

野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース

運用報告書(全体版)

第78期（決算日2016年1月25日） 第79期（決算日2016年2月25日） 第80期（決算日2016年3月25日）
第81期（決算日2016年4月25日） 第82期（決算日2016年5月25日） 第83期（決算日2016年6月27日）
作成対象期間（2015年12月26日～2016年6月27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）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）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 B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）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）	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。
	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 B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。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
分配方針	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	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率					
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
54期(2014年1月27日)	11,019	20	△1.6	135.02	△1.7	0.0	—	98.3	175
55期(2014年2月25日)	11,131	20	1.2	136.47	1.1	0.0	—	98.6	176
56期(2014年3月25日)	11,081	20	△0.3	136.47	0.0	0.0	—	98.5	168
57期(2014年4月25日)	11,227	20	1.5	138.48	1.5	0.0	—	98.5	167
58期(2014年5月26日)	11,325	20	1.1	139.65	0.8	0.0	—	98.4	169
59期(2014年6月25日)	11,458	20	1.4	140.72	0.8	0.0	—	98.3	168
60期(2014年7月25日)	11,392	20	△0.4	140.53	△0.1	0.0	—	98.3	166
61期(2014年8月25日)	11,495	20	1.1	142.62	1.5	0.0	—	98.3	164
62期(2014年9月25日)	11,760	20	2.5	146.16	2.5	0.0	—	98.3	167
63期(2014年10月27日)	11,617	20	△1.0	145.14	△0.7	0.0	—	98.2	165
64期(2014年11月25日)	12,538	20	8.1	156.50	7.8	0.0	—	97.5	158
65期(2014年12月25日)	12,410	20	△0.9	155.50	△0.6	0.0	—	98.1	154
66期(2015年1月26日)	12,135	20	△2.1	151.26	△2.7	0.0	—	98.1	151
67期(2015年2月25日)	12,203	20	0.7	152.74	1.0	0.0	—	98.0	149
68期(2015年3月25日)	12,173	20	△0.1	152.30	△0.3	0.0	—	98.0	147
69期(2015年4月27日)	12,071	20	△0.7	151.79	△0.3	0.1	—	97.9	143
70期(2015年5月25日)	12,154	20	0.9	153.72	1.3	0.0	—	97.7	131
71期(2015年6月25日)	12,279	20	1.2	155.99	1.5	0.0	—	97.7	130
72期(2015年7月27日)	12,074	20	△1.5	153.52	△1.6	0.0	—	97.5	128
73期(2015年8月25日)	11,578	20	△3.9	148.49	△3.3	0.0	—	97.4	123
74期(2015年9月25日)	11,398	20	△1.4	146.66	△1.2	0.0	—	97.3	123
75期(2015年10月26日)	11,676	20	2.6	150.48	2.6	0.0	—	97.3	125
76期(2015年11月25日)	11,646	20	△0.1	149.99	△0.3	0.0	—	97.2	124
77期(2015年12月25日)	11,369	20	△2.2	147.11	△1.9	0.0	—	97.1	122
78期(2016年1月25日)	11,018	20	△2.9	143.56	△2.4	0.0	—	97.0	118
79期(2016年2月25日)	10,474	20	△4.8	137.87	△4.0	0.1	—	96.7	111
80期(2016年3月25日)	10,872	20	4.0	142.71	3.5	0.0	—	96.7	115
81期(2016年4月25日)	10,921	20	0.6	143.50	0.6	0.0	—	97.0	125
82期(2016年5月25日)	10,625	20	△2.5	139.96	△2.5	0.0	—	96.8	122
83期(2016年6月27日)	10,024	20	△5.5	132.20	△5.5	0.1	—	96.5	114

