 07/01/2022                | ¥              | 118           |                            |                |                  |
| 1.060% due 07/01/2022                  | \$             | 121           |                            |                |                  |
|  |                | <u>455</u>    |                            |                |                  |
| <b>短期金融商品合計</b>                        |                | <b>635</b>    |                            |                |                  |
| (取得原価 \$636)                           |                |               |                            |                |                  |

(a) 2022年6月30日現在の地域別投資有価証券の配分は、米国が純資産の127.5%、その他の国が純資産の1.2%である。

(b) 有価証券はインタレスト・オンリー(「IO」)すなわちIOストリップである。

(c) 発行日取引証券

(d) クーボンは最終利回りである。

## ◎借入およびその他の金融取引

2022年6月30日現在

### ●空売り

単位：千

| 取引相手                | 銘柄              | クーポン   | 満期日        | 元本金額   | 代り金             | 空売りに係る未払金       |
|---------------------|-----------------|--------|------------|--------|-----------------|-----------------|
| BCY                 | Fannie Mae, TBA | 3.500% | 07/01/2052 | \$ 200 | \$ (188)        | \$ (192)        |
| MSC                 | Fannie Mae, TBA | 3.500% | 07/01/2052 | 500    | (468)           | (481)           |
| <b>空売り合計 (3.1%)</b> |                 |        |            |        | <b>\$ (656)</b> | <b>\$ (673)</b> |

## ◎金融デリバティブ商品

2022年6月30日現在

### ●売建オプション

## 取引所先物契約に係るオプション

単位：千(契約数を除く)

| 銘柄   | 行使価格      | 満期日        | 契約数 | プレミアム(受取)     | 市場価格          |
|--|-----------|------------|-----|---------------|---------------|
| Put - 3-Month Eurodollar December 2023 Futures | \$ 96.500 | 12/18/2023 | 6   | \$ (6)        | \$ (9)        |
| <b>売建オプション合計</b>                               |           |            |     | <b>\$ (6)</b> | <b>\$ (9)</b> |

### ●先物契約

単位：千(契約数を除く)

| 銘柄   | 種類    | 満期日     | 契約数 | 未実現<br>評価損益  | 変動証拠金       |                |
|--|-------|---------|-----|--------------|-------------|----------------|
|  |       |         |     |              | 資産          | 負債             |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures  | Short | 09/2022 | 26  | \$ 14        | \$ 0        | \$ (15)        |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2022 | 5   | (10)         | 0           | (4)            |
| U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 5   | 7            | 0           | (5)            |
| <b>先物契約合計</b>                                |       |         |     | <b>\$ 11</b> | <b>\$ 0</b> | <b>\$ (24)</b> |

## ●スワップ契約

社債、ソブリン債および米国地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ・プロテクションの売り<sup>(1)</sup>

単位：千

| 参照組織                            | 受取固定金利 | 満期日        | 2022年6月30日の<br>インフラ・クレジット・<br>スプレッド <sup>(2)</sup> | 想定元本 <sup>(4)</sup> | 市場価格 | 未実現<br>評価損益 | 変動証拠金   |      |        |
|---------------------------------|--------|------------|--|---------------------|------|-------------|---------|------|--------|
|                                 |        |            |  |                     |      |             | 資産      | 負債   |        |
| Boeing Co.                      | 1.000% | 06/20/2023 | 1.520%   | \$ 100              | \$ 0 | \$ (1)      | \$ 0    | \$ 0 |        |
| Boeing Co.                      | 1.000% | 12/20/2026 | 2.445%   | 100                 | (6)  | (5)         | 0       | 0    |        |
| General Motors Co.              | 5.000% | 12/20/2026 | 2.634%   | 70                  | 7    | (7)         | 0       | 0    |        |
| Verizon<br>Communications, Inc. | 1.000% | 12/20/2026 | 1.198%   | 100                 | (1)  | (3)         | 0       | 0    |        |
| Williams Cos., Inc.             | 1.000% | 12/20/2026 | 1.140%   | 100                 | (1)  | (1)         | 0       | (1)  |        |
|                                 |        |            |  |                     |      | \$ (1)      | \$ (17) | \$ 0 | \$ (1) |

