

# 財形給付金ファンド

## 運用報告書(全体版)

第43期（決算日2018年10月19日）

作成対象期間（2017年10月20日～2018年10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／国内／債券   |  |
| 信託期間   | 1975年10月20日以降、無期限とします。  |  |
| 運用方針   | 公社債および野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、勤労者財産形成給付金制度および勤労者財産形成基金制度のための専用ファンドとして、安定した収益の確保を基本目標とします。 |  |
| 主な投資対象 | 財形給付金ファンド   | 公社債および野村マネーポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
|        | 野村マネーポートフォリオ 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 | 財形給付金ファンド   | 外貨建て資産への投資は行いません。                          |
|        | 野村マネーポートフォリオ マザーファンド  | 株式への投資は行いません。                              |
| 分配方針   | 運用による収益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行いません。   |  |

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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3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 | 純資産額 |
|------------------|-------|-----|------|-------|--------|------|
|                  |       | 期騰  | 中率   |       |        |      |
|                  | 円     |     | %    | %     | %      | 百万円  |
| 41期(2016年10月19日) | 4,104 |     | 1.0  | 44.3  | —      | 49   |
| 42期(2017年10月19日) | 4,094 |     | △0.2 | 33.8  | —      | 53   |
| 43期(2018年10月19日) | 4,089 |     | △0.1 | 61.4  | —      | 58   |

\*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、給付金の支払いを考慮し、組入比率および組み入れ公社債の償還年次別の分散投資等を通じ、常時、適正な流動性を保持するよう配慮した運用を行うため、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 | 債券率 |
|-------------|-------|-----|------|-------|--------|-----|
|             |       | 騰   | 落    |       |        |     |
| (期首)        | 円     |     | %    | %     | %      | %   |
| 2017年10月19日 | 4,094 |     | —    | 33.8  | —      | —   |
| 10月末        | 4,094 |     | 0.0  | 24.3  | —      | —   |
| 11月末        | 4,095 |     | 0.0  | 27.8  | —      | —   |
| 12月末        | 4,096 |     | 0.0  | 24.8  | —      | —   |
| 2018年1月末    | 4,093 |     | △0.0 | 36.9  | —      | —   |
| 2月末         | 4,096 |     | 0.0  | 36.7  | —      | —   |
| 3月末         | 4,098 |     | 0.1  | 27.6  | —      | —   |
| 4月末         | 4,096 |     | 0.0  | 26.7  | —      | —   |
| 5月末         | 4,098 |     | 0.1  | 18.1  | —      | —   |
| 6月末         | 4,098 |     | 0.1  | 43.7  | —      | —   |
| 7月末         | 4,096 |     | 0.0  | 55.5  | —      | —   |
| 8月末         | 4,092 |     | △0.0 | 61.3  | —      | —   |
| 9月末         | 4,090 |     | △0.1 | 55.3  | —      | —   |
| (期末)        |       |     |      |       |        |     |
| 2018年10月19日 | 4,089 |     | △0.1 | 61.4  | —      | —   |