* 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。

* 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（ヘッジなし・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（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）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рил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рил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		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 入 比 率
			騰 落 率		騰 落 率			
第78期	(期 首)	円	%		%	%	%	%
	2015年12月25日	11,369	—	147.11	—	0.0	—	97.1
	12月末	11,360	△0.1	147.09	△0.0	0.0	—	97.2
	(期 末)							
	2016年1月25日	11,038	△2.9	143.56	△2.4	0.0	—	97.0
第79期	(期 首)							
	2016年1月25日	11,018	—	143.56	—	0.0	—	97.0
	1月末	11,114	0.9	144.75	0.8	0.0	—	97.1
	(期 末)							
	2016年2月25日	10,494	△4.8	137.87	△4.0	0.1	—	96.7
第80期	(期 首)							
	2016年2月25日	10,474	—	137.87	—	0.1	—	96.7
	2月末	10,708	2.2	140.82	2.1	0.0	—	96.9
	(期 末)							
	2016年3月25日	10,892	4.0	142.71	3.5	0.0	—	96.7
第81期	(期 首)							
	2016年3月25日	10,872	—	142.71	—	0.0	—	96.7
	3月末	11,008	1.3	144.33	1.1	0.0	—	96.9
	(期 末)							
	2016年4月25日	10,941	0.6	143.50	0.6	0.0	—	97.0
第82期	(期 首)							
	2016年4月25日	10,921	—	143.50	—	0.0	—	97.0
	4月末	10,915	△0.1	143.34	△0.1	0.0	—	97.0
	(期 末)							
	2016年5月25日	10,645	△2.5	139.96	△2.5	0.0	—	96.8
第83期	(期 首)							
	2016年5月25日	10,625	—	139.96	—	0.0	—	96.8
	5月末	10,660	0.3	141.52	1.1	0.1	—	96.9
	(期 末)							
	2016年6月27日	10,044	△5.5	132.20	△5.5	0.1	—	96.5

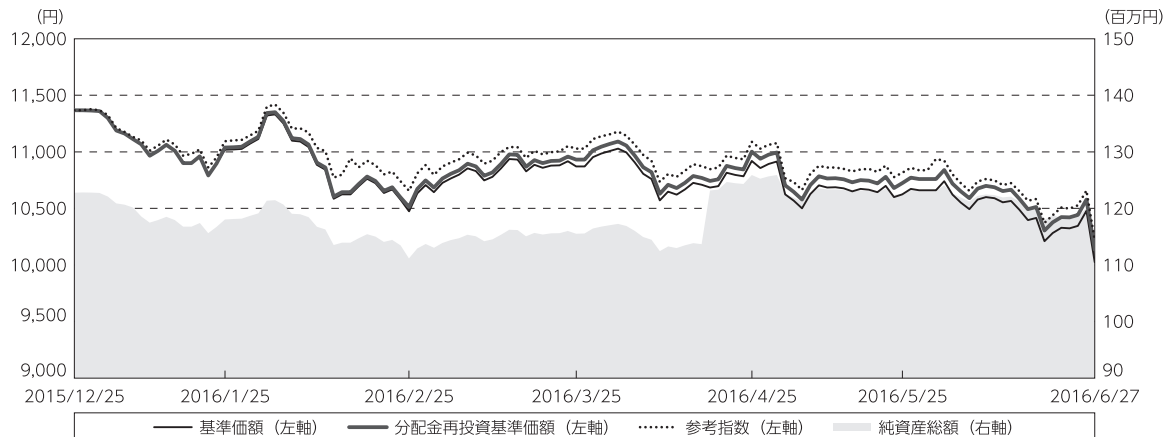
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○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（2015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（ヘッジなし・円ベース）です。作成期首（2015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
- ・ 投資している債券の価格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、利回りは下落（価格は上昇）傾向で推移しました。米国の主要経済指標やFOMC（米連邦公開市場委員会）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、利回りは下落傾向で推移しました。ユーロ圏の主要経済指標やECB（欧州中央銀行）の動向などに左右されました。

・新興国国債

当作成期首から1月中旬にかけては、資源価格の低迷などで、概ね下落基調で推移しました。その後、原油を始めとする資源価格が持ち直したことや、米国の利上げが先送りされたことなどにより、上昇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（米連邦準備制度理事会）の動向などに左右され、上昇基調で推移しました。

・モーゲージ債

モーゲージ債は、米国債に対して割高な水準との見方から嫌気され、下落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日銀による金融政策の動向などに左右され、ドルに対して円高が進行しました。

ユーロ・円相場は、ECBや日銀による金融政策の動向などに左右され、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 Bコース〕

〔野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 B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・ファンドーJ（JPY）〕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・ファンドーJ（JPY）〕