クレジット・インデックスのクレジット・デフォルト・スワップ・プロテクションの買い<sup>(2)</sup>

単位：千

| インデックス/トランシェ    | 固定金利<br>(支払) | 満期日        | 想定元本 <sup>(4)</sup> | 市場価格 <sup>(5)</sup> | 未実現<br>評価損益 | 変動証拠金 |      |
|-----------------|--------------|------------|---------------------|---------------------|-------------|-------|------|
|                 |              |            |                     |                     |             | 資産    | 負債   |
| CDX.IG-38 Index | (1.000%)     | 06/20/2027 | \$ 3,600            | \$ 0                | \$ 0        | \$ 1  | \$ 0 |

## 金利スワップ

単位：千

| 変動金利<br>支払/受取     | 変動金利インデックス                       | 固定金利   | 満期日        | 想定元本     | 市場価格    | 未実現<br>評価損益  | 変動証拠金          |              |               |
|-------------------|----------------------------------|--------|------------|----------|---------|--------------|----------------|--------------|---------------|
|                   |                                  |        |            |          |         |              | 資産             | 負債           |               |
| 支払 <sup>(6)</sup> | 3-Month USD-LIBOR                | 1.270% | 11/04/2023 | \$ 1,800 | \$ (41) | \$ (8)       | \$ 2           | \$ 0         |               |
| 支払 <sup>(6)</sup> | Secured Overnight Financing Rate | 1.320% | 12/21/2023 | 600      | (11)    | (8)          | 1              | 0            |               |
| 支払 <sup>(6)</sup> | Secured Overnight Financing Rate | 3.300% | 12/21/2023 | 600      | 0       | 0            | 1              | 0            |               |
| 支払 <sup>(6)</sup> | Secured Overnight Financing Rate | 3.530% | 06/21/2024 | 3,400    | 16      | 16           | 5              | 0            |               |
| 支払 <sup>(6)</sup> | Secured Overnight Financing Rate | 3.130% | 06/21/2025 | 1,200    | 6       | 6            | 2              | 0            |               |
| 支払                | Secured Overnight Financing Rate | 1.788% | 05/03/2027 | 200      | (9)     | (9)          | 1              | 0            |               |
| 支払                | Secured Overnight Financing Rate | 2.150% | 06/15/2027 | 500      | (14)    | (15)         | 3              | 0            |               |
| 受取 <sup>(6)</sup> | Secured Overnight Financing Rate | 1.750% | 12/21/2052 | 400      | 72      | (10)         | 0              | (4)          |               |
|                   |                                  |        |            |          |         | \$ 19        | \$ (28)        | \$ 15        | \$ (4)        |
| <b>スワップ契約合計</b>   |                                  |        |            |          |         | <b>\$ 18</b> | <b>\$ (45)</b> | <b>\$ 16</b> | <b>\$ (5)</b> |

- If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- If the Fund is a buyer of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) receive from the seller of protection an amount equal to the notional amount of the swap and deliver the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) receive a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.
- Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.
- The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.
- This instrument has a forward starting effective date.

## ◎店頭金融デリバティブ商品

2022年6月30日現在

## ●外国為替先渡し契約

単位：千

| 取引相手 | 決済月     | 受渡通貨    | 受取通貨 | 未実現評価損益     |             |
|------|---------|---------|------|-------------|-------------|
|      |         |         |      | 資産          | 負債          |
| HUS  | 07/2022 | JPY 989 | \$ 7 | \$ 0        | \$ 0        |
| MYI  | 07/2022 | 989     | 7    | 0           | 0           |
|      |         |         |      | <b>\$ 0</b> | <b>\$ 0</b> |