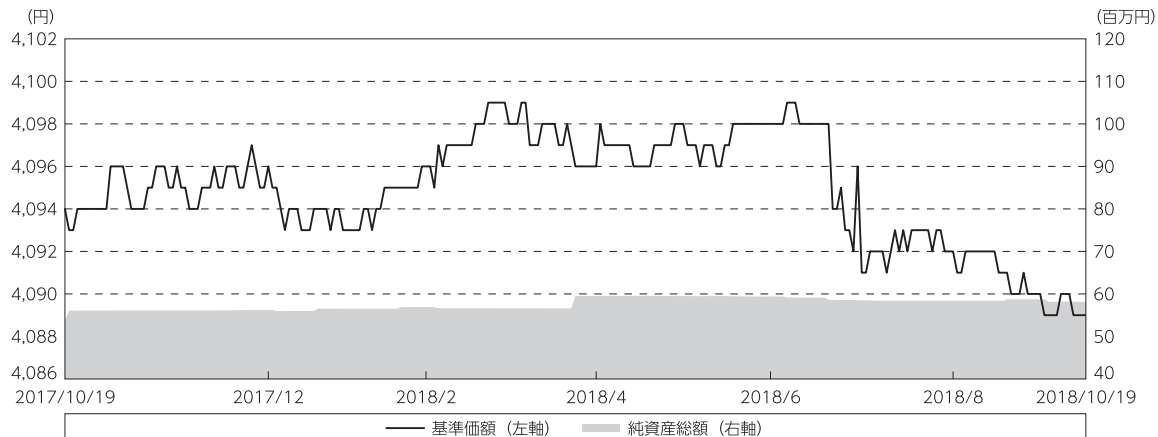
\*騰落率は期首比です。

\*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：4,094円

期末：4,089円

騰落率：△ 0.1%

(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

基準価額は0.12%の下落。

基準価額は、期首4,094円から期末4,089円に5円の値下がりとなりました。

(上昇) 保有する債券から金利収入を得たこと。

(下落) 日銀の金融政策の微修正で国内債券利回りが上昇（価格は下落）したこと。

## ○投資環境

今期の10年国債利回りは0.06%程度でスタートしました。日銀によるイールドカーブコントロール政策が継続する中、日本国債利回りは安定して推移しておりましたが、2018年7月下旬に日銀が金融政策の修正を検討しているとの観測報道が多数の報道機関から出たことをきっかけに、10年国債利回りは0.1%を超える水準まで急上昇しました。また、9月下旬には、日銀が「残存25年超」の国債買入オペにてオファー額を減額したことから債券利回りは再び上昇しました。その後は日銀の掲げるイールドカーブコントロール政策の下で概ね0.10%～0.15%程度での推移が継続し、期末の10年国債利回りは0.15%程度となりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村マネーポートフォリオ マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。

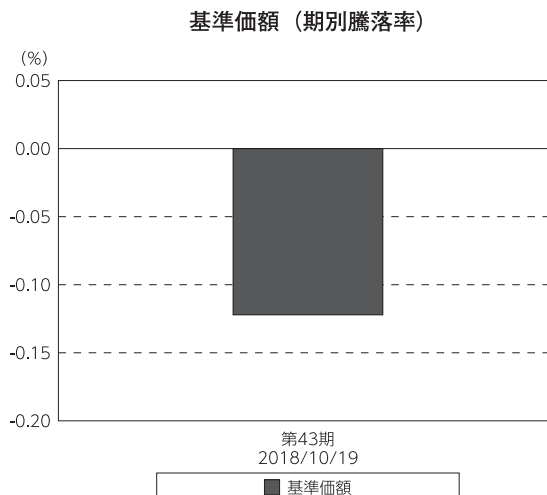
### [財形給付金ファンド]

財形給付金ファンドの運用につきましては、公社債と[野村マネーポートフォリオ マザーファンド]を合計した組入比率は概ね高位を保ちました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、給付金の支払いを考慮し、組入比率および組み入れ公社債の償還年次別の分散投資等を通じ、常時、適正な流動性を保持するよう配慮した運用を行うため、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。



## ◎分配金

該当事項はございません。

## ◎今後の運用方針

### [野村マネーポートフォリオ 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留意ください。

### [財形給付金ファンド]

引き続き金融・債券市場の動向に合わせて適切な債券ポートフォリオの構築・変更を行なって参ります。当面の運用は市場動向及び利回りを考慮しながら適切な残存年数の選択、債券の組み合わせに努めます。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1千口当たりの費用明細

(2017年10月20日～2018年10月19日)

| 項 目                  | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                    |
|----------------------|--------|------------|--|
|                      | 金 額    | 比 率        |  |
| (a) 信 託 報 酬          | 円<br>1 | %<br>0.020 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×期末時点の信託報酬率                 |
| ( 投 信 会 社 )          | (0)    | (0.008)    | 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 )          | (0)    | (0.010)    | 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 )          | (0)    | (0.002)    | 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                  | 1      | 0.022      |  |
| 期中の平均基準価額は、4,095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。