<国・地域別比率（純資産比）>

国・地域別配分については、'16年5月末で米国29.0%、ユーロ圏27.8%、英国17.9%、メキシコ7.9%、カナダ5.4%、インドネシア4.8%、スロベニア4.1%、その他の国・地域26.8%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、'16年5月末で先進国国債等46.1%、新興国国債等19.1%、社債24.0%、モーゲージ債20.9%、新興国通貨13.7%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、'16年5月末でAAA格38.3%、AA格8.1%、A格24.6%、BBB格20.2%、BB格9.1%、B格以下9.8%、新興国通貨13.7%としました。

〔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。

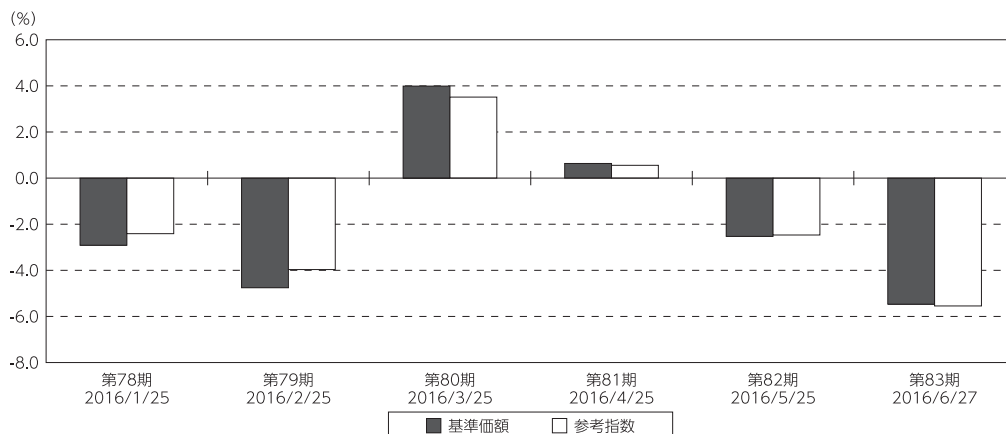
○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

当作成期の間に、基準価額の騰落率が－10.8%※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（ヘッジなし・円ベース）は－10.1%となりました。投資している債券の価格が下落したことがマイナスに影響しました。

※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（ヘッジなし・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、1万口当たり・税込み)

項 目	第78期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期
	2015年12月26日～ 2016年1月25日	2016年1月26日～ 2016年2月25日	2016年2月26日～ 2016年3月25日	2016年3月26日～ 2016年4月25日	2016年4月26日～ 2016年5月25日	2016年5月26日～ 2016年6月27日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.181%	20 0.191%	20 0.184%	20 0.183%	20 0.188%	20 0.199%
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,250	3,259	3,279	3,295	3,304	3,312

(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四捨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 B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)] 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)】

世界経済は、低水準で推移する原油価格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を背景に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。欧州においては、ECBによる緩和的な金融政策が欧州経済を下支えすると考えられ、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。新興国では、特に中国においてこれまでの過剰投資と過剰信用に依存した経済成長を持続させるのが困難になるなか、かつてのような高成長を見込むことは難しく、中国における抑制された成長が、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。

ポートフォリオの金利戦略に関しては、金融政策の正常化が予想される米国の金利リスクを消極姿勢とする一方、緩和的な金融政策が継続する見込みの欧州の金利リスクを積極姿勢とするなど、国別選択を強化します。また、欧州における金融緩和の恩恵を受けやすい欧州周縁国の債券の組み入れを継続します。クレジット戦略では、リスク調整後のバリュエーションに魅力のある銘柄を中心に保有を継続いたします。具体的には、米国における住宅市場の回復の恩恵を受ける非政府系モーゲージ債券や、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の組み入れを継続します。また、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。新興国市場については、国ごとの景気に温度差が広がる中、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の分析に主軸を置きつつ、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く、構造改革による成長が期待できるメキシコ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・ルピーのオーバーウエイトを継続します。

【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・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図る運用を行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年12月26日～2016年 6 月27日)

項 目	第78期～第83期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 75	% 0.682	(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)	(49)	(0.448)	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)	(24)	(0.218)	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	75	0.683	
作成期間の平均基準価額は、10,960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