## ●J(JPY, Hedged)の外国為替先渡し契約

単位：千

| 取引相手               | 決済月     | 受渡通貨          | 受取通貨          | 未実現評価損益      |                   |
|--------------------|---------|---------------|---------------|--------------|-------------------|
|                    |         |               |               | 資産           | 負債                |
| BOA                | 07/2022 | JPY 7,961     | \$ 60         | \$ 1         | \$ 0              |
| BPS                | 07/2022 | 1,036,954     | 7,637         | 4            | 0                 |
| BPS                | 07/2022 | \$ 8,311      | JPY 1,068,353 | 0            | (447)             |
| BPS                | 08/2022 | 7,224         | 979,733       | 0            | 0                 |
| MBC                | 07/2022 | JPY 157,907   | \$ 1,158      | 0            | (4)               |
| MBC                | 07/2022 | 1,016         | 7             | 0            | 0                 |
| MBC                | 07/2022 | \$ 7          | JPY 1,016     | 0            | 0                 |
| MBC                | 07/2022 | 733           | 93,242        | 0            | (47)              |
| MBC                | 08/2022 | 1,166         | 158,668       | 4            | 0                 |
| MYI                | 07/2022 | JPY 438,944   | \$ 3,226      | 0            | (5)               |
| MYI                | 07/2022 | \$ 7          | JPY 1,010     | 0            | 0                 |
| MYI                | 08/2022 | 2,563         | 348,393       | 6            | 0                 |
| RBC                | 07/2022 | JPY 242,031   | \$ 1,782      | 0            | 0                 |
| RBC                | 08/2022 | \$ 1,782      | JPY 241,626   | 0            | 0                 |
| SCX                | 07/2022 | JPY 1,005,374 | \$ 7,390      | 0            | (10)              |
| SCX                | 07/2022 | \$ 8,158      | JPY 1,048,444 | 0            | (441)             |
| SCX                | 08/2022 | 7,390         | 1,003,726     | 11           | 0                 |
| TOR                | 07/2022 | JPY 292,241   | \$ 2,164      | 13           | 0                 |
| TOR                | 07/2022 | \$ 7,155      | JPY 908,140   | 0            | (470)             |
| TOR                | 08/2022 | 2,164         | 291,772       | 0            | (13)              |
|                    |         |               |               | \$ 39        | \$ (1,437)        |
| <b>外国為替先渡し契約合計</b> |         |               |               | <b>\$ 39</b> | <b>\$ (1,437)</b> |

●売建オプション  
金利スワップション

単位：千

| 取引相手 | 銘柄                                       | 変動金利指標                              | 変動金利の<br>支払/受取 | 行使金利   | 満期日        | 想定元本 <sup>(1)</sup> | プレミアム<br>(受取)  | 市場価格           |
|------|--|-------------------------------------|----------------|--------|------------|---------------------|----------------|----------------|
| GLM  | Call - OTC 1-Year<br>Interest Rate Swap  | Secured Overnight<br>Financing Rate | 受取             | 2.250% | 11/17/2023 | 300                 | \$ (1)         | \$ (1)         |
| GLM  | Call - OTC 7-Year<br>Interest Rate Swap  | Secured Overnight<br>Financing Rate | 受取             | 2.500% | 09/07/2022 | 100                 | (1)            | (1)            |
| GLM  | Call - OTC 10-Year<br>Interest Rate Swap | Secured Overnight<br>Financing Rate | 受取             | 2.310% | 08/19/2022 | 200                 | (2)            | 0              |
| GLM  | Put - OTC 1-Year<br>Interest Rate Swap   | Secured Overnight<br>Financing Rate | 支払             | 3.750% | 11/17/2023 | 300                 | (1)            | (1)            |
| GLM  | Put - OTC 7-Year<br>Interest Rate Swap   | Secured Overnight<br>Financing Rate | 支払             | 3.100% | 09/07/2022 | 100                 | (1)            | (1)            |
| GLM  | Put - OTC 10-Year<br>Interest Rate Swap  | Secured Overnight<br>Financing Rate | 支払             | 3.010% | 08/19/2022 | 200                 | (2)            | (2)            |
| MYC  | Call - OTC 1-Year<br>Interest Rate Swap  | Secured Overnight<br>Financing Rate | 受取             | 2.993% | 10/11/2023 | 600                 | (4)            | (4)            |
| MYC  | Put - OTC 1-Year<br>Interest Rate Swap   | Secured Overnight<br>Financing Rate | 支払             | 2.993% | 10/11/2023 | 600                 | (4)            | (3)            |
| NGF  | Call - OTC 1-Year<br>Interest Rate Swap  | Secured Overnight<br>Financing Rate | 受取             | 3.020% | 11/06/2023 | 500                 | (3)            | (4)            |
| NGF  | Put - OTC 1-Year<br>Interest Rate Swap   | Secured Overnight<br>Financing Rate | 支払             | 3.020% | 11/06/2023 | 500                 | (3)            | (3)            |
|      |  |                                     |                |        |            |                     | <b>\$ (22)</b> | <b>\$ (20)</b> |