\*各比率は1千口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2017年10月20日～2018年10月19日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄                  | 設 定         |             | 解 約         |             |
|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|                      | 口 数         | 金 額         | 口 数         | 金 額         |
| 野村マネーポートフォリオ マザーファンド | 千口<br>6,667 | 千円<br>6,710 | 千口<br>1,570 | 千円<br>1,580 |

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年10月20日～2018年10月19日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;財形給付金ファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;野村マネーポートフォリオ マザーファンド&gt;

| 区 分 | 買付額等<br>A  | うち利害関係人<br>との取引状況B | B<br>A   | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | D<br>C |
|-----|------------|--------------------|----------|-----------|--------------------|--------|
|     |            |                    |          |           |                    |        |
| 公社債 | 百万円<br>158 | 百万円<br>10          | %<br>6.3 | 百万円<br>-  | 百万円<br>-           | %<br>- |

平均保有割合 33.5%

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

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

## ○組入資産の明細

(2018年10月19日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分  | 当 期 末       |             |           |                    |           |        |        |        |
|------|-------------|-------------|-----------|--------------------|-----------|--------|--------|--------|
|      | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 組 入 比 率   | うちBB格以下<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   |        |
| 国債証券 | 千円<br>7,000 | 千円<br>8,533 | %<br>14.7 | %<br>-             | %<br>14.7 | %<br>- | %<br>- | %<br>- |
| 合 計  | 7,000       | 8,533       | 14.7      | -                  | 14.7      | -      | -      | -      |

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄               | 当 期 末 |         |       |            |
|-------------------|-------|---------|-------|------------|
|                   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券              | %     | 千円      | 千円    |            |
| 国庫債券 利付(20年)第123回 | 2.1   | 7,000   | 8,533 | 2030/12/20 |
| 合 計               |       | 7,000   | 8,533 |            |

\*額面・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        |
| 野村マネーポートフォリオ マザーファンド | 千口<br>43,565 | 千口<br>48,662 | 千円<br>48,954 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年10月19日現在)

| 項 目                  | 当 期 末       |           |
|----------------------|-------------|-----------|
|                      | 評 価 額       | 比 率       |
| 公社債                  | 千円<br>8,533 | %<br>14.7 |
| 野村マネーポートフォリオ マザーファンド | 48,954      | 84.2      |
| コール・ローン等、その他         | 674         | 1.1       |
| 投資信託財産総額             | 58,161      | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月19日現在)

| 項 目                       | 当 期 末       |
|---------------------------|-------------|
|                           | 円           |
| (A) 資産                    | 58,161,008  |
| コール・ローン等                  | 624,535     |
| 国債証券(評価額)                 | 8,533,490   |
| 野村マネーポートフォリオ マザーファンド(評価額) | 48,954,341  |
| 未収利息                      | 48,642      |
| (B) 負債                    | 6,560       |
| 未払信託報酬                    | 5,981       |
| 未払利息                      | 1           |
| その他未払費用                   | 578         |
| (C) 純資産総額(A-B)            | 58,154,448  |
| 元本                        | 14,221,013  |
| 次期繰越損益金                   | 43,933,435  |
| (D) 受益権総口数                | 14,221,013口 |
| 1千口当たり基準価額(C/D)           | 4,089円      |

(注) 期首元本額は13,109,913円、期中追加設定元本額は3,019,141円、期中一部解約元本額は1,908,041円、1口当たり純資産額は4,089円です。

## ○損益の状況 (2017年10月20日～2018年10月19日)

| 項 目                | 当 期         |
|--------------------|-------------|
|                    | 円           |
| (A) 受取利息等収益        | 146,641     |
| 受取利息               | 147,000     |
| 支払利息               | △ 359       |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 24,028    |
| 売買損                | △ 24,028    |
| (C) 有価証券評価差損益      | △ 171,710   |
| (D) 信託報酬等          | △ 12,802    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 61,899    |
| (F) 前期繰越損益金        | 49,899,430  |
| (G) 解約差損益金         | △ 5,904,096 |
| (H) 計(E+F+G)       | 43,933,435  |
| 次期繰越損益金(H)         | 43,933,435  |