(2015年12月26日～2016年 6 月27日)

投資信託証券

銘 柄		第78期～第83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)	口 1,062	千円 10,735	口 346	千円 3,471

*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

(2015年12月26日～2016年 6月27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 Bコース>

区 分	第78期～第83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	$\frac{D}{C}$
預金	百万円 93	百万円 93	% 100.0	百万円 93	百万円 93	% 100.0

<野村マネー マザーファンド>

区 分	第78期～第83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 15,979	百万円 1,970	% 12.3	百万円 —	百万円 —	% —
預金	231,734	231,734	100.0	231,734	231,734	100.0

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年 6月27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77期末	第83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)	口 11,077	口 11,793	千円 110,865	% 96.5
合 計	11,077	11,793	110,865	96.5

*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77期末	第83期末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 98	千口 98	千円 100

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年6月27日現在)

項 目	第83期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 110,865	% 96.2
野村マネー マザーファンド	100	0.1
コール・ローン等、その他	4,247	3.7
投資信託財産総額	115,212	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78期末	第79期末	第80期末	第81期末	第82期末	第83期末
	2016年1月25日現在	2016年2月25日現在	2016年3月25日現在	2016年4月25日現在	2016年5月25日現在	2016年6月27日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	118,394,604	112,695,079	115,860,028	126,274,178	123,006,092	115,212,251
コール・ローン等	3,835,158	3,912,675	3,992,391	4,103,575	4,188,919	4,245,925
投資信託受益証券(評価額)	114,459,116	107,487,351	111,767,304	122,070,270	118,716,840	110,865,993
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,323	100,333	100,333	100,333	100,333	100,333
未収入金	—	1,194,720	—	—	—	—
未収利息	7	—	—	—	—	—
(B) 負債	351,329	1,535,713	335,381	364,565	367,697	376,899
未払収益分配金	214,270	212,261	212,518	230,576	230,855	229,132
未払解約金	—	1,189,611	—	—	—	—
未払信託報酬	136,851	133,639	122,681	133,780	136,625	147,534
未払利息	—	—	—	8	6	6
その他未払費用	208	202	182	201	211	227
(C) 純資産総額(A－B)	118,043,275	111,159,366	115,524,647	125,909,613	122,638,395	114,835,352
元本	107,135,348	106,130,910	106,259,370	115,288,472	115,427,516	114,566,104
次期繰越損益金	10,907,927	5,028,456	9,265,277	10,621,141	7,210,879	269,248
(D) 受益権総口数	107,135,348口	106,130,910口	106,259,370口	115,288,472口	115,427,516口	114,566,104口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,018円	10,474円	10,872円	10,921円	10,625円	10,024円