## 有価証券に係るオプション

単位：千

| 取引相手             | 銘柄                 | 行使価格      | 満期日        | 想定元本 <sup>(1)</sup> | プレミアム<br>(受取)  | 市場価格           |
|------------------|--------------------|-----------|------------|---------------------|----------------|----------------|
| SAL              | Put - Fannie Mae** | \$ 96.000 | 07/07/2022 | 100                 | \$ 0           | \$ 0           |
| SAL              | Put - Fannie Mae** | 99.773    | 08/04/2022 | 500                 | (1)            | (2)            |
| SAL              | Put - Fannie Mae** | 97.750    | 09/07/2022 | 300                 | (2)            | (1)            |
| SAL              | Put - Fannie Mae** | 99.406    | 09/07/2022 | 200                 | (1)            | (2)            |
|                  |                    |           |            |                     | <b>\$ (4)</b>  | <b>\$ (5)</b>  |
| <b>売建オプション合計</b> |                    |           |            |                     | <b>\$ (26)</b> | <b>\$ (25)</b> |

\*\* 発行日取引オプション

(1) 想定元本は契約数を表す。

# 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 |      | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純総資産額  |
|-----------------|--------|----|------|-------|--------|--------|
|                 |        | 騰落 | 中率   |       |        |        |
|                 | 円      |    | %    | %     | %      | 百万円    |
| 16期(2018年8月20日) | 10,206 |    | △0.0 | 38.7  | —      | 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

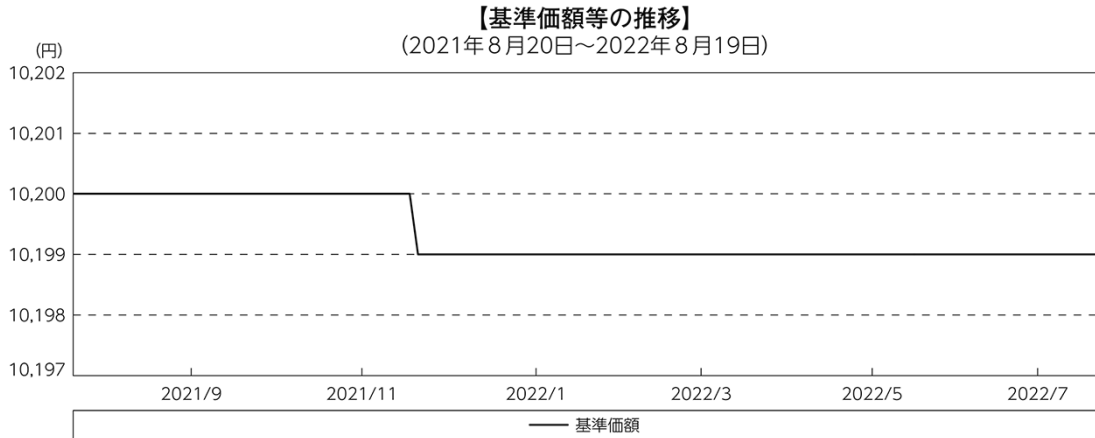
| 年月日                | 基準     | 価額 |      | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|----|------|-------|--------|
|                    |        | 騰落 | 率    |       |        |
| (期首)<br>2021年8月19日 | 円      |    | %    | %     | %      |
|                    | 10,200 |    | —    | 60.1  | —      |
| 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)<br>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。

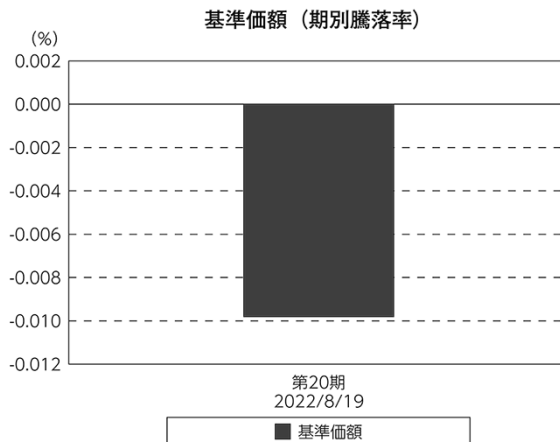
## ○当ファンドのポートフォリオ

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<br>4,055,682 | 千円<br>—<br>(4,600,000) |
|    | 特殊債券           | 7,031,417       | —<br>(6,457,000)       |
|    | 社債券（投資法人債券を含む） | 2,136,048       | —<br>(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<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B |               | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |               |
|-----|---------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     |               | 百万円                | $\frac{B}{A}$ |           | 百万円                | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円<br>13,223 | 百万円<br>30          | %<br>0.2      | 百万円<br>—  | 百万円<br>—           | %<br>—        |