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

\*信託報酬率は、年0.02046%としております。



## ○お知らせ

信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2018年1月16日＞

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2018年10月19日現在)

## ＜野村マネーポートフォリオ マザーファンド＞

下記は、野村マネーポートフォリオ マザーファンド全体(143,934千口)の内容です。

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分                 | 当 期                |                    |                | 末                  |           |          |          |                |
|---------------------|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|-----------|----------|----------|----------------|
|                     | 額 面 金 額            | 評 価 額              | 組 入 比 率        | うちBB格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |          |          |                |
|                     |                    |                    |                |                    | 5年以上      | 2年以上     | 2年未満     |                |
|                     | 千円                 | 千円                 | %              | %                  | %         | %        | %        | %              |
| 地方債証券               | 50,000<br>(50,000) | 50,236<br>(50,236) | 34.7<br>(34.7) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | —<br>(—) | 34.7<br>(34.7) |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 10,000<br>(10,000) | 10,034<br>(10,034) | 6.9<br>(6.9)   | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | —<br>(—) | 6.9<br>(6.9)   |
| 金融債券                | 10,000<br>(10,000) | 10,008<br>(10,008) | 6.9<br>(6.9)   | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | —<br>(—) | 6.9<br>(6.9)   |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 10,000<br>(10,000) | 10,036<br>(10,036) | 6.9<br>(6.9)   | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | —<br>(—) | 6.9<br>(6.9)   |
| 合 計                 | 80,000<br>(80,000) | 80,316<br>(80,316) | 55.5<br>(55.5) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | —<br>(—) | 55.5<br>(55.5) |

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄                     | 当期    |        |        | 評価額    | 償還年月日      |
|------------------------|-------|--------|--------|--------|------------|
|                        | 利率    | 額面金額   | 金額     |        |            |
| <b>地方債証券</b>           | %     |        | 千円     | 千円     |            |
| 東京都 公募第663回            | 1.55  | 10,000 |        | 10,024 | 2018/12/20 |
| 北海道 公募平成21年度第4回        | 1.7   | 10,000 |        | 10,115 | 2019/6/26  |
| 神奈川県 公募第158回           | 1.53  | 10,000 |        | 10,025 | 2018/12/20 |
| 大阪府 公募第322回            | 1.62  | 10,000 |        | 10,044 | 2019/1/29  |
| 横浜市 公募公債平成20年度5回       | 1.58  | 10,000 |        | 10,026 | 2018/12/20 |
| 小計                     |       |        | 50,000 | 50,236 |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>     |       |        |        |        |            |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第27回    | 0.372 | 10,000 |        | 10,034 | 2019/8/19  |
| 小計                     |       |        | 10,000 | 10,034 |            |
| <b>金融債券</b>            |       |        |        |        |            |
| 商工債券 利付第765回い号         | 0.25  | 10,000 |        | 10,008 | 2019/2/27  |
| 小計                     |       |        | 10,000 | 10,008 |            |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b> |       |        |        |        |            |
| 北海道電力 第265回            | 2.0   | 10,000 |        | 10,036 | 2018/12/25 |
| 小計                     |       |        | 10,000 | 10,036 |            |
| 合計                     |       |        | 80,000 | 80,316 |            |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

# 野村マネーポートフォリオ マザーファンド

## 運用報告書

第10期（決算日2018年7月11日）

作成対象期間（2017年7月12日～2018年7月11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   | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。                               |
| 主な投資制限 | 株式への投資は行いません。<br>外貨建て資産への投資は行いません。                      |