(注) 第78期首元本額は107,995,996円、第78～83期中追加設定元本額は9,887,117円、第78～83期中一部解約元本額は3,317,009円、1口当たり純資産額は、第78期1.1018円、第79期1.0474円、第80期1.0872円、第81期1.0921円、第82期1.0625円、第83期1.0024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3,224,774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78期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期
	2015年12月26日～ 2016年1月25日	2016年1月26日～ 2016年2月25日	2016年2月26日～ 2016年3月25日	2016年3月26日～ 2016年4月25日	2016年4月26日～ 2016年5月25日	2016年5月26日～ 2016年6月27日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	439,899	437,133	436,080	474,384	475,020	471,544
受取配当金	439,720	437,023	436,080	474,520	475,200	471,720
受取利息	179	110	—	—	—	—
支払利息	—	—	—	△ 136	△ 180	△ 176
(B) 有価証券売買損益	△ 3,846,123	△ 5,870,271	4,128,408	605,931	△ 3,527,918	△ 6,982,455
売買益	24,208	52,059	4,128,408	610,362	—	32,294
売買損	△ 3,870,331	△ 5,922,330	—	△ 4,431	△ 3,527,918	△ 7,014,749
(C) 信託報酬等	△ 137,059	△ 133,841	△ 122,863	△ 133,981	△ 136,836	△ 147,761
(D) 当期損益金 (A+B+C)	△ 3,543,283	△ 5,566,979	4,441,625	946,334	△ 3,189,734	△ 6,658,672
(E) 前期繰越損益金	15,135,605	11,258,765	5,479,525	9,687,311	10,403,069	6,923,293
(F) 追加信託差損益金	△ 470,125	△ 451,069	△ 443,355	218,072	228,399	233,759
(配当等相当額)	(6,017,673)	(5,993,201)	(6,035,069)	(9,059,162)	(9,104,978)	(9,066,468)
(売買損益相当額)	(△ 6,487,798)	(△ 6,444,270)	(△ 6,478,424)	(△ 8,841,090)	(△ 8,876,579)	(△ 8,832,709)
(G) 計 (D+E+F)	11,122,197	5,240,717	9,477,795	10,851,717	7,441,734	498,380
(H) 収益分配金	△ 214,270	△ 212,261	△ 212,518	△ 230,576	△ 230,855	△ 229,132
次期繰越損益金 (G+H)	10,907,927	5,028,456	9,265,277	10,621,141	7,210,879	269,248
追加信託差損益金	△ 470,125	△ 451,069	△ 443,355	218,072	228,399	233,759
(配当等相当額)	(6,017,673)	(5,993,201)	(6,035,069)	(9,059,162)	(9,104,979)	(9,066,468)
(売買損益相当額)	(△ 6,487,798)	(△ 6,444,270)	(△ 6,478,424)	(△ 8,841,090)	(△ 8,876,580)	(△ 8,832,709)
分配準備積立金	28,807,238	28,596,293	28,808,161	28,929,902	29,037,253	28,885,794
繰越損益金	△17,429,186	△23,116,768	△19,099,529	△18,526,833	△22,054,773	△28,850,305

* 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 (2015年12月26日～2016年6月27日) は以下の通りです。

項 目	第78期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期
	2015年12月26日～ 2016年1月25日	2016年1月26日～ 2016年2月25日	2016年2月26日～ 2016年3月25日	2016年3月26日～ 2016年4月25日	2016年4月26日～ 2016年5月25日	2016年5月26日～ 2016年6月27日
a. 配当等収益(経費控除後)	302,878円	303,331円	424,386円	415,584円	338,206円	323,811円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金繰戻後)	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	6,017,673円	5,993,201円	6,035,069円	9,059,162円	9,104,979円	9,066,468円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	28,718,630円	28,505,223円	28,596,293円	28,744,894円	28,929,902円	28,791,115円
e. 分配対象収益 (a+b+c+d)	35,039,181円	34,801,755円	35,055,748円	38,219,640円	38,373,087円	38,181,394円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	3,270円	3,279円	3,299円	3,315円	3,324円	3,332円
g. 分配金	214,270円	212,261円	212,518円	230,576円	230,855円	229,132円
h. 分配金(1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第78期	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期
1 万口当たり分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20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 (2016年 6 月27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(19,518,529千口)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83期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B 格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5 年以上	2 年以上	2 年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	2,382,510	2,391,775	12.0	—	—	—	12.0
	(2,382,510)	(2,391,775)	(12.0)	(—)	(—)	(—)	(12.0)
特殊債券 (除く金融債)	2,255,000	2,260,413	11.3	—	—	—	11.3
	(2,255,000)	(2,260,413)	(11.3)	(—)	(—)	(—)	(11.3)
金融債券	3,800,000	3,805,514	19.1	—	—	—	19.1
	(3,800,000)	(3,805,514)	(19.1)	(—)	(—)	(—)	(19.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,000,000	3,003,422	15.1	—	—	—	15.1
	(3,000,000)	(3,003,422)	(15.1)	(—)	(—)	(—)	(15.1)
合 計	11,437,510	11,461,126	57.5	—	—	—	57.5
	(11,437,510)	(11,461,126)	(57.5)	(—)	(—)	(—)	(57.5)