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。

(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<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               | 750,000<br>( 750,000)    | 750,520<br>( 750,520)    | 9.6<br>( 9.6)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 9.6<br>( 9.6)  |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 2,430,000<br>(2,430,000) | 2,431,889<br>(2,431,889) | 31.0<br>(31.0) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 31.0<br>(31.0) |
| 金融債券                | 530,000<br>( 530,000)    | 530,049<br>( 530,049)    | 6.8<br>( 6.8)  | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 6.8<br>( 6.8)  |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 800,000<br>( 800,000)    | 800,923<br>( 800,923)    | 10.2<br>(10.2) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 10.2<br>(10.2) |
| 合 計                 | 4,510,000<br>(4,510,000) | 4,513,382<br>(4,513,382) | 57.5<br>(57.5) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 57.5<br>(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       |           | 評 価 額      | 償 還 年 月 日 |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|-----------|
|                             |       | 額 面 金 額   | 末         |            |           |
| <b>地方債証券</b>                | %     | 千円        | 千円        |            |           |
| 東京都 公募第711回                 | 0.82  | 300,000   | 300,218   | 2022/9/20  |           |
| 福岡県 公募平成24年度第4回             | 0.84  | 50,000    | 50,007    | 2022/8/24  |           |
| 千葉県 公募平成24年度第5回             | 0.82  | 100,000   | 100,074   | 2022/9/22  |           |
| 共同発行市場地方債 公募第114回           | 0.82  | 300,000   | 300,220   | 2022/9/22  |           |
| 小 計                         |       | 750,000   | 750,520   |            |           |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>          |       |           |           |            |           |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第96回 | 0.796 | 300,000   | 300,221   | 2022/9/20  |           |
| 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   | 2022/9/20  |           |
| 地方公共団体金融機構債券 第40回           | 0.825 | 110,000   | 110,101   | 2022/9/28  |           |
| 地方公共団体金融機構債券 第41回           | 0.801 | 100,000   | 100,146   | 2022/10/28 |           |
| 地方公共団体金融機構債券 第42回           | 0.801 | 40,000    | 40,086    | 2022/11/28 |           |
| 日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債        | 0.825 | 300,000   | 300,456   | 2022/10/26 |           |
| 都市再生債券 財投機関債第68回            | 0.854 | 200,000   | 200,159   | 2022/9/20  |           |
| 都市再生債券 財投機関債第71回            | 0.767 | 200,000   | 200,131   | 2022/9/20  |           |
| 日本学生支援債券 財投機関債第60回          | 0.001 | 300,000   | 300,000   | 2022/9/20  |           |
| 日本学生支援債券 財投機関債第61回          | 0.001 | 100,000   | 100,000   | 2022/11/18 |           |
| 国際協力機構債券 第14回財投機関債          | 0.825 | 300,000   | 300,221   | 2022/9/20  |           |
| 東日本高速道路 第48回                | 0.09  | 100,000   | 100,032   | 2022/12/20 |           |
| 西日本高速道路 第37回                | 0.09  | 130,000   | 130,016   | 2022/9/20  |           |
| 西日本高速道路 第38回                | 0.09  | 100,000   | 100,010   | 2022/9/20  |           |
| 小 計                         |       | 2,430,000 | 2,431,889 |            |           |
| <b>金融債券</b>                 |       |           |           |            |           |
| 商工債券 利付第811回い号              | 0.17  | 30,000    | 30,018    | 2022/12/27 |           |
| しんきん中金債券 利付第333回            | 0.09  | 200,000   | 200,011   | 2022/8/26  |           |
| 商工債券 利付(3年)第236回            | 0.02  | 300,000   | 300,019   | 2022/9/27  |           |
| 小 計                         |       | 530,000   | 530,049   |            |           |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>      |       |           |           |            |           |
| 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   | 2022/9/9   |           |
| 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   | 2022/10/27 |           |
| 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   | 2022/8/30  |           |
| 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   | 2022/9/14  |           |
| 電源開発 第35回社債間限定同順位特約付        | 1.126 | 100,000   | 100,193   | 2022/10/20 |           |
| 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       |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 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<br>元本額    |
|--|---------------|
|  | 円             |
| 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) | 1,997,050,289 |
| 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) | 1,941,761,887 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(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(マネーパブル・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(マネーパブル・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       |

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額 |
|---------------------------------------|------------|
|                                       | 円          |
| 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CB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(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 |
| 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 |
| 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(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  |
| 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)のむらップ・ファンド(普通型)         | 98,001 |
| (年6%目標払出)のむらップ・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 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Aコース                  | 9,797 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Bコース                  | 9,797 |
| 野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Cコース                  | 9,797 |
| 野村ウェスタン・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。