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額        | 騰落率 |          | 債組入比率     | 債券先物比率 | 純資産額       |
|-----------------|-------------|-----|----------|-----------|--------|------------|
|                 |             | 期騰  | 中率       |           |        |            |
| 6期(2014年7月11日)  | 円<br>10,059 |     | %<br>0.1 | %<br>68.6 | %<br>— | 百万円<br>207 |
| 7期(2015年7月13日)  | 10,066      |     | 0.1      | 66.7      | —      | 135        |
| 8期(2016年7月11日)  | 10,069      |     | 0.0      | 60.5      | —      | 140        |
| 9期(2017年7月11日)  | 10,065      |     | △0.0     | 60.8      | —      | 140        |
| 10期(2018年7月11日) | 10,062      |     | △0.0     | 34.5      | —      | 145        |

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

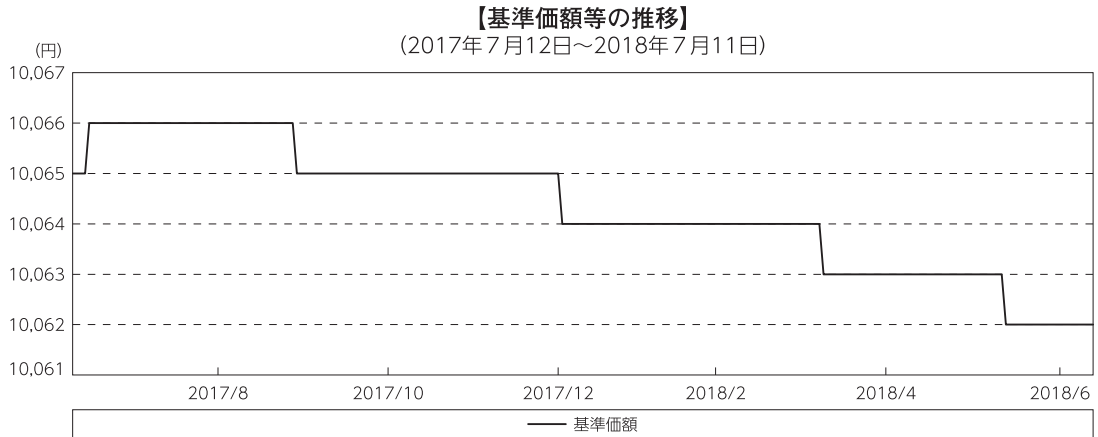
| 年月日                | 基準価額        | 騰落率 |        | 債組入比率     | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|
|                    |             | 騰   | 落率     |           |        |
| (期首)<br>2017年7月11日 | 円<br>10,065 |     | %<br>— | %<br>60.8 | %<br>— |
| 7月末                | 10,066      |     | 0.0    | 46.9      | —      |
| 8月末                | 10,066      |     | 0.0    | 39.7      | —      |
| 9月末                | 10,065      |     | 0.0    | 17.9      | —      |
| 10月末               | 10,065      |     | 0.0    | 10.6      | —      |
| 11月末               | 10,065      |     | 0.0    | 14.9      | —      |
| 12月末               | 10,065      |     | 0.0    | 11.3      | —      |
| 2018年1月末           | 10,064      |     | △0.0   | 26.0      | —      |
| 2月末                | 10,064      |     | △0.0   | 25.9      | —      |
| 3月末                | 10,064      |     | △0.0   | 14.7      | —      |
| 4月末                | 10,063      |     | △0.0   | 14.4      | —      |
| 5月末                | 10,063      |     | △0.0   | 4.1       | —      |
| 6月末                | 10,062      |     | △0.0   | 34.4      | —      |
| (期末)<br>2018年7月11日 | 10,062      |     | △0.0   | 34.5      | —      |