* () 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		第83期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
北海道	公募平成18年度第 7 回	2.0	1,500	1,509	2016/10/31
北海道	公募平成18年度第10回	1.9	200,000	201,925	2016/12/28
北海道	公募（5 年）平成23年度第12回	0.38	5,000	5,010	2017/ 1 /31
北海道	公募（5 年）平成23年度第14回	0.35	200,000	200,593	2017/ 3 /23
神奈川県	公募第143回	1.77	100,000	100,850	2016/12/20
神奈川県	公募（5 年）第49回	0.37	101,700	101,774	2016/ 9 /20
大阪府	公募第292回	2.1	100,000	100,175	2016/ 7 /28
大阪府	公募第294回	2.0	12,000	12,057	2016/ 9 /28
大阪府	公募第295回	1.9	1,000	1,006	2016/10/28
大阪府	公募（5 年）第77回	0.42	100,000	100,120	2016/10/28
兵庫県	公募平成18年度第 7 回	2.1	80,000	80,135	2016/ 7 /27
兵庫県	公募平成18年度第 8 回	2.1	200,000	200,635	2016/ 8 /24
福岡県	公募平成18年度第 3 回	1.9	1,000	1,006	2016/10/31
千葉県	公募平成18年度第 4 回	1.8	8,600	8,648	2016/10/25
新潟県	公募平成18年度第 1 回	2.1	6,500	6,510	2016/ 7 /27
群馬県	公募第 3 回	1.9	9,000	9,065	2016/11/25
大分県	公募平成18年度第 1 回	1.8	198,000	199,212	2016/10/31
共同発行市場地方債	公募第40回	2.1	8,000	8,012	2016/ 7 /25
共同発行市場地方債	公募第41回	2.0	6,000	6,018	2016/ 8 /25
共同発行市場地方債	公募第43回	1.8	4,000	4,022	2016/10/25
共同発行市場地方債	公募第44回	1.8	100,000	100,730	2016/11/25
島根県	公募平成23年度第 1 回	0.38	2,500	2,503	2016/11/25
熊本県	公募平成18年度第 2 回	1.8	7,500	7,542	2016/10/27
名古屋市	公募第456回	1.82	16,000	16,063	2016/ 9 /20
京都市	公募平成23年度第 1 回	0.493	90,000	90,035	2016/ 7 /29
京都市	公募平成23年度第 3 回	0.364	4,000	4,002	2016/ 9 /29
神戸市	公募平成23年度第 3 回	0.375	200,000	200,111	2016/ 8 /16
横浜市	公募平成18年度第 3 回	1.87	200,000	201,796	2016/12/20
札幌市	公募（5 年）平成23年度第 5 回	0.4	12,900	12,909	2016/ 9 /20
川崎市	公募（5 年）第29回	0.36	12,200	12,207	2016/ 9 /20
川崎市	公募（5 年）第31回	0.27	2,000	2,003	2017/ 3 /17
北九州市	公募（5 年）平成23年度第 1 回	0.36	7,000	7,005	2016/ 9 /28
福岡市	公募平成23年度第 3 回	0.39	300,000	300,215	2016/ 8 /26
広島市	公募平成18年度第 1 回	1.82	6,000	6,052	2016/12/26
仙台市	公募平成23年度第 1 回	0.36	59,410	59,507	2017/ 1 /27
さいたま市	公募第 4 回	1.8	5,000	5,043	2016/12/26
鹿児島県	公募平成18年度第 1 回	1.9	7,200	7,244	2016/10/31
鹿児島県	公募（5 年）平成23年度第 1 回	0.37	8,500	8,508	2016/10/31
小計			2,382,510	2,391,775	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第16回	2.0	220,000	220,360	2016/ 7 /28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第17回	2.0	100,000	100,342	2016/ 8 /31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第21回	1.8	125,000	125,971	2016/11/30
日本政策投資銀行債券	財投機関債第27回	1.98	100,000	100,447	2016/ 9 /20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第15回	2.05	100,000	100,458	2016/ 9 /20
地方公共団体金融機構債券	F30回	0.504	300,000	300,120	2016/ 7 /28
地方公共団体金融機構債券	(5 年) 第 9 回	0.34	100,000	100,304	2017/ 4 /28

