

野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース

運用報告書(全体版)

第66期(決算日2015年1月26日) 第67期(決算日2015年2月25日) 第68期(決算日2015年3月25日)
第69期(決算日2015年4月27日) 第70期(決算日2015年5月25日) 第71期(決算日2015年6月25日)

作成対象期間(2014年12月26日～2015年6月25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/内外/債券	
信託期間	2009年6月26日から2019年6月25日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるPIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged)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、世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品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積極的な運用を行います。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged)受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged)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ケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY, Hedged)	世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品を主要投資対象とします。派生商品については、オプション取引、先物取引、スワップ取引などを活用します。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への直接投資は行いません。
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			参 考	指 数		純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金		期 騰	落 率	
	円		円			%	百万円	
42期(2013年1月25日)	11,102		30		126.45	0.3	1,473	
43期(2013年2月25日)	11,043		30	△0.3	125.92	△0.4	1,496	
44期(2013年3月25日)	11,053		30	0.4	126.25	0.3	1,538	
45期(2013年4月25日)	11,177		30	1.4	127.80	1.2	1,532	
46期(2013年5月27日)	11,028		30	△1.1	126.61	△0.9	1,514	
47期(2013年6月25日)	10,404		30	△5.4	121.46	△4.1	1,402	
48期(2013年7月25日)	10,572		30	1.9	123.68	1.8	1,423	
49期(2013年8月26日)	10,345		30	△1.9	121.82	△1.5	1,392	
50期(2013年9月25日)	10,508		30	1.9	123.87	1.7	1,393	
51期(2013年10月25日)	10,596		30	1.1	125.40	1.2	1,398	
52期(2013年11月25日)	10,497		30	△0.7	124.14	△1.0	1,378	
53期(2013年12月25日)	10,396		30	△0.7	123.82	△0.3	1,352	
54期(2014年1月27日)	10,387		30	0.2	123.88	0.0	1,344	
55期(2014年2月25日)	10,456		30	1.0	124.90	0.8	1,343	
56期(2014年3月25日)	10,411		30	△0.1	125.05	0.1	1,332	
57期(2014年4月25日)	10,513		30	1.3	126.62	1.3	1,343	
58期(2014年5月26日)	10,659		30	1.7	128.48	1.5	1,362	
59期(2014年6月25日)	10,739		30	1.0	129.02	0.4	1,372	
60期(2014年7月25日)	10,721		30	0.1	129.53	0.4	1,374	
61期(2014年8月25日)	10,651		30	△0.4	129.53	0.0	1,353	
62期(2014年9月25日)	10,559		30	△0.6	128.66	△0.7	1,304	
63期(2014年10月27日)	10,508		30	△0.2	128.84	0.1	1,256	
64期(2014年11月25日)	10,503		30	0.2	128.60	△0.2	1,254	
65期(2014年12月25日)	10,292		30	△1.7	126.56	△1.6	1,231	
66期(2015年1月26日)	10,454		30	1.9	128.12	1.2	1,247	
67期(2015年2月25日)	10,373		30	△0.5	127.79	△0.3	1,237	
68期(2015年3月25日)	10,380		30	0.4	127.94	0.1	1,234	
69期(2015年4月27日)	10,342		30	△0.1	128.27	0.3	1,224	
70期(2015年5月25日)	10,167		30	△1.4	126.94	△1.0	1,202	
71期(2015年6月25日)	10,003		30	△1.3	125.58	△1.1	1,172	

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 参考指数はPIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス（カスタムヘッジ・円ベース）とします。なお、設定時=100として指数化しています。

* PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス（GLADI）の一部の特長については、特許取得済みです（米国特許番号：8,306,892）。「GLOBAL ADVANTAGE（グローバル・アドバンテージ）」と「GLADI」はPIMCO（バシフィック・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）の商標です。

* GLADIはPIMCOとは独立したグローバルなインデックスであり、プロバイダーであるBofAメリルリンチ社（Bank of America Merrill Lynch）によって管理、計算されています。BofAメリルリンチ社は、インデックスの構築方法に基づいたインデックスの作成、インデックス構成銘柄の確認、その他のインデックス・データの計算に関わる全ての技術的な事柄に対応します。

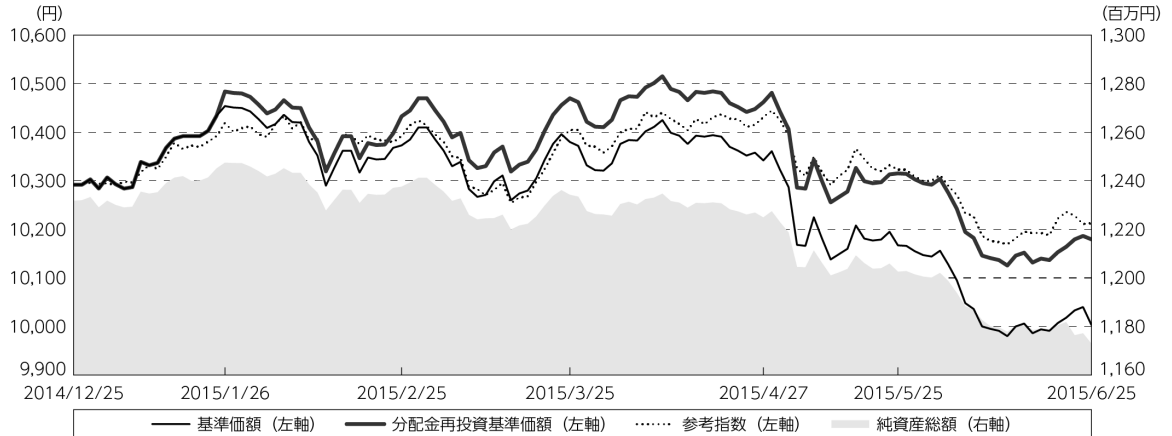
○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	参 考 指 数	
			騰 落 率	騰 落 率
第66期	(期 首) 2014年12月25日	円 10,292	% —	126.56 —
	12月末	10,284	△0.1	126.58 0.0
	(期 末) 2015年1月26日	10,484	1.9	128.12 1.2
第67期	(期 首) 2015年1月26日	10,454	—	128.12 —
	1月末	10,427	△0.3	127.84 △0.2
	(期 末) 2015年2月25日	10,403	△0.5	127.79 △0.3
第68期	(期 首) 2015年2月25日	10,373	—	127.79 —
	2月末	10,410	0.4	128.19 0.3
	(期 末) 2015年3月25日	10,410	0.4	127.94 0.1
第69期	(期 首) 2015年3月25日	10,380	—	127.94 —
	3月末	10,321	△0.6	127.37 △0.4
	(期 末) 2015年4月27日	10,372	△0.1	128.27 0.3
第70期	(期 首) 2015年4月27日	10,342	—	128.27 —
	4月末	10,322	△0.2	128.19 △0.1
	(期 末) 2015年5月25日	10,197	△1.4	126.94 △1.0
第71期	(期 首) 2015年5月25日	10,167	—	126.94 —
	5月末	10,144	△0.2	126.66 △0.2
	(期 末) 2015年6月25日	10,033	△1.3	125.58 △1.1

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2014年12月25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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数はPIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス(カスタムヘッジ・円ベース)です。作成期首(2014年12月25日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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

- ・ 当作成期を通じて、保有している利付き債からのクーポン収入がプラスに寄与したこと
- ・ 投資している新興国通貨が下落したことがマイナスに影響したこと

○投資環境

・先進国国債

米国債券市場は、当作成期間では、利回りは上昇（価格は下落）傾向で推移しました。米国の主要経済指標やFRB（米連邦準備制度理事会）の動向などに左右されました。

欧州債券市場は、当作成期間では、利回りは上昇傾向で推移しました。ECB（欧州中央銀行）の動向やギリシャ支援協議の動向などに左右されました。

・新興国国債

当作成期間では、ギリシャの債務再編問題や米国の金利上昇を受け概ね下落基調で推移しました。

・投資適格社債

米国の投資適格社債は、FRBの動向などに左右され、概ね下落基調で推移しました。

・モーゲージ債

当作成期首から4月中旬にかけてはFRBの動向などに左右され、下落基調で推移した一方、より高い利回りを求める投資家が同資産を買う動きがみられたことなどを背景に当作成期末にかけて概ね上昇基調で推移しました。

・為替市場

ドル・円相場は、米国の利上げ観測や、米国の好調な経済統計などを背景に、ドルに対して円安が進行しました。

ユーロ・円相場は、当作成期首から6月中旬にかけては、ECBによるQE（量的金融緩和）やギリシャ支援協議の難航などを背景として概ねユーロ安の推移となりました。その後ギリシャ支援協議が進展するとの期待感などからユーロが買われる場面もあったものの、通期ではユーロに対して円高が進行しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース]

[野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース] は、当作成期を通じて、[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY,Hedged)] 受益証券を概ね高位に組み入れ、また [野村マネー マザーファンド] 受益証券への投資も行いました。

[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY,Hedged)]

<国・地域別比率（純資産比）>

国・地域別配分については、'15年5月末でユーロ圏27.7%、米国15.3%、ブラジル14.6%、メキシコ8.5%、英国6.6%、インドネシア4.2%、インド4.1%、その他の国・地域24.0%としました。

<セクター別比率（純資産比）>

セクター別配分については、'15年5月末で先進国国債等28.8%、新興国国債等26.3%、社債21.3%、モーゲージ債8.4%、新興国通貨20.2%としました。

<信用格付け別比率（純資産比）>

信用格付け配分については、'15年5月末でAAA格22.3%、AA格7.8%、A格11.6%、BBB格28.4%、BB格7.1%、B格以下7.7%、新興国通貨20.2%としました。

[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い高格付けの公社債によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローンなどにより運用してまいりました。