\*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



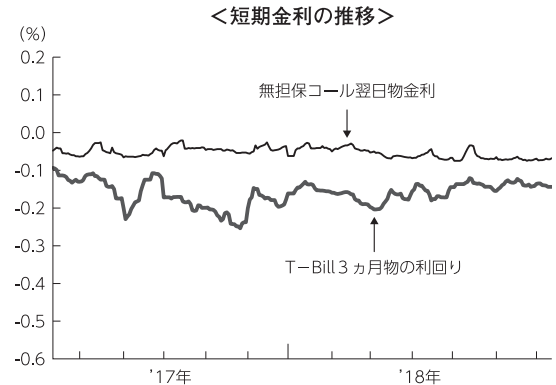
### ○基準価額の主な変動要因

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、高水準にある企業収益や雇用・所得環境の改善継続等を背景に、緩やかな回復基調が続く中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続しました。

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



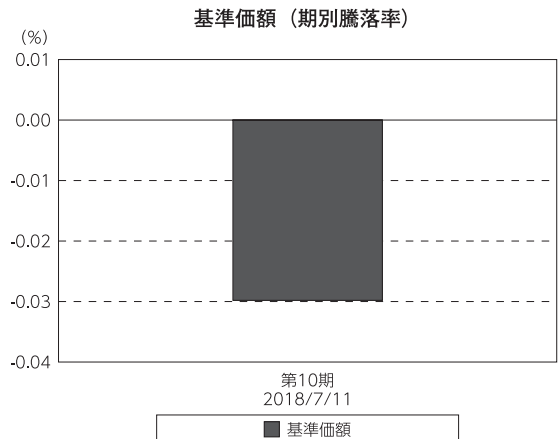
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年7月12日～2018年7月11日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2017年7月12日～2018年7月11日)

### 公社債

|    |                | 買付額     | 売付額      |
|----|----------------|---------|----------|
|    |                | 千円      | 千円       |
| 国内 | 国債証券           | 110,047 | 110,047  |
|    | 地方債証券          | 37,195  | —        |
|    |                |         | (47,000) |
|    | 特殊債券           | 50,031  | —        |
|    | 社債券(投資法人債券を含む) | 21,134  | (65,000) |
|    |                |         | —        |
|    |                |         | (31,000) |

\*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

(2017年7月12日～2018年7月11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

(2018年7月11日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分                 | 当 期 末              |                    |                |                    |           |          |                |  |
|---------------------|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|-----------|----------|----------------|--|
|                     | 額 面 金 額            | 評 価 額              | 組 入 比 率        | うちBB格以下<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               | 10,000<br>(10,000) | 10,066<br>(10,066) | 6.9<br>(6.9)   | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 6.9<br>(6.9)   |  |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 10,000<br>(10,000) | 10,000<br>(10,000) | 6.9<br>(6.9)   | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 6.9<br>(6.9)   |  |
| 金融債券                | 20,000<br>(20,000) | 20,015<br>(20,015) | 13.7<br>(13.7) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 13.7<br>(13.7) |  |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 10,000<br>(10,000) | 10,090<br>(10,090) | 6.9<br>(6.9)   | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 6.9<br>(6.9)   |  |
| 合 計                 | 50,000<br>(50,000) | 50,172<br>(50,172) | 34.5<br>(34.5) | —<br>(—)           | —<br>(—)  | —<br>(—) | 34.5<br>(34.5) |  |

\* ( ) 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   |        | 償 還 年 月 日  |
|----------------------|-------|---------|--------|------------|
|                      |       | 額 面 金 額 | 評 価 額  |            |
| 地方債証券                | %     | 千円      | 千円     |            |
| 神奈川県 公募第158回         | 1.53  | 10,000  | 10,066 | 2018/12/20 |
| 小 計                  |       | 10,000  | 10,066 |            |
| 特殊債券(除く金融債)          |       |         |        |            |
| 日本政策金融公庫社債 第55回財投機関債 | 0.001 | 10,000  | 10,000 | 2018/8/9   |
| 小 計                  |       | 10,000  | 10,000 |            |
| 金融債券                 |       |         |        |            |
| 農林債券 利付第760回い号       | 0.4   | 10,000  | 10,008 | 2018/9/27  |
| しんきん中金債券 利付第286回     | 0.35  | 10,000  | 10,007 | 2018/9/27  |
| 小 計                  |       | 20,000  | 20,015 |            |
| 普通社債券(含む投資法人債券)      |       |         |        |            |
| 北海道電力 第265回          | 2.0   | 10,000  | 10,090 | 2018/12/25 |
| 小 計                  |       | 10,000  | 10,090 |            |
| 合 計                  |       | 50,000  | 50,172 |            |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年7月11日現在)