銘		柄	第83期末													
			利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
特殊債券(除く金融債)				%		千円		千円								
地方公共団体金融機構債券（2年）第2回				0.1		200,000		200,221							2017/3/28	
公営企業債券 第24回財投機関債				1.94		100,000		100,926							2016/12/20	
首都高速道路 第8回				0.439		140,000		140,117							2016/9/20	
日本政策金融公庫社債 第20回財投機関債				0.471		300,000		300,349							2016/9/20	
関西国際空港社債 財投機関債第31回				0.504		70,000		70,070							2016/9/20	
日本学生支援債券 財投機関債第38回				0.1		300,000		300,259							2017/2/20	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第10回				1.99		100,000		100,461							2016/9/20	
小計						2,255,000		2,260,413								
金融債券																
商工債券 利付第734回い号				0.55		170,000		170,071							2016/7/27	
商工債券 利付第736回い号				0.45		300,000		300,290							2016/9/27	
商工債券 利付第737回い号				0.45		200,000		200,272							2016/10/27	
商工債券 利付第738回い号				0.45		200,000		200,365							2016/11/25	
農林債券 利付第734回い号				0.6		50,000		50,022							2016/7/27	
農林債券 利付第735回い号				0.45		150,000		150,093							2016/8/26	
農林債券 利付第736回い号				0.5		650,000		650,770							2016/9/27	
農林債券 利付第737回い号				0.5		80,000		80,111							2016/10/27	
農林債券 利付第739回い号				0.5		500,000		501,238							2016/12/27	
農林債券 利付第742回い号				0.45		200,000		200,667							2017/3/27	
しんきん中金債券 利付第261回				0.45		500,000		500,378							2016/8/26	
しんきん中金債券 利付第262回				0.45		100,000		100,107							2016/9/27	
しんきん中金債券 利付第263回				0.5		100,000		100,161							2016/10/27	
しんきん中金債券 利付第266回				0.45		300,000		300,814							2017/1/27	
商工債券 利付（3年）第164回				0.2		200,000		200,067							2016/9/27	
商工債券 利付（3年）第166回				0.2		100,000		100,081							2016/11/25	
小計						3,800,000		3,805,514								
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26回特定社債間限定同順位特約付				0.54		700,000		700,239							2016/7/20	
みずほコーポレート銀行 第27回特定社債間限定同順位特約付				0.515		500,000		500,782							2016/10/20	
三菱東京UFJ銀行 第126回特定社債間限定同順位特約付				0.545		100,000		100,027							2016/7/14	
三菱東京UFJ銀行 第129回特定社債間限定同順位特約付				0.465		100,000		100,139							2016/10/20	
三菱東京UFJ銀行 第145回特定社債間限定同順位特約付				0.22		100,000		100,014							2016/7/22	
三菱東京UFJ銀行 第148回特定社債間限定同順位特約付				0.195		100,000		100,071							2016/10/31	
三井住友銀行 第54回社債間限定同順位特約付				0.49		200,000		200,066							2016/7/20	
三井住友銀行 第55回社債間限定同順位特約付				0.47		100,000		100,150							2016/10/20	
トヨタファイナンス 第23回社債間限定同等特約付				1.97		100,000		100,441							2016/9/20	
三菱UFJリース 第14回社債間限定同順位特約付				0.567		400,000		400,188							2016/7/29	
三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付				0.66		400,000		401,042							2016/12/14	
東京急行電鉄 第67回社債間限定同順位特約付				1.55		200,000		200,259							2016/7/29	
小計						3,000,000		3,003,422								
合計						11,437,510		11,461,126								

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区 分	第83期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,399,961	% 7.0

*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)

2016年2月29日決算
(計算期間:2015年3月1日～2016年2月29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
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

2016年2月29日に終了した期間

(単位:千)

収益:

受取利息(外国税額控除後)	\$	815
雑収入		3
収益合計		818

費用:

管理費用-Institutional FC(JPY,Hedged)		1
管理費用-Institutional FD(JPY)		127
支払利息		22
雑費用		1
費用合計		151

純投資損益

667

当期実現損益:

投資有価証券(外国税額控除後)		(1,746)
上場金融デリバティブ商品		78
店頭金融デリバティブ商品		(374)
外貨通貨		(37)
当期実現損益		(2,079)

当期末実現評価損益:

投資有価証券(外国税額控除後)		133
上場金融デリバティブ商品		(478)
店頭金融デリバティブ商品		396
外貨建資産および負債		5
当期末実現評価損益		56
当期実現および未実現評価損益		(2,023)