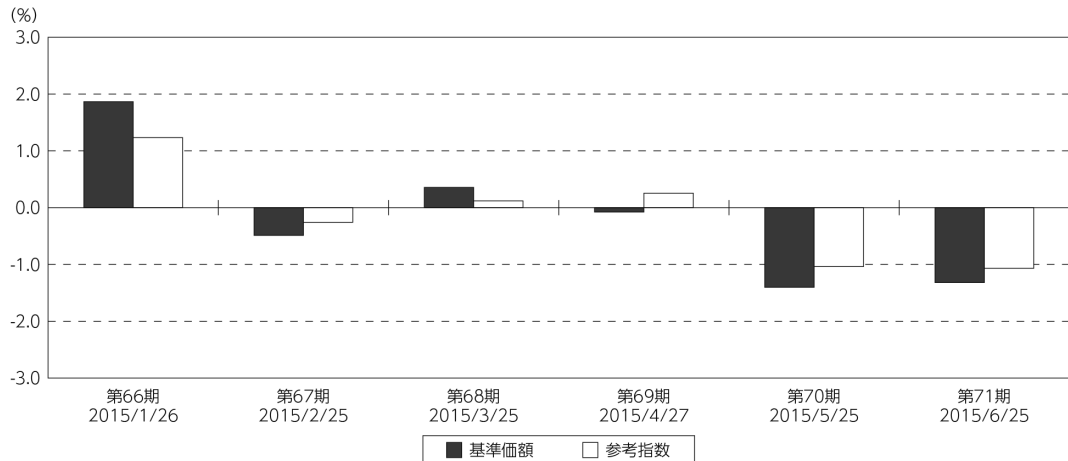
○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

当作成期の中に、基準価額の騰落率が -1.1% *となったのに対し、参考指数であるPIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス（カスタムヘッジ・円ベース）は -0.8% となりました。保有する債券の値下がりなどがマイナスに寄与しました。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、PIMCO グローバル・アドバンテージ・ボンド・インデックス（カスタムヘッジ・円ベース）です。

◎分配金

収益分配金については、各期の利子・配当収入や基準価額水準等を勘案し、信託報酬などの諸経費を差し引いた額をベースに決定しました。

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す。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項 目	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期
	2014年12月26日～ 2015年1月26日	2015年1月27日～ 2015年2月25日	2015年2月26日～ 2015年3月25日	2015年3月26日～ 2015年4月27日	2015年4月28日～ 2015年5月25日	2015年5月26日～ 2015年6月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.286%	30 0.288%	30 0.288%	30 0.289%	30 0.294%	30 0.299%
当期の収益	30	30	30	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,454	1,463	1,474	1,482	1,493	1,503

(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・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース]

ファンドの商品性に従い、[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドーJ(JPY,Hedged)] 受益証券への投資比率を引き続き高位に維持する方針です。

[PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドーJ(JPY,Hedged)]

世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券等および派生商品を主要投資対象とし、トータルリターンを最大化をめざします。投資対象市場の今後の投資環境見通しおよび運用方針は、次の通りです。

世界経済は、原油価格の下落が時間をかけて先進国経済を中心にプラスに働くなか、米国を中心に緩やかな景気回復が継続すると予想しています。米国では雇用市場の改善や原油価格の下落から消費者マインドの改善が進んでおり、個人消費からの成長寄与が加速すると予想されることから、当面は潜在成長率を上回る成長が継続すると予想されます。一方、所得の伸びが限定的であることから、経済成長率が3%を大きく上回るようなペースに加速する可能性は低いと考えています。欧州においては、通貨ユーロの下落が輸出比率の高い同地域経済にプラスの影響を与えると期待されることから、潜在成長率を上回る水準に成長率が加速すると期待されます。新興国においては、中国に対してかつてのような高成長を見込むことは難しく、資源需要の鈍化などを通じて他の新興国の成長見通しも下押しすると予想されます。

ポートフォリオ戦略に関しては、緩やかな景気回復を背景とした金利上昇に対応し、全体の金利リスクは消極姿勢としつつ、市場環境に合わせて機動的に調整する方針を継続します。また、欧州における金融緩和の恩恵を受けやすい欧州周辺国の債券の組み入れを継続します。クレジット戦略では、スプレッド(利回り格差)が縮小している投資適格社債やエージェンシー・モーゲージ債券に対しては消極的な姿勢としつつ、欧州における金融緩和がプラスの影響を及ぼすと考えられる欧州の金融債を選好します。また、米国におけるインフレ見通しの正常化を捉える資産として、米国の物価連動国債を組み入れています。新興国市場については、各国の財政状況や対外収支状況などファンダメンタルズ(基礎的条件)の分析に軸を置きつつ、政治的要因についても配慮した投資対象国の選別が一層重要になると考えています。具体的には、米国の景気回復の恩恵を受けやすいメキシコやファンダメンタルズが良好なポーランドをはじめとする国々の現地通貨建て債券を選好します。通貨に関しては、インド・ルピーへの多めの投資を継続します。

[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパーなどの短期有価証券への投資により利息収益の確保を図り、あわせて債券現先取引やコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図る運用を行なう方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年12月26日～2015年6月25日)

項 目	第66期～第71期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 69	% 0.673	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(45)	(0.444)	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)	(22)	(0.213)	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)	(2)	(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＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	69	0.674	
作成期間の平均基準価額は、10,318円です。			

* 作成期間の費用（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）を作成期間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

(2014年12月26日～2015年6月25日)

投資信託証券

銘 柄		第66期～第71期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY,Hedged)	口 657	千円 6,526	口 2,491	千円 24,414

* 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

(2014年12月26日～2015年6月25日)

利害関係人との取引状況

<野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース>

該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区分	第66期～第71期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 25,047	百万円 4,119	% 16.4	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

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

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

○組入資産の明細

(2015年6月25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	第65期末	第71期末		
	口数	口数	評価額	比率
PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド-J(JPY,Hedged)	口 122,205	口 120,371	千円 1,154,839	% 98.5
合計	122,205	120,371	1,154,839	98.5

*比率は、純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘柄	第65期末	第71期末	
	口数	口数	評価額
野村マネー マザーファンド	千口 982	千口 982	千円 1,002

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年6月25日現在)

項 目	第71期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,154,839	97.5
野村マネー マザーファンド	1,002	0.1
コール・ローン等、その他	29,132	2.4
投資信託財産総額	1,184,973	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

項 目	第66期末	第67期末	第68期末	第69期末	第70期末	第71期末
	2015年1月26日現在	2015年2月25日現在	2015年3月25日現在	2015年4月27日現在	2015年5月25日現在	2015年6月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,252,517,032	1,242,548,151	1,239,071,082	1,229,959,359	1,207,350,413	1,184,973,493
コール・ローン等	21,943,962	22,059,795	22,045,631	22,053,391	22,017,619	29,131,314
投資信託受益証券(評価額)	1,229,570,474	1,219,485,762	1,216,022,760	1,206,903,280	1,184,330,004	1,154,839,374
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,002,554	1,002,554	1,002,653	1,002,653	1,002,751	1,002,751
未収利息	42	40	38	35	39	54
(B) 負債	5,044,146	4,956,175	4,844,033	5,056,795	4,804,475	12,082,071
未払収益分配金	3,579,799	3,579,319	3,567,059	3,553,297	3,548,478	3,517,611
未払解約金	—	—	—	—	—	7,201,001
未払信託報酬	1,462,017	1,374,667	1,274,942	1,501,112	1,253,997	1,361,294
その他未払費用	2,330	2,189	2,032	2,386	2,000	2,165
(C) 純資産総額(A-B)	1,247,472,886	1,237,591,976	1,234,227,049	1,224,902,564	1,202,545,938	1,172,891,422
元本	1,193,266,554	1,193,106,546	1,189,019,762	1,184,432,342	1,182,826,331	1,172,537,196
次期繰越損益金	54,206,332	44,485,430	45,207,287	40,470,222	19,719,607	354,226
(D) 受益権総口数	1,193,266,554口	1,193,106,546口	1,189,019,762口	1,184,432,342口	1,182,826,331口	1,172,537,196口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,454円	10,373円	10,380円	10,342円	10,167円	10,003円

(注) 第66期首元本額1,196百万円、第66～第71期中追加設定元本額2百万円、第66～第71期中一部解約元本額27百万円、第71期末計算口数当たり純資産額10,003円。

(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3,688,955円。(野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース/Bコースの合計額)

○損益の状況

項 目	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期
	2014年12月26日～ 2015年1月26日	2015年1月27日～ 2015年2月25日	2015年2月26日～ 2015年3月25日	2015年3月26日～ 2015年4月27日	2015年4月28日～ 2015年5月25日	2015年5月26日～ 2015年6月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	6,098,924	6,102,626	6,087,067	6,069,408	6,066,238	6,019,532
受取配当金	6,097,850	6,101,700	6,086,200	6,068,500	6,065,400	6,018,550
受取利息	1,074	926	867	908	838	982
(B) 有価証券売買損益	18,294,088	△ 10,859,221	△ 368,692	△ 5,575,275	△ 21,957,354	△ 20,331,053
売買益	18,314,294	311	32,475	15,598	28,575	149,748
売買損	△ 20,206	△ 10,859,532	△ 401,167	△ 5,590,873	△ 21,985,929	△ 20,480,801
(C) 信託報酬等	△ 1,464,347	△ 1,376,856	△ 1,276,974	△ 1,503,498	△ 1,255,997	△ 1,363,459
(D) 当期繰越損益(A+B+C)	22,928,665	△ 6,133,451	4,441,401	△ 1,009,365	△ 17,147,113	△ 15,674,980
(E) 前期繰越損益金	△ 23,444,139	△ 4,091,794	△ 13,753,972	△ 12,826,879	△ 17,361,786	△ 37,701,209
(F) 追加信託差損益金	58,301,605	58,289,994	58,086,917	57,859,763	57,776,984	57,248,026
(配当等相当額)	(62,988,818)	(63,059,447)	(62,870,190)	(62,654,343)	(62,596,499)	(62,127,246)
(売買損益相当額)	(△ 4,687,213)	(△ 4,769,453)	(△ 4,783,273)	(△ 4,794,580)	(△ 4,819,515)	(△ 4,879,220)
(G) 計(D+E+F)	57,786,131	48,064,749	48,774,346	44,023,519	23,268,085	3,871,837
(H) 収益分配金	△ 3,579,799	△ 3,579,319	△ 3,567,059	△ 3,553,297	△ 3,548,478	△ 3,517,611
(I) 次期繰越損益金(G+H)	54,206,332	44,485,430	45,207,287	40,470,222	19,719,607	354,226
追加信託差損益金	58,301,605	58,289,994	58,086,917	57,859,763	57,776,984	57,248,026
(配当等相当額)	(62,988,819)	(63,059,447)	(62,870,190)	(62,654,343)	(62,596,499)	(62,127,246)
(売買損益相当額)	(△ 4,687,214)	(△ 4,769,453)	(△ 4,783,273)	(△ 4,794,580)	(△ 4,819,515)	(△ 4,879,220)
分配準備積立金	110,554,014	111,606,876	112,441,087	112,993,370	114,074,989	114,146,193
繰越損益金	△114,649,287	△125,411,440	△125,320,717	△130,382,911	△152,132,366	△171,039,993