| 項 目          | 当 期 末        |           |
|--------------|--------------|-----------|
|              | 評 価 額        | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>50,172 | %<br>34.5 |
| コール・ローン等、その他 | 95,416       | 65.5      |
| 投資信託財産総額     | 145,588      | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年7月11日現在)

| 項目              | 当期末          |
|-----------------|--------------|
|                 | 円            |
| (A) 資産          | 145,588,733  |
| コール・ローン等        | 95,376,530   |
| 公社債(評価額)        | 50,172,862   |
| 未収利息            | 15,272       |
| 前払費用            | 24,069       |
| (B) 負債          | 199          |
| 未払利息            | 199          |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 145,588,534  |
| 元本              | 144,695,052  |
| 次期繰越損益金         | 893,482      |
| (D) 受益権総口数      | 144,695,052口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,062円      |

(注) 期首元本額は139,150,711円、期中追加設定元本額は8,103,099円、期中一部解約元本額は2,558,758円、1口当たり純資産額は1.0062円です。

## ○損益の状況 (2017年7月12日～2018年7月11日)

| 項目             | 当期       |
|----------------|----------|
|                | 円        |
| (A) 配当等収益      | 347,911  |
| 受取利息           | 405,738  |
| 支払利息           | △ 57,827 |
| (B) 有価証券売買損益   | △400,742 |
| 売買損            | △400,742 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 52,831 |
| (D) 前期繰越損益金    | 910,943  |
| (E) 追加信託差損益金   | 51,991   |
| (F) 解約差損益金     | △ 16,621 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 893,482  |
| 次期繰越損益金(G)     | 893,482  |

\* 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          |
| 野村金先物投信(マネーボールファンド)年2回決算型                 | 83,843,258 |
| 財形給付金ファンド                                 | 49,586,670 |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型   | 2,579,737  |
| 野村PIMCO・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    | 1,003,293  |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型        | 998,495    |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型          | 997,887    |
| 野村PIMCO・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   | 997,001    |
| 野村PIMCO・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   | 997,000    |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ニュージーランドドルコース)毎月分配型 | 996,337    |
| 野村金先物投信(豪ドルコース)年2回決算型                     | 996,216    |
| 野村金先物投信(豪ドルコース)毎月分配型                      | 996,215    |
| 野村PIMCO・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     | 100,755    |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型       | 99,927     |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型         | 99,898     |
| 野村金先物投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型                  | 99,622     |
| 野村金先物投信(南アフリカランドコース)毎月分配型                 | 99,622     |

| ファンド名                                      | 当期末    |
|--|--------|
|  | 元本額    |
|  | 円      |
| 野村金先物投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型                  | 99,622 |
| 野村PIMCO・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   | 9,985  |
| 野村PIMCO・米国ハイ・イールド債券投信(ニュージーランドドルコース)年2回決算型 | 9,978  |
| 野村PIMCO・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     | 9,978  |
| 野村金先物投信(南アフリカランドコース)年2回決算型                 | 9,962  |
| 上海株式指数・上証50連動型上場投資信託                       | 9,938  |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Eコース             | 9,937  |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド 為替ナビ Fコース             | 9,937  |
| 野村DC・PIMCO・世界インカム戦略ファンド(為替ヘッジあり)           | 9,936  |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)      | 9,935  |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)      | 9,935  |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Aコース                  | 994    |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Bコース                  | 994    |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Cコース                  | 994    |
| 野村PIMCO・世界インカム戦略ファンド Dコース                  | 994    |

## ○お知らせ

該当事項はございません。