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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(2014年12月26日～2015年6月25日)は以下の通りです。

項 目	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期
	2014年12月26日～ 2015年1月26日	2015年1月27日～ 2015年2月25日	2015年2月26日～ 2015年3月25日	2015年3月26日～ 2015年4月27日	2015年4月28日～ 2015年5月25日	2015年5月26日～ 2015年6月25日
a. 配当等収益(経費控除後)	5,733,130円	4,726,074円	4,810,297円	4,566,136円	4,810,430円	4,656,405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	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	62,988,819円	63,059,447円	62,870,190円	62,654,343円	62,596,499円	62,127,246円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	108,400,683円	110,460,121円	111,197,849円	111,980,531円	112,813,037円	113,007,399円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	177,122,632円	178,245,642円	178,878,336円	179,201,010円	180,219,966円	179,791,050円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,484円	1,493円	1,504円	1,512円	1,523円	1,533円
g. 分配金	3,579,799円	3,579,319円	3,567,059円	3,553,297円	3,548,478円	3,517,611円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円	30円	30円	30円

○分配金のお知らせ

	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期
1 万口当たり分配金 (税込み)	30円	30円	30円	30円	30円	30円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2015年6月25日現在)

＜野村マネー マザーファンド＞

下記は、野村マネー マザーファンド全体(21,377,300千口)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	第71期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	2,480,000 (2,200,000)	2,480,040 (2,199,997)	11.4 (10.1)	— (—)	— (—)	— (—)	11.4 (10.1)
地方債証券	1,675,100 (1,675,100)	1,677,742 (1,677,742)	7.7 (7.7)	— (—)	— (—)	— (—)	7.7 (7.7)
特殊債券 (除く金融債)	4,027,000 (4,027,000)	4,046,842 (4,046,842)	18.5 (18.5)	— (—)	— (—)	— (—)	18.5 (18.5)
金融債券	1,000,000 (1,000,000)	1,000,485 (1,000,485)	4.6 (4.6)	— (—)	— (—)	— (—)	4.6 (4.6)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,400,000 (1,400,000)	1,404,155 (1,404,155)	6.4 (6.4)	— (—)	— (—)	— (—)	6.4 (6.4)
合 計	10,582,100 (10,302,100)	10,609,267 (10,329,224)	48.6 (47.3)	— (—)	— (—)	— (—)	48.6 (47.3)

* ()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。

*—印は組み入れなし。

*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	柄	第71期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫短期証券	第521回	—	500,000	499,998	2015/6/29
国庫短期証券	第529回	—	500,000	499,999	2015/8/3
国庫短期証券	第538回※	—	700,000	700,000	—
国庫短期証券	第541回	—	500,000	499,999	2015/9/28
国庫債券	利付(2年)第330回	0.2	170,000	170,019	2015/7/15
国庫債券	利付(2年)第331回	0.1	60,000	60,008	2015/8/15
国庫債券	利付(2年)第333回	0.1	50,000	50,014	2015/10/15
小	計		2,480,000	2,480,040	
地方債証券					
東京都	公募第625回	1.41	200,000	200,597	2015/9/18
北海道	公募平成17年度第6回	1.4	105,100	105,337	2015/8/31
埼玉県	公募平成17年度第3回	1.3	500,000	500,548	2015/7/28
共同発行市場地方債	公募第32回	1.6	100,000	100,607	2015/11/25
大阪市	公募平成17年度第3回	1.3	100,000	100,096	2015/7/28
名古屋市	公募第12回ひ号	1.3	670,000	670,555	2015/7/21
小	計		1,675,100	1,677,742	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第343回	1.3	171,000	171,038	2015/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第345回	1.2	50,000	50,052	2015/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第346回	1.4	300,000	300,688	2015/8/26
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第347回	1.3	352,000	353,056	2015/9/22
首都高速道路債券	政府保証第198回	1.3	10,000	10,001	2015/6/26
首都高速道路債券	政府保証第199回	1.4	50,000	50,117	2015/8/28
阪神高速道路債券	政府保証第147回	1.2	50,000	50,053	2015/7/29
阪神高速道路債券	政府保証第148回	1.3	20,000	20,064	2015/9/30
本州四国連絡橋債券	政府保証第27回	1.4	300,000	300,736	2015/8/31
公営企業債券	政府保証第852回	1.3	160,000	160,027	2015/6/29
公営企業債券	政府保証第854回	1.4	60,000	60,109	2015/8/18
公営企業債券	政府保証第861回	1.6	29,000	29,323	2016/3/17
公営企業債券	政府保証第862回	1.8	117,000	118,635	2016/4/20
日本政策金融公庫債券	政府保証第3回	0.8	30,000	30,030	2015/8/14
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証債第1回	1.5	100,000	100,714	2015/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第3回	1.5	100,000	100,857	2016/1/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第5回	1.6	558,000	563,732	2016/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第11回	1.8	170,000	172,431	2016/4/26
首都高速道路債券	政府保証第1回	1.6	400,000	404,648	2016/3/28
中部国際空港債券	政府保証第17回	0.051	300,000	300,000	2016/3/7
地方公共団体金融機構債券	2年第1回	0.135	200,000	200,072	2016/2/26
首都高速道路社債	第6回	0.315	100,000	100,056	2015/9/24
阪神高速道路社債	財投機関債第6回	0.589	100,000	100,240	2015/12/18
中日本高速道路債券	財投機関債第20回	0.417	100,000	100,072	2015/9/18
西日本高速道路	第16回	0.246	200,000	200,080	2015/9/18
小	計		4,027,000	4,046,842	
金融債券					
商工債券	利付第721回い号	0.55	30,000	30,003	2015/6/26
商工債券	利付第722回い号	0.5	100,000	100,034	2015/7/27

銘	柄	第71期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		%	千円	千円	
商工債券	利付第724回い号	0.5	120,000	120,124	2015/9/25
農林債券	利付第722回い号	0.55	200,000	200,083	2015/7/27
農林債券	利付第723回い号	0.55	150,000	150,114	2015/8/27
農林債券	利付第724回い号	0.5	50,000	50,051	2015/9/25
しんきん中金債券	利付第247回	0.55	50,000	50,001	2015/6/26
商工債券	利付(3年)第149回	0.25	100,000	100,001	2015/6/26
商工債券	利付(3年)第152回	0.2	100,000	100,029	2015/9/25
商工債券	利付(3年)第153回	0.2	100,000	100,042	2015/10/27
小	計		1,000,000	1,000,485	
普通社債券(含む投資法人債券)					
みずほコーポレート銀行	第24回特定社債間限定同順位特約付	0.595	200,000	200,562	2016/1/20
みずほコーポレート銀行	第25回特定社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	100,523	2016/4/20
三菱東京UFJ銀行	第116回特定社債間限定同順位特約付	0.49	400,000	400,107	2015/7/16
三井住友銀行	第50回社債間限定同順位特約付	0.5	100,000	100,024	2015/7/17
三菱UFJリース	第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	502,851	2016/4/22
三菱UFJリース	第22回社債間限定同順位特約付	0.235	100,000	100,085	2016/2/26
小	計		1,400,000	1,404,155	
合	計		10,582,100	10,609,267	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

* ※印は現先で保有している債券です。

国内その他有価証券

区 分	第71期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,399,188	% 11.0

* 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。

PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドー
 インスティテューショナル FC (JPY, ヘッジド)/
 インスティテューショナル FD (JPY)/J (JPY)/J (JPY, Hedged)

2015年2月28日決算

(計算期間:2014年3月1日～2015年2月28日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託
運 用 方 針	世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品(オプション取引、先物取引、スワップ取引等)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ます。
投 資 対 象	世界各国(新興国を含みます。)の国債、政府機関債、国際機関債、社債、モーゲージ債、アセット・バック証券、物価連動債、仕組債等およびその派生商品
受 託 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー(ケイマン)・リミテッド
投 資 顧 問 会 社	パンフィック・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
管 理 事 務 代 行 会 社 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

* 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

2015年2月28日に終了した期間

(単位:千)

収益

利息(外国税額控除後)	\$	1,105
雑収入		1
収益合計		1,106

費用

管理費用-InstitutionalFC(JPY,Hedged)		1
管理費用-InstitutionalFD(JPY)		144
支払利息		2
費用合計		147

純投資収益

959

当期実現損益

投資有価証券(外国税額控除後)		(10)
上場金融デリバティブ商品		(303)
店頭金融デリバティブ商品		(940)
外貨通貨		(153)
当期実現損益		(1,406)

当期末実現損益

投資有価証券(外国税額控除後)		(1,953)
上場金融デリバティブ商品		(58)
店頭金融デリバティブ商品		289
外貨建資産および負債		18
当期末実現損益		(1,704)
当期実現および未実現損益		(3,110)

運用の結果による純資産の増減額

\$ (2,151)

外国源泉徴収課税額	\$	24
-----------	----	----

期末純資産総額

(単位:千)

Institutional FC (JPY, Hedged)	\$	135
Institutional FD (JPY)		24,663
J (JPY)		1,231
J (JPY, Hedged)		10,243

期末現在発行済受益証券数

(単位:千)

Institutional FC (JPY, Hedged)		2
Institutional FD (JPY)		256
J (JPY)		13
J (JPY, Hedged)		122

期末1口当たり純資産価格

Institutional FC (JPY, Hedged)		78.81
Institutional FD (JPY)		96.54
J (JPY)		97.87
J (JPY, Hedged)		83.91

※PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンドの期末純資産額は36,272千米ドル。

組入資産の明細

2015年2月28日現在

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 110.2%					
ブラジル 2.9%					
社債・約束手形 1.1%					
Banco Santander Brasil S.A.					
4.250% due 01/14/2016	\$	200	\$	205	
Itau Unibanco Holding S.A.					
5.750% due 01/22/2021		100		105	
Petrobras Global Finance BV					
6.250% due 03/17/2024		100		92	
				<u>402</u>	
ソブリン債 1.8%					
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social					
3.375% due 09/26/2016		200		202	
Brazil Government International Bond					
5.000% due 01/27/2045		200		182	
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F					
10.000% due 01/01/2017	BRL	652		222	
10.000% due 01/01/2025		100		31	
				<u>637</u>	
ブラジル計				<u>1,039</u>	
(Cost \$1,168)					
カナダ 4.3%					
ソブリン債 4.3%					
Canada Housing Trust No.1					
2.400% due 12/15/2022	CAD	1,000		857	
Province of Ontario					
2.500% due 09/10/2021	\$	700		717	
				<u>1,574</u>	
カナダ計				<u>1,574</u>	
(Cost \$1,618)					
ケイマン諸島 0.0%					
資産担保証券 0.0%					
Hyundai Capital Auto Funding VIII Ltd.					
1.173% due 09/20/2016		3		3	
				<u>3</u>	
ケイマン諸島計				<u>3</u>	
(Cost \$3)					
デンマーク 5.1%					
社債・約束手形 5.1%					
Nykredit Realkredit A/S					
2.000% due 04/01/2015	DKK	200		30	
2.000% due 10/01/2015		3,100		473	
2.000% due 01/01/2016		700		107	
Realkredit Danmark A/S					
2.000% due 01/01/2016		3,000		460	
4.000% due 01/01/2016		5,000		778	
				<u>1,848</u>	
デンマーク計				<u>1,848</u>	
(Cost \$1,886)					
フランス 5.4%					
社債・約束手形 2.9%					
Banque PSA Finance S.A.					
4.250% due 02/25/2016	EUR	200		232	
BNP Paribas Cardif S.A.					
4.032% due 11/25/2025 (a)		100		121	
BPCE S.A.					
4.625% due 07/11/2024	\$	200		207	
Credit Agricole S.A.					
6.500% due 06/23/2021 (a)	EUR	200		237	
RCI Banque S.A.					
4.250% due 04/27/2017		100		121	
SNCF Reseau					
0.375% due 02/25/2016		100		113	
				<u>1,031</u>	
ソブリン債 2.5%					
France Government Bond					
0.250% due 07/25/2024 (b)		203		248	
2.250% due 05/25/2024		300		390	
2.500% due 05/25/2030		200		273	
				<u>911</u>	
フランス計				<u>1,942</u>	
(Cost \$2,081)					
ドイツ 1.7%					
ソブリン債 1.7%					
FMS Wertmanagement					
1.875% due 05/09/2019		100		121	
Republic of Germany Inflation-Linked Bond					
0.750% due 04/15/2018 (b)		424		492	
				<u>613</u>	
ドイツ計				<u>613</u>	
(Cost \$728)					
ギリシャ 0.3%					
社債・約束手形 0.1%					
Hellenic Railways Organization S.A.					
4.500% due 12/06/2016	¥	4,000		29	
				<u>29</u>	
ソブリン債 0.2%					
Greece Government International Bond					
5.250% due 02/01/2016		10,000		71	
				<u>100</u>	
ギリシャ計				<u>100</u>	
(Cost \$136)					
香港 0.6%					
社債・約束手形 0.6%					
CNOOC Nexen Finance 2014 ULC					
4.250% due 04/30/2024	\$	200		214	
				<u>214</u>	
香港計				<u>214</u>	
(Cost \$204)					

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
インド 0.3%		
社債・約束手形 0.3%		
ICICI Bank Ltd.		
4.750% due 11/25/2016	100	105
インド計		105
(Cost \$100)		

インドネシア 1.6%		
ソブリン債 1.6%		
Indonesia Government International Bond		
2.875% due 07/08/2021	EUR 100	118
6.625% due 05/15/2033	IDR 204,000	14
8.250% due 06/15/2032	2,740,000	231
8.375% due 03/15/2034	2,611,000	225
インドネシア計		588
(Cost \$656)		

アイルランド 1.7%		
社債・約束手形 1.7%		
Bank of Ireland		
10.000% due 07/30/2016	EUR 100	122
Depfa ACS Bank		
3.875% due 11/14/2016	150	179
German Postal Pensions Securitisation PLC		
3.375% due 01/18/2016	100	116
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC		
5.375% due 02/13/2017	\$ 200	186
インドネシア計		603
(Cost \$656)		

モーゲージ担保証券 0.0%		
Silenus European Loan Conduit No.25 Ltd.		
0.198% due 05/15/2019	EUR 12	13
アイルランド計		616
(Cost \$690)		

イタリア 7.8%		
ソブリン債 7.8%		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		
1.650% due 04/23/2020 (b)	299	358
2.500% due 12/01/2024	100	124
4.500% due 03/01/2024	550	785
4.750% due 08/01/2023	600	865
4.750% due 09/01/2044	100	171
5.000% due 09/01/2040	300	512
イタリア計		2,815
(Cost \$2,836)		

日本 3.5%		
ソブリン債 3.5%		
Japan Government International Bond		
1.700% due 09/20/2044	¥ 140,000	1,249
日本計		1,249
(Cost \$1,268)		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ルクセンブルグ 4.6%		
社債・約束手形 2.0%		
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.		
6.510% due 03/07/2022	\$ 150	138
Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A.		
8.700% due 03/17/2016	RUB 14,000	213
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		
4.950% due 02/07/2017	\$ 400	383
ルクセンブルグ計		734
(Cost \$1,022)		

ソブリン債 2.6%		
European Financial Stability Facility		
1.500% due 01/22/2020	EUR 200	241
3.375% due 07/05/2021	500	676
ルクセンブルグ計		917
(Cost \$2,002)		

メキシコ 3.1%		
ソブリン債 3.1%		
Mexico Government International Bond		
1.625% due 03/06/2024	200	223
7.750% due 05/29/2031	MXN 980	77
10.000% due 12/05/2024	9,359	829
メキシコ計		1,129
(Cost \$1,173)		

オランダ 3.9%		
社債・約束手形 3.9%		
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA		
6.875% due 03/19/2020	EUR 100	137
8.375% due 07/26/2016 (a)	\$ 100	108
ING Bank NV		
2.625% due 12/05/2022	1,150	1,171
オランダ計		1,416
(Cost \$1,378)		

ノルウェー 0.2%		
ソブリン債 0.2%		
Norway Government Bond		
3.750% due 05/25/2021	NOK 500	76
ノルウェー計		76
(Cost \$76)		

ポーランド 4.9%		
ソブリン債 4.9%		
Poland Government International Bond		
3.250% due 07/25/2025	PLN 4,200	1,249
4.000% due 10/25/2023	900	280
5.500% due 10/25/2019	450	142
5.750% due 09/23/2022	300	102
ポーランド計		1,773
(Cost \$1,828)		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		
スロベニア 2.9%				5.850% due 01/31/2022	100	149	
社債・約束手形 0.3%						1,318	
Nova Ljubljanska Banka dd				スペイン計		3,165	
2.875% due 07/03/2017	EUR	100	112	(Cost \$3,412)			
ソブリン債 2.6%				アラブ首長国連邦 0.3%			
Slovenia Government				社債・約束手形 0.3%			
International Bond				Emirates Telecommunications			
4.700% due 11/01/2016		200	241	Corp.			
5.850% due 05/10/2023	\$	600	708	1.750% due 06/18/2021	100	118	
			949	アラブ首長国連邦計		118	
			1,061	(Cost \$134)			
スロベニア計							
(Cost \$1,007)				イギリス 13.2%			
				社債・約束手形 4.0%			
南アフリカ 1.2%				Barclays Bank PLC			
ソブリン債 1.2%				7.750% due 04/10/2023	\$	400	442
South Africa Government				HBOS PLC			
International Bond				0.779% due 03/21/2017	EUR	100	112
5.375% due 07/24/2044		200	219	Lloyds Bank PLC			
6.750% due 03/31/2021	ZAR	2,613	220	4.875% due 03/30/2027	GBP	100	193
			439	12.000% due 12/16/2024 (a)	\$	200	288
南アフリカ計				Spirit Issuer PLC			
(Cost \$507)				2.360% due 12/28/2036	GBP	100	149
				Tesco Corporate Treasury			
韓国 2.4%				Services PLC			
ソブリン債 2.4%				1.375% due 07/01/2019	EUR	100	111
Korea Housing Finance Corp.				Twinkle Pizza PLC			
4.125% due 12/15/2015	\$	250	256	6.625% due 08/01/2021	GBP	100	162
Republic of Korea						1,457	
2.125% due 06/10/2024	EUR	500	607				
			863				
韓国計				モーゲージ担保証券 6.8%			
(Cost \$929)				Arran Residential Mortgages			
				Funding PLC			
スペイン 8.7%				1.448% due 05/16/2047	EUR	83	94
社債・約束手形 5.1%				Eurosail PLC			
Ayt Cedula Cajas Global				1.510% due 06/13/2045	GBP	100	153
0.153% due 02/22/2018		800	880	Gemgarto			
Banco Popular Espanol S.A.				3.513% due 05/14/2045		64	102
8.250% due 04/10/2020 (a)		200	232	Granite Master Issuer PLC			
Cedulas TDA 6 Fondo de				0.180% due 12/20/2054	EUR	38	43
Titulizacion de Activos				0.374% due 12/20/2054	\$	38	38
4.250% due 04/10/2031		200	295	Great Hall Mortgages PLC			
PITCH1				0.373% due 06/18/2039		391	371
5.125% due 07/20/2022		300	440	Hercules Eclipse PLC			
			1,847	0.805% due 10/25/2018	GBP	187	286
				Leek Finance Number Eighteen			
ソブリン債 3.6%				PLC			
Autonomous Community of				0.507% due 09/21/2038	\$	285	297
Catalonia				Leek Finance Number Seventeen			
3.875% due 04/07/2015		300	338	PLC			
4.950% due 02/11/2020		50	64	0.527% due 12/21/2037		815	859
Autonomous Community of				Residential Mortgage Acceptance			
Valencia				Corporation PLC			
2.360% due 09/03/2017		100	113	0.303% due 09/12/2037	EUR	83	88
3.250% due 07/06/2015		50	57	Residential Mortgage Acceptance			
4.000% due 11/02/2016		100	119	Corporation Securities No.1 PLC			
Spain Government Bond				0.730% due 06/12/2044	GBP	84	122
1.600% due 04/30/2025		100	115			2,453	
5.150% due 10/31/2044		200	363				

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ソブリン債 2.4%		
United Kingdom Gilt		
3.250% due 01/22/2044	200	358
United Kingdom Gilt		
Inflation-Linked		
0.125% due 03/22/2024 (b)	319	535
		<u>893</u>
Total United Kingdom		4,803
(Cost \$4,732)		
アメリカ 18.5%		
資産担保証券 0.5%		
Massachusetts Educational		
Financing Authority		
1.206% due 04/25/2038	\$ 34	34
SLM Private Credit Student Loan		
Trust		
0.421% due 03/15/2024	75	75
0.481% due 12/16/2041	100	89
		<u>198</u>
社債・約束手形 2.3%		
Goldman Sachs Group, Inc.		
1.417% due 04/23/2020	100	101
International Lease Finance Corp.		
6.750% due 09/01/2016	400	426
ONEOK Partners LP		
3.375% due 10/01/2022	100	95
UIL Holdings Corp.		
4.625% due 10/01/2020	100	108
Wells Fargo & Co.		
3.000% due 02/19/2025	100	100
		<u>830</u>
モーゲージ担保証券 3.0%		
American Home Mortgage		
Investment Trust		
2.069% due 10/25/2034	48	48
Banc of America Re-REMIC Trust		
5.648% due 02/17/2051	91	96
Bear Stearns Adjustable Rate		
Mortgage Trust		
2.515% due 03/25/2035	24	24
Bear Stearns Asset-Backed		
Securities Trust		
0.371% due 12/25/2036	165	154
Citigroup Mortgage Loan Trust,		
Inc.		
2.546% due 05/25/2035	65	63
Countrywide Asset-Backed		
Certificates		
0.271% due 08/25/2037	13	13
Deutsche Alternative-A Securities		
Mortgage Loan Trust		
0.351% due 06/25/2037 (c)	50	42
HarborView Mortgage Loan Trust		
0.514% due 06/20/2035	106	102
Impac CMB Trust		
1.171% due 07/25/2033	15	14
MASTR Asset Securitization Trust		
5.500% due 11/25/2017	5	5

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Merrill Lynch Mortgage Trust		
5.690% due 02/12/2051	73	80
Morgan Stanley Re-REMIC Trust		
5.796% due 08/15/2045	86	92
Structured Adjustable Rate		
Mortgage Loan Trust		
0.491% due 10/25/2035	138	120
Thornburg Mortgage Securities		
Trust		
2.018% due 10/25/2043	217	213
WaMu Mortgage Pass-Through		
Certificates Trust		
0.451% due 11/25/2045	46	40
		<u>1,106</u>
地方債・約束手形 1.1%		
New York, New York, Municipal		
Water Finance Authority Revenue		
Bonds, Series 2010		
5.440% due 06/15/2043	200	258
Ohio, American Municipal Power		
Revenue Bonds, Series 2010		
7.334% due 02/15/2028	100	132
		<u>390</u>
米国政府機関債 3.5%		
Fannie Mae		
2.500% due 08/01/2028	87	89
4.500% due 06/01/2038	22	24
4.500% due 05/01/2041	691	752
4.500% due 07/01/2041	66	72
Ginnie Mae (d)		
3.500% due 03/01/2045	100	105
4.000% due 03/20/2045	200	213
		<u>1,255</u>
国庫債券 8.1%		
Treasury Inflation Protected		
Securities		
2.375% due 01/15/2025 (b)	2,143	2,604
U.S. Treasury Bonds		
3.625% due 02/15/2044	200	242
U.S. Treasury Notes		
0.250% due 02/28/2015	100	100
		<u>2,946</u>
アメリカ計		6,725
(Cost \$6,390)		
短期証券 11.1%		
コマーシャル・ペーパー 0.0%		
Fannie Mae		
0.060% due 03/18/2015	10	10
現先取引 8.0%		
		<u>2,900</u>
定期預金 1.1%		
ANZ National Bank		
0.030% due 03/02/2015	6	6

PIMCOケイマン・グローバル・アドバンテージ・ボンド・ファンド

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		
0.086% due 03/02/2015	GBP	5	8	0.030% due 03/02/2015	\$	1	1
1.442% due 03/02/2015	AUD	10	8	0.386% due 03/02/2015	NOK	1	0
2.550% due 03/02/2015	NZD	28	21	Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.				(0.169%) due 03/02/2015	EUR	14	15
0.005% due 03/02/2015	¥	252	2	0.005% due 03/02/2015	¥	105	1
0.030% due 03/02/2015	\$	10	10	Wells Fargo Bank			
Brown Brothers Harriman & Co.				(0.169%) due 03/02/2015	EUR	10	11
(0.750%) due 03/02/2015	DKK	2	0	0.030% due 03/02/2015	\$	8	8
0.005% due 03/02/2015	¥	3	0	0.100% due 03/02/2015	CAD	5	4
Citibank N.A.							406
0.030% due 03/02/2015	\$	63	63	メキシコ短期国債 2.0%			
DBS Bank Ltd.				2.945% due 05/14/2015	MXN	10,920	726
0.030% due 03/02/2015		116	116	短期証券計			4,042
DnB NORBank ASA				(Cost \$4,060)			
(0.169%) due 03/02/2015	EUR	5	6	投資有価証券計 110.2%			39,967
0.030% due 03/02/2015	\$	39	39	(Cost \$41,002)			
HSBC Bank				金融デリバティブ商品 (0.9%)			(307)
0.005% due 03/02/2015	¥	124	1	(Cost or Premiums, net \$(269))			
0.086% due 03/02/2015	GBP	12	19	その他資産・負債 (9.3%)			(3,388)
4.950% due 03/02/2015	ZAR	1	0				
JPMorgan Chase & Co.				純資産 100.0%			\$ 36,272
0.030% due 03/02/2015	\$	39	39				
National Australia Bank Ltd.							
1.442% due 03/02/2015	AUD	7	6				
Nordea Bank AB							
(0.183%) due 03/02/2015	SEK	2	0				
(0.169%) due 03/02/2015	EUR	19	22				

(a) Perpetual maturity, date shown represents next contractual call date.

(b) Principal amount of security is adjusted for inflation.

(c) Security is in default.

(d) When-Issued security.

◎借入およびその他金融取引

2015年2月28日現在

●現先取引

単位:千

取引相手	利率	決済日	満期	額面金額		受取担保時価	現先取引時価	未収現先取引損益
BOS	0.120%	02/27/2015	03/02/2015	\$ 2,900	U.S. Treasury Bonds 4.750% due 02/15/2041	\$ (2,972)	\$ 2,900	\$ 2,900
現先取引計						\$ (2,972)	\$ 2,900	\$ 2,900

●セール・バイバック取引

単位:千

取引相手	借入金利	借入日	満期	借入金額	買戻金額
BPS	0.031%	02/05/2015	05/07/2015	EUR (374)	\$ (423)
BPS	0.033%	02/05/2015	05/07/2015	(435)	(491)
BPS	0.035%	02/05/2015	05/07/2015	(144)	(162)
BPS	0.036%	02/05/2015	05/07/2015	(229)	(259)
BPS	0.054%	02/05/2015	05/07/2015	(313)	(351)
BPS	0.071%	02/05/2015	05/07/2015	(756)	(855)
BPS	0.071%	02/11/2015	05/07/2015	(542)	(611)
BPS	0.091%	01/29/2015	03/02/2015	¥ (153,489)	(1,284)
BPS	0.091%	03/02/2015	03/16/2015	(151,573)	(1,269)
BRC	0.122%	03/02/2015	05/07/2015	EUR (127)	(144)
JML	0.054%	02/05/2015	05/07/2015	(127)	(143)
セール・バイバック取引計					\$ (5,992)

●空売り

単位:千

取引相手	銘柄	クーポン	満期	額面	収益	空売り払込
FOB	Fannie Mae	4.000%	04/01/2045	\$ 1,300	\$ (1,383)	\$ (1,387)
FOB	Fannie Mae	3.500%	04/25/2045	300	(312)	(314)
JPS	Fannie Mae	4.500%	03/01/2045	300	(325)	(326)
空売り計					\$ (2,020)	\$ (2,027)

◎上場金融デリバティブ商品

2015年2月28日現在

●先物取引

単位:千(契約数を除く)

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現評価損益	変動証拠金	
					資産	負債
5-Year USD Deliverable Interest Rate Swap March Futures	Short	03/2015	2	\$ (2)	\$ 0	\$ 0
10-Year USD Deliverable Interest Rate Swap March Futures	Short	03/2015	18	(55)	0	(3)
Canada Government 10-Year Bond June Futures	Short	06/2015	4	(6)	0	0
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Long	06/2015	1	0	0	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2015	25	10	4	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Short	06/2015	1	0	1	0
Call Option Strike @ EUR 160.000 on Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	05/2015	5	1	0	(3)
Put Option Strike @ EUR 152.000 on Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	05/2015	5	1	0	(2)
Put Option Strike @ EUR 111.100 on Euro-Schatz 2-Year Bond June Futures	Short	05/2015	4	0	0	0
先物取引計				\$ (51)	\$ 5	\$ (8)

●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(クレジットインデックス)ー売り

単位:千

	固定取引			市場価格	未実現評価損益	変動証拠金	
	受取金利	満期	想定元本			資産	負債
CDX.IG-23 Index	1.000%	12/20/2019	\$ 1,900	\$ 38	\$ 11	\$ 0	\$ 0

金利スワップ

単位:千

変動金利の 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金							
							資産	負債						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.013%	01/23/2025	SEK 500	\$ (1)	\$ (1)	\$ 0	\$ (1)						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.023%	01/23/2025	400	0	0	0	0						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.033%	01/23/2025	400	0	0	0	0						
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.036%	01/23/2025	500	(1)	(1)	0	(1)						
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.200%	07/15/2015	\$ 100	(1)	(1)	0	0						
Receive	3-Month USD-LIBOR	0.800%	09/25/2017	10,300	100	(47)	0	(7)						
Pay	3-Month USD-LIBOR	4.000%	09/21/2021	500	42	8	1	0						
Pay	3-Month USD-LIBOR	3.000%	12/17/2024	100	8	2	0	0						
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.750%	06/17/2025	1,300	65	30	2	0						
Pay	3-Month USD-LIBOR	3.750%	06/18/2044	600	169	152	3	0						
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.250%	12/17/2019	AUD 1,400	44	41	3	0						
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.750%	12/17/2019	1,400	71	42	3	0						
Pay	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	100	5	0	1	0						
Receive	6-Month EURIBOR	0.500%	03/18/2020	EUR 400	(5)	(8)	0	0						
Pay	6-Month EURIBOR	1.250%	03/18/2025	400	25	2	0	0						
Receive	6-Month EURIBOR	1.250%	03/18/2025	400	(25)	(1)	0	0						
Pay	6-Month EURIBOR	0.750%	09/16/2025	200	0	0	0	(1)						
Receive	6-Month EURIBOR	2.000%	03/18/2045	900	(210)	(197)	0	(1)						
Pay	6-Month GBP-LIBOR	2.250%	03/18/2020	GBP 300	16	(5)	0	(2)						
Receive	6-Month GBP-LIBOR	2.750%	03/18/2025	700	(88)	27	8	0						
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.500%	09/17/2021	¥ 440,000	(56)	(28)	0	(3)						
Receive	6-Month JPY-LIBOR	1.000%	09/18/2023	50,000	(22)	(16)	0	(1)						
Pay	6-Month JPY-LIBOR	1.250%	06/17/2035	30,000	4	(1)	1	0						
Pay	6-Month JPY-LIBOR	1.500%	12/20/2044	20,000	6	5	1	0						
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.000%	09/16/2025	PLN 600	(1)	0	0	0						
Pay	IBMEXID	5.610%	07/07/2021	MXN 23,200	15	11	0	(5)						
Pay	IBMEXID	5.630%	10/11/2021	400	0	0	0	0						
Pay	IBMEXID	5.715%	10/15/2021	3,400	3	(3)	0	(1)						
Pay	IBMEXID	5.620%	11/09/2021	1,000	0	0	0	0						
Pay	IBMEXID	5.560%	11/11/2021	100	0	0	0	0						
Pay	IBMEXID	6.710%	09/20/2029	700	2	1	0	0						
							\$	165	\$	12	\$	23	\$	(23)
スワップ契約計							\$	203	\$	23	\$	23	\$	(23)

◎店頭金融デリバティブ商品

2015年2月28日現在

●先渡外国為替契約

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				
AZD	04/2015	IDR	4,657,269	\$	357	\$	2	\$	0
BOA	03/2015	RUB	28,838		472		5		0
BOA	03/2015	\$	442	RUB	28,838		25		0
BOA	04/2015	RUB	24,920	\$	400		5		0
BOA	04/2015	\$	113	BRL	327		0		0
BOA	04/2015		208	ILS	822		0		(2)
BOA	05/2015		31	EUR	27		0		0
BOA	05/2015		37	MXN	544		0		(1)
BOA	05/2015		73	TWD	2,296		0		0
BOA	08/2015		203	SEK	1,695		1		0
BPS	05/2015		128	EUR	113		0		(1)
BPS	06/2015		246	COP	565,682		0		(21)
BPS	01/2016	DKK	2,255	\$	351		8		0
BRC	03/2015	RUB	79,022		1,258		0		(20)
BRC	03/2015	TRY	35		14		0		0
BRC	03/2015	\$	1,292	RUB	79,022		0		(14)
BRC	04/2015		1,222		78,369		21		0
BRC	04/2015		82	ZAR	962		0		0
BRC	04/2015	ZAR	259	\$	22		0		0
BRC	05/2015	MXN	1,414		94		0		0
CBK	03/2015	JPY	1,528		13		0		0
CBK	03/2015	RUB	16,208		265		3		0
CBK	03/2015	\$	9	JPY	1,050		0		0
CBK	03/2015		230	RUB	16,208		32		0
CBK	04/2015	GBP	437	\$	672		0		(3)
CBK	04/2015	PLN	309		83		0		0
CBK	04/2015	\$	193	CLP	120,148		0		0
CBK	04/2015		36	CZK	882		0		0
CBK	04/2015		33	HKD	256		0		0
CBK	04/2015		54	ILS	215		0		0
CBK	04/2015		58	SGD	79		0		0
CBK	04/2015		80	ZAR	941		0		0
CBK	05/2015	MXN	10,796	\$	732		13		0
CBK	05/2015	\$	878	KRW	959,370		0		(10)
CBK	05/2015		352	MXN	5,285		0		0
DUB	03/2015	RUB	13,568	\$	222		2		0
DUB	03/2015	\$	191	RUB	13,568		28		0
DUB	04/2015		223	HKD	1,729		0		0
DUB	04/2015		78	RON	312		1		0
DUB	05/2015		122	IDR	1,552,698		0		(4)
DUB	07/2015		170	BRL	461		0		(15)
DUB	08/2015	DKK	4,510	\$	696		14		0
DUB	10/2015		2,967		459		10		0
DUB	01/2016		717		111		2		0

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	
FBF	03/2015	RUB	11,440	187	2	0
FBF	03/2015	\$	163	RUB 11,440	22	0
FBF	05/2015		105	KRW 116,036	0	0
GLM	03/2015	JPY	42,300	\$ 357	3	0
GLM	03/2015	\$	98	AUD 126	1	0
GLM	03/2015		220	CAD 274	0	(1)
GLM	03/2015		163	GBP 106	1	0
GLM	04/2015		62	CLP 38,452	0	0
GLM	04/2015		379	INR 23,870	5	0
GLM	04/2015		2,436	JPY 288,787	0	(19)
GLM	05/2015	EUR	3,732	\$ 4,270	80	0
GLM	05/2015	\$	1,067	EUR 937	0	(15)
GLM	05/2015		197	PHP 8,725	1	0
GLM	05/2015		300	THB 9,841	3	0
GLM	08/2015	NOK	155	\$ 21	0	0
HUS	03/2015	\$	105	TRY 266	0	0
HUS	04/2015	PLN	446	\$ 121	1	0
HUS	04/2015	RUB	18,988	300	0	(1)
HUS	04/2015	\$	436	CNH 2,748	0	(1)
HUS	04/2015		203	SGD 272	0	(3)
HUS	05/2015		396	TWD 12,446	0	0
HUS	06/2015		105	COP 264,075	0	0
HUS	07/2015	PLN	800	\$ 214	0	(1)
HUS	08/2015	\$	275	DKK 1,780	0	(6)
JPM	03/2015	AUD	407	\$ 323	4	0
JPM	03/2015	BRL	1,916	674	4	0
JPM	03/2015	RUB	16,842	272	2	(3)
JPM	03/2015	\$	666	BRL 1,916	4	0
JPM	03/2015		245	RUB 16,842	28	0
JPM	04/2015	MXN	3,259	\$ 221	4	0
JPM	04/2015	PLN	234	64	0	0
JPM	04/2015	RUB	61,682	980	5	(4)
JPM	04/2015	\$	667	BRL 1,916	0	(4)
JPM	04/2015		174	CZK 4,176	0	(4)
JPM	04/2015		94	IDR 1,235,677	0	0
JPM	04/2015		334	JPY 39,800	0	(1)
JPM	04/2015		62	MYR 225	0	0
JPM	04/2015		179	PEN 538	0	(6)
JPM	04/2015		333	TRY 845	0	(2)
JPM	05/2015		33	PHP 1,455	0	0
JPM	05/2015		47	THB 1,525	0	0
JPM	06/2015		974	INR 61,740	8	0
JPM	07/2015	PLN	2,825	\$ 752	0	(8)
JPM	09/2015	\$	1,303	CNY 8,000	0	(36)
JPM	10/2015	DKK	101	\$ 15	0	0
JPM	01/2016	BRL	589	200	11	0
JPM	01/2016	DKK	299	46	0	0
MSB	03/2015	BRL	1,916	666	0	(4)

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		
MSB	03/2015	RUB	1,313	20	0	(1)	
MSB	03/2015	\$	714	BRL	1,916	0	(44)
MSB	03/2015		21	RUB	1,313	0	0
MSB	04/2015	DKK	125	\$	19	0	0
MSB	01/2016		490		75	1	0
SCX	04/2015	CNY	7,528		1,213	0	(1)
SOG	04/2015	\$	227	MYR	812	0	(3)
UAG	04/2015	DKK	78	\$	12	0	0
UAG	04/2015	\$	116	IDR	1,485,281	0	(2)
UAG	05/2015		337	CHF	315	0	(3)
UAG	05/2015		40	EUR	35	0	(1)
UAG	10/2015	DKK	102	\$	16	0	0
					\$	362	\$ (265)

● Institutional FC(JPY,Hedged)及びJ(JPY,Hedged)の先渡外国為替契約

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	03/2015	CHF	99	\$	111	\$	6	\$	0
BOA	03/2015	DKK	378		58		1		0
BOA	03/2015	EUR	88		100		1		0
BOA	03/2015	JPY	327,442		2,742		3		0
BOA	03/2015	SEK	739		90		1		0
BOA	03/2015	\$	3,252	JPY	384,863		0		(32)
BOA	04/2015		2,680		320,041		0		(1)
BPS	03/2015	AUD	201	\$	158		1		0
BPS	03/2015	JPY	320,041		2,678		1		0
BPS	03/2015	NOK	152		19		0		0
BPS	04/2015	\$	13	EUR	11		0		0
BPS	04/2015		2,679	JPY	320,041		0		(1)
BRC	03/2015	CAD	381	\$	306		1		0
CBK	03/2015	EUR	66		74		0		0
CBK	03/2015		3		3		0		0
CBK	03/2015	JPY	119		1		0		0
CBK	03/2015	\$	156	AUD	201		1		0
CBK	03/2015		12	JPY	1,413		0		0
CBK	03/2015		3,168		373,826		0		(41)
CBK	04/2015	AUD	201	\$	156		0		(1)
CBK	04/2015	\$	1	AUD	1		0		0
CBK	04/2015		2	CAD	3		0		0
CBK	04/2015		2	EUR	2		0		0
DUB	03/2015	JPY	320,041	\$	2,677		0		0
DUB	03/2015		1,294		11		0		0
DUB	04/2015		931		8		0		0
DUB	04/2015	\$	2,689	JPY	321,334		0		0
FBF	03/2015	EUR	1	\$	1		0		0
FBF	03/2015	NZD	12		9		0		0

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
FBF	03/2015	\$ 48	JPY 5,606	0	(1)
GLM	03/2015		CHF 99	0	0
GLM	04/2015	CHF 99	\$ 105	0	0
GLM	04/2015	JPY 5,712	48	0	0
JPM	03/2015	\$ 3	EUR 3	0	0
JPM	03/2015	82	JPY 9,632	0	(1)
JPM	04/2015	EUR 3	\$ 3	0	0
JPM	04/2015	\$ 2	GBP 1	0	0
MSB	03/2015	3,156	JPY 373,597	0	(31)
MSB	04/2015	EUR 1,826	\$ 2,061	12	0
MSB	04/2015	GBP 297	448	0	(11)
RBC	03/2015	\$ 306	CAD 381	0	(1)
RBC	04/2015	CAD 381	\$ 306	1	0
UAG	03/2015	JPY 180,001	1,506	0	0
UAG	03/2015	\$ 112	EUR 99	0	(2)
UAG	04/2015	EUR 99	\$ 112	2	0
UAG	04/2015	\$ 1,507	JPY 180,001	0	0
				\$ 31	\$ (123)
先渡外国為替契約計				\$ 393	\$ (388)

●買建オプション

金利スワップション

単位:千

取引相手	銘柄	変動金利インデックス	変動金利の支払/受取	行使レート	満期	想定元本	費用	市場価格
GST	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	1.000%	09/01/2016	EUR 800	\$ 12	\$ 31

通貨オプション

単位:千

取引相手	銘柄	行使価格	満期	想定元本	費用	市場価格
BRC	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 122.000	04/30/2015	\$ 100	\$ 1	\$ 1
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	122.000	04/30/2015	300	2	2
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	122.000	04/30/2015	300	2	2
					\$ 5	\$ 5
買建オプション計					\$ 17	\$ 36

● 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	変動金利インデックス	変動金利の支払/受取	行使レート	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格
DUB	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.195%	09/21/2015	EUR 6,600	\$ (4)	\$ (19)
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.310%	09/21/2015	6,600	(13)	(4)
GLM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.350%	09/08/2015	1,300	(3)	(8)
GLM	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.350%	09/08/2015	1,300	(3)	(1)
GST	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	1.493%	09/01/2016	300	(11)	(38)
							<u>\$ (34)</u>	<u>\$ (70)</u>

クレジットデフォルトスワップション

単位:千

取引相手	銘柄	売買プロテクション	行使レート	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格
BOA	Put - CDX.IG-23 Index	Sell	1.000%	04/15/2015	\$ 100	\$ 0	\$ 0
JPM	Put - CDX.IG-23 Index	Sell	1.000%	04/15/2015	900	(1)	0
						<u>\$ (1)</u>	<u>\$ 0</u>

通貨オプション

単位:千

取引相手	銘柄	行使価格	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN 15.450	03/17/2015	\$ 300	\$ (3)	\$ 0
BRC	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 116.950	04/30/2015	100	(1)	(1)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	116.950	04/30/2015	300	(2)	(2)
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY 6.600	02/05/2016	100	(1)	(1)
HUS	Put - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 116.950	04/30/2015	300	(2)	(2)
JPM	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY 6.600	02/05/2016	90	(1)	(1)
MSB	Call - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN 15.450	03/17/2015	400	(4)	(1)
					<u>\$ (14)</u>	<u>\$ (8)</u>

インフレフロアオプション

単位:千

取引相手	銘柄	イニシャルインデックス	変動金利	満期	想定元本	プレミアム(受取)	市場価格
CBK	Floor - OTC CPURNSA Index	216.687	Maximum of [1 - (Index Final/Index Initial) or \$0]	04/07/2020	\$ 500	\$ (4)	\$ 0
DUB	Floor - OTC CPURNSA Index	218.011	Maximum of [-(Final Index/Initial Index - 1), 0]	10/13/2020	100	(1)	0
						<u>\$ (5)</u>	<u>\$ 0</u>
売建オプション計						<u>\$ (54)</u>	<u>\$ (78)</u>

●スワップ契約

クレジットデフォルトスワップ(社債・ソブリン債・地方債)－売り

単位:千

取引相手	固定取引 受取金利	満期	2015/2/28時点の 信用スプレッド	想定元本	プレミアム		スワップ契約時価	
					支払(受取)	未実現評価損益	資産	負債
BOA Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	2.337%	\$ 200	\$ (6)	\$ (6)	\$ 0	\$ (12)
BOA France Government Bond	0.250 %	03/20/2020	0.372%	200	(1)	0	0	(1)
BOA South Africa Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	1.778%	200	(6)	(1)	0	(7)
BPS Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	300	(6)	3	0	(3)
BPS Petrobras Global Finance BV	1.000 %	09/20/2019	6.164%	200	(10)	(28)	0	(38)
BRC Indonesia Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	1.186%	100	(1)	1	0	0
BRC Indonesia Government International Bond	1.000 %	03/20/2024	1.918%	100	(14)	7	0	(7)
BRC Russia Government International Bond	1.000 %	12/20/2015	4.341%	400	(13)	3	0	(10)
BRC South Africa Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.848%	700	(29)	3	0	(26)
CBK Freeport-McMoRan, Inc.	1.000 %	03/20/2016	0.630%	100	0	1	1	0
CBK South Africa Government International Bond	1.000 %	06/20/2019	1.699%	150	(6)	2	0	(4)
CBK Teck Resources Ltd.	1.000 %	03/20/2016	0.600%	100	0	1	1	0
DUB Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	100	(2)	1	0	(1)
GST Brazil Government International Bond	1.000 %	09/20/2015	0.991%	100	(1)	1	0	0
GST Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	2.337%	300	(8)	(9)	0	(17)
GST France Government Bond	0.250 %	03/20/2020	0.372%	300	(3)	1	0	(2)
GST Greece Government International Bond	1.000 %	09/20/2015	31.996%	200	(6)	(24)	0	(30)
GST Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	100	(2)	1	0	(1)
HUS Brazil Government International Bond	1.000 %	06/20/2016	1.396%	300	(2)	1	0	(1)
HUS Brazil Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	2.273%	200	(2)	(8)	0	(10)
HUS Brazil Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	2.337%	100	(3)	(3)	0	(6)
HUS Indonesia Government International Bond	1.000 %	06/20/2023	1.862%	25	(2)	1	0	(1)
JPM France Government Bond	0.250 %	03/20/2020	0.372%	200	(2)	1	0	(1)
JPM Indonesia Government International Bond	1.000 %	09/20/2019	1.186%	100	(1)	1	0	0
JPM Indonesia Government International Bond	1.000 %	12/20/2019	1.260%	200	(4)	2	0	(2)
JPM Russia Government International Bond	1.000 %	12/20/2015	4.341%	300	(10)	2	0	(8)
JPM Russia Government International Bond	1.000 %	03/20/2016	4.374%	100	(4)	1	0	(3)
MYC H.J. Heinz Co.	1.000 %	03/20/2020	1.822%	100	(4)	0	0	(4)
UAG Export-Import Bank of China	1.000 %	06/20/2016	0.453%	100	(2)	3	1	0
					\$ (150)	\$ (42)	\$ 3	\$ (195)

クロス通貨スワップ

単位:千

取引相手	受取	支払	満期	想定元本 通貨受取	想定元本 通貨支払	プレミアム 支払/(受取)	未実現 評価損益	スワップ契約時価			
								資産	負債		
BOA	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.100% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2020	\$ 371	EUR 300	\$ 0	\$ 4	\$ 4	\$ 0		
BOA	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.200% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2025	116	100	0	1	1	0		
BPS	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.100% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2020	1,288	977	(73)	13	0	(60)		
CBK	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.200% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2025	872	750	(8)	10	2	0		
DUB	Floating rate equal to 3-Month EURIBOR less 0.100% based on the notional amount of currency delivered	Floating rate equal to 3-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency received	06/17/2020	1,239	1,000	0	13	13	0		
								\$ (81)	\$ 41	\$ 20	\$ (60)

金利スワップ

単位:千

取引相手	変動金利の		固定金利	満期	想定 元本	プレミアム 支払/(受取)	未実現 評価損益	スワップ契約時価			
	支払/受取	変動金利インデックス						資産	負債		
BOA	Pay	BRL-CDI-Compounded	8.420%	01/02/2017	BRL 1,000	\$ 3	\$ (31)	\$ 0	\$ (28)		
BPS	Pay	BRL-CDI-Compounded	11.470%	01/02/2017	400	0	(1)	0	(1)		
BPS	Pay	BRL-CDI-Compounded	12.360%	01/02/2018	700	0	0	0	0		
BPS	Pay	BRL-CDI-Compounded	11.680%	01/04/2021	1,800	(4)	(2)	0	(6)		
JPM	Pay	BRL-CDI-Compounded	11.320%	01/04/2016	600	0	0	0	0		
								\$ (1)	\$ (34)	\$ 0	\$ (35)
スワップ契約計								\$ (232)	\$ (35)	\$ 23	\$ (290)

野村マネー マザーファンド

第12期(2014年8月19日決算)
(計算期間：2013年8月20日～2014年8月19日)

《運用報告書》

受益者のみなさまへ

野村マネー マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

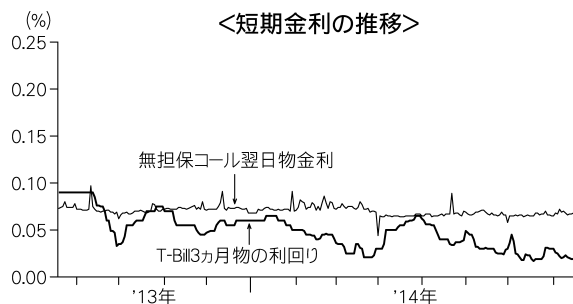
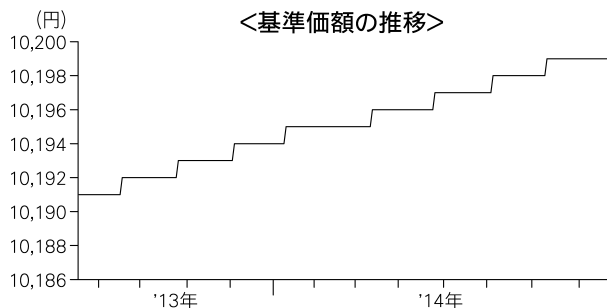
<http://www.nomura-am.co.jp/>

◎運用経過

1. 基準価額の推移

* 基準価額は0.08%の上昇

基準価額は、期初10,191円から期末は10,199円となりました。



○運用環境

国内経済は、2014年4月の消費税増税に伴う駆け込み需要の反動減の影響を受けつつも、期を通じて底堅く推移した個人消費や、企業収益の改善に伴い緩やかな増加がみられる設備投資などの内需が下支えとなる一方、輸出は弱めの動きとなりました。このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続しました。

●無担保コール翌日物金利の推移

概ね0.06%台～0.07%台で推移しました。

●T-Bill (国庫短期証券) 3ヵ月物の利回りの推移

- ・ 期初から2013年9月半ばまでは概ね0.09%台で推移しました。
- ・ 2013年9月末以降、需給の変化を受けて概ね0.02%台から0.07%台の範囲で推移し、期末には0.02%台となりました。

2. ポートフォリオ

- (1) 残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー (CP) 等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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るという方針のもと、運用してまいりました。
- (2) 今期の運用につきましては、国債を中心に政府保証債や利付金融債、CPによってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローンなどにより運用してまいりました。

◎今後の運用方針

残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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る運用を行なう方針です。

今後とも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の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	0円
合 計	0

* (a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎期中の売買及び取引の状況 (自2013年8月20日 至2014年8月19日)

(1) 公社債

	買付額	売付額
国 内	千円	千円
国 債 証 券	84,793,709	58,094,433 (28,403,900)
特 殊 債 券	4,391,973	— (1,935,000)
社債券(投資法人債券を含む)	841,662	— (700,000)

* 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

* 単位未満は切り捨て。

* ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

(2) その他有価証券

		買付額	売付額
国	内	千円	千円
	コマーシャル・ペーパー	1,099,678	— (600,000)

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()内は償還等による増減分です。

◎組入資産の明細

(1) 国内(邦貨建)公社債

区 分	期 首					当 期 末							
	組入比率	うちBB格		残存期間別組入比率			額面金額	評価額	組入比率	うちBB格		残存期間別組入比率	
		以下組入比率	%	%	5年以上	2年以上				2年未満	以下組入比率	%	%
国 債 証 券	73.4 (60.2)	— (—)	— (—)	— (—)	73.4 (60.2)	2,179,350 (—)	2,179,848 (—)	25.2 (—)	— (—)	— (—)	— (—)	25.2 (—)	
特殊債券(除く金融債)	6.6 (6.6)	— (—)	— (—)	— (—)	6.6 (6.6)	2,290,000 (2,290,000)	2,301,511 (2,301,511)	26.6 (26.6)	— (—)	— (—)	— (—)	26.6 (26.6)	
金 融 債 券	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	— (—)	0.9 (0.9)	540,000 (540,000)	540,935 (540,935)	6.3 (6.3)	— (—)	— (—)	— (—)	6.3 (6.3)	
普通社債券(含む投資法人債券)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	140,000 (140,000)	140,014 (140,014)	1.6 (1.6)	— (—)	— (—)	— (—)	1.6 (1.6)	
合 計	80.9 (67.7)	— (—)	— (—)	— (—)	80.9 (67.7)	5,149,350 (2,970,000)	5,162,309 (2,982,460)	59.7 (34.5)	— (—)	— (—)	— (—)	59.7 (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。

*—印は組み入れなし。

*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。

国内(邦貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
国 債 証 券	国庫債券 利付(2年)第320回	0.1	260,000	260,016	2014/9/15
	国庫債券 利付(2年)第321回	0.1	547,300	547,339	2014/10/15
	国庫債券 利付(2年)第322回	0.1	395,000	395,047	2014/11/15
	国庫債券 利付(2年)第323回	0.1	202,650	202,676	2014/12/15
	国庫債券 利付(2年)第324回	0.1	190,000	190,037	2015/1/15
	国庫債券 利付(2年)第325回	0.1	140,000	140,036	2015/2/15
	国庫債券 利付(2年)第327回	0.1	129,000	129,026	2015/4/15
	国庫債券 利付(5年)第85回	0.7	132,200	132,277	2014/9/20
	国庫債券 利付(5年)第86回	0.6	115,100	115,155	2014/9/20
	国庫債券 利付(10年)第263回	1.6	39,900	39,955	2014/9/20
	国庫債券 利付(10年)第264回	1.5	15,050	15,069	2014/9/20
	国庫債券 利付(20年)第27回	5.0	13,150	13,210	2014/9/22
小 計		—	—	2,179,848	—
特殊債券(除く金融債)	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第331回	1.8	63,000	63,029	2014/8/29
	道路債券 政府保証第334回	1.5	100,000	100,379	2014/11/28
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第336回	1.4	170,000	170,984	2015/1/28

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第337回	1.3	千円 71,000	千円 71,447	2015/2/27
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第338回	1.5	54,000	54,453	2015/3/27
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第341回	1.3	100,000	100,927	2015/5/29
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第343回	1.3	171,000	172,781	2015/6/30
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第345回	1.2	50,000	50,524	2015/7/29
	首都高速道路債券 政府保証第193回	1.5	100,000	100,139	2014/9/26
	首都高速道路債券 政府保証第195回	1.4	211,000	212,205	2015/1/26
	首都高速道路債券 政府保証第198回	1.3	10,000	10,103	2015/6/26
	阪神高速道路債券 政府保証第141回	1.5	53,000	53,202	2014/11/28
	阪神高速道路債券 政府保証第145回	1.4	10,000	10,087	2015/4/20
	阪神高速道路債券 政府保証第147回	1.2	50,000	50,526	2015/7/29
	公営企業債券 政府保証第842回	1.8	55,000	55,019	2014/8/26
	公営企業債券 政府保証第843回	1.5	30,000	30,048	2014/9/29
	公営企業債券 政府保証第844回	1.6	12,000	12,034	2014/10/28
	公営企業債券 政府保証第845回	1.5	60,000	60,228	2014/11/28
	公営企業債券 政府保証第847回	1.4	100,000	100,572	2015/1/27
	公営企業債券 政府保証第848回	1.3	105,000	105,654	2015/2/24
	中小企業債券 政府保証第182回	1.5	70,000	70,098	2014/9/24
	国民生活債券 政府保証第14回	1.5	375,000	375,359	2014/9/17
	都市再生債券 政府保証第22回	0.4	120,000	120,214	2015/3/10
関西国際空港債券 政府保証第47回	1.3	150,000	151,488	2015/6/17	
小 計		-	-	2,301,511	-
金 融 債 券	商工債券 利付第711回い号	1.0	100,000	100,022	2014/8/27
	商工債券 利付第718回い号	0.65	70,000	70,231	2015/3/27
	農林債券 利付第711回い号	1.05	70,000	70,016	2014/8/27
	農林債券 利付第719回い号	0.7	100,000	100,404	2015/4/27
	しんきん中金債券 利付第237回	1.0	50,000	50,011	2014/8/27
	しんきん中金債券 利付第242回	0.7	50,000	50,130	2015/1/27
小 計		-	-	540,935	-
普通社債券(含む投資法人債券)	東邦瓦斯 第35回社債間限定同順位特約付	0.3	140,000	140,014	2014/9/9
小 計		-	-	140,014	-
合 計		-	-	5,162,309	-

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 国内その他有価証券

区 分	期 首		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 -	% -	千円 499,839	% 5.8

*比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*一印は組み入れなし。

*金額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成 (2014年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	5,162,309	58.5
そ の 他 有 価 証 券	499,839	5.7
コール・ローン等、その他	3,165,958	35.8
投 資 信 託 財 産 総 額	8,828,106	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

(2014年8月19日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	8,828,106,541
コール・ローン等	3,153,091,003
公社債(評価額)	5,162,309,235
その他有価証券	499,839,922
未 収 利 息	7,954,384
前 払 費 用	4,911,997
(B) 負 債	180,029,000
未 払 金	180,029,000
(C) 純資産総額(A-B)	8,648,077,541
元 本	8,478,942,189
次 期 繰 越 損 益 金	169,135,352
(D) 受 益 権 総 口 数	8,478,942,189口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,199円

◎損益の状況

(自2013年8月20日 至2014年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	24,840,577
受 取 利 息	23,802,394
そ の 他 収 益 金	1,038,183
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 19,039,618
売 買 益	69,649
売 買 損	△ 19,109,267
(C) 信 託 報 酬 等	△ 108,072
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	5,692,887
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	99,189,715
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	209,503,691
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 145,250,941
(H) 計 (D+E+F+G)	169,135,352
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	169,135,352

*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。

*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。

(注)期首元本額5,198百万円、期中追加設定元本額10,671百万円、期中一部解約元本額7,391百万円、計算口数当たり純資産額10,199円。

◎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 百万円
野村アフリカ株投資 マネーブル・ファンド	14
野村米国ハイ・イールド債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	86
野村新中国株投資 マネーブル・ファンド	34
野村日本ブランド株投資(マネーブルファンド)年2回決算型	557
野村新米国ハイ・イールド債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	13
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーブル・ファンド	7
野村RCM・グリーン・テクノロジー マネーブル・ファンド	1
野村新興国消費関連株投資 マネーブル・ファンド	10
野村世界業種別投資シリーズ(マネーブル・ファンド)	34
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーブル・ファンド)	304
野村新エマージング債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	6
野村クラウドコンピューティング&スマートグリッド関連株投資 マネーブルファンド	19
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	9
野村グローバルCB投資(マネーブルファンド)年2回決算型	4
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(マネーブルファンド)年2回決算型	65
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	1
野村日本スマートシティ株投資 マネーブルファンド	18
野村世界高金利通貨投資	151
野村新世界高金利通貨投資	0
コインの未来(毎月分配型)	3
コインの未来(年2回分配型)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
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	0
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	0
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(ユーロコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	0

ファンド名	当期末
	元本額 百万円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース	0
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Bコース	0
野村新エマージング債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(中国元コース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(中国元コース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
野村高金利国際機関債投資(毎月分配型)	49
野村アジアCB投資(毎月分配型)	0
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	0
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
ノムラ新興国債券ファンド(野村SMA向け)	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	0
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	0
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	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	0
野村高金利国際機関債投資(年2回決算型)	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Aコース)	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村カルミニャック・ファンド Aコース	0
野村カルミニャック・ファンド Bコース	0
野村通貨選択日本株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(中国元コース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(インドネシアルピアコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投資(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(中国元コース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
野村通貨選択日本株投資(インドルピーコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投資(ロシアルーブルコース)年2回決算型	0
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	0
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	0
ノムラ THE USA Aコース	0
ノムラ THE USA Bコース	0
ノムラ THE EUROPE Aコース	0
ノムラ THE EUROPE Bコース	0
米国変動好金利ファンド Aコース	8
米国変動好金利ファンド Bコース	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村アジアハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)年2回決算型	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村グローバルボンド投資 Aコース	0
野村グローバルボンド投資 Bコース	0
野村グローバルボンド投資 Cコース	0
野村グローバルボンド投資 Dコース	0
野村グローバルボンド投資 Eコース	0
野村グローバルボンド投資 Fコース	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)年2回決算型	0
第1回 野村短期公社債ファンド	0
第2回 野村短期公社債ファンド	0
第3回 野村短期公社債ファンド	0
第4回 野村短期公社債ファンド	0
第5回 野村短期公社債ファンド	0
第6回 野村短期公社債ファンド	0
第7回 野村短期公社債ファンド	0
第8回 野村短期公社債ファンド	0
第9回 野村短期公社債ファンド	0
第10回 野村短期公社債ファンド	0
第11回 野村短期公社債ファンド	0
第12回 野村短期公社債ファンド	0
野村グローバル債券為替ファンド(適格機関投資家転売制限付)	110
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)	3,806
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	3,030
グローバル・マルチテーマ・ファンドP ハイブリッド型(適格機関投資家専用)	0
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Bコース	0

*単位未満は切り捨て。

〈お申し込み時の留意点〉

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

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

(2015年6月25日現在)

年 月	日
2015年6月	—
7月	3
8月	—
9月	7
10月	—
11月	26
12月	25

※2015年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情により突然変更される場合があります。

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

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