運用の結果による純資産の増減額

\$ (1,356)

外国源泉徴収課税額

\$ 15

期末純資産総額

(単位:千)

Institutional FC (JPY, Hedged)	\$	127
Institutional FD (JPY)		22,277
J (JPY)		970
J (JPY, Hedged)		9,188

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)		11
J (JPY, Hedged)		115

期末1口当たり純資産価格

Institutional FC (JPY, Hedged)		74.30
Institutional FD (JPY)		87.20
J (JPY)		88.96
J (JPY, Hedged)		79.89

※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32,562千米ドル。

組入資産の明細

		2016年2月29日現在	
	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 103.4%			
ブラジル 0.2%			
社債・約束手形 0.2%			
Petrobras Global Finance BV			
6.250% due 03/17/2024	\$ 100	\$ 73	
ブラジル合計		73	
(取得原価 \$103)			
カナダ 5.5%			
モーゲージ担保証券 0.2%			
Canadian Mortgage Pools			
1.138% due 07/01/2020	CAD 95	70	
ソブリン債 5.3%			
Canada Housing Trust No. 1			
2.400% due 12/15/2022	1,000	784	
Province of Alberta			
1.250% due 06/01/2020	100	73	
2.350% due 06/01/2025	100	74	
Province of Ontario			
2.500% due 09/10/2021	\$ 700	719	
2.600% due 06/02/2025	CAD 100	76	
		1,726	
カナダ合計		1,796	
(取得原価 \$1,923)			
デンマーク 3.4%			
社債・約束手形 3.2%			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
2.500% due 10/01/2047	DKK 500	71	
3.000% due 10/01/2047	694	101	
Nykredit Realkredit A/S			
1.000% due 10/01/2016	3,200	469	
2.500% due 10/01/2037	496	74	
2.750% due 11/17/2027	EUR 100	105	
3.000% due 10/01/2047	DKK 595	87	
Realkredit Danmark A/S			
2.500% due 10/01/2037	198	29	
2.500% due 10/01/2047	300	43	
3.000% due 10/01/2047	498	73	
		1,052	
ソブリン債 0.2%			
Denmark Government Bond			
0.100% due 11/15/2023 (a)	312	47	
デンマーク合計			
(取得原価 \$1,114)		1,099	
フランス 3.7%			
社債・約束手形 2.2%			
BNP Paribas Cardif S.A.			
4.032% due 11/25/2025 (b)	EUR 100	100	
BPCE S.A.			
4.625% due 07/11/2024	\$ 200	189	
CNP Assurances			
4.500% due 06/10/2047	EUR 100	99	
Credit Agricole Assurances S.A.			
4.250% due 01/13/2025 (b)	100	98	
Dexia Credit Local S.A.			
0.750% due 01/25/2023	200	222	
		708	
ソブリン債 1.5%			
France Government Bond			
0.250% due 07/25/2024 (a)	203	234	
2.500% due 05/25/2030	200	264	
		498	
フランス合計		1,206	
(取得原価 \$1,250)			
ドイツ 2.2%			
社債・約束手形 0.4%			
Symrise AG			
4.125% due 10/25/2017	100	115	
ソブリン債 1.8%			
FMS Wertmanagement			
1.875% due 05/09/2019	100	116	
Republic of Germany Inflation-Linked Bond			
0.750% due 04/15/2018 (a)	425	472	
		588	
ドイツ合計		703	
(取得原価 \$843)			
ギリシャ 0.4%			
社債・約束手形 0.1%			
Hellenic Railways Organization S.A.			
4.500% due 12/06/2016	¥ 4,000	32	

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ソブリン債 0.3%		
Greece Government International Bond		
5.000% due 08/22/2016	10,700	84
ギリシャ合計		116
(取得原価 \$114)		
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	109
6.625% due 05/15/2033	IDR 204,000	12
8.250% due 06/15/2032	2,740,000	196
8.375% due 03/15/2034	2,611,000	189
インドネシア合計		506
(取得原価 \$655)		
アイルランド 1.5%		
社債・約束手形 1.2%		
Bank of Ireland		
10.000% due 07/30/2016	EUR 200	222
Depfa ACS Bank		
3.875% due 11/14/2016	150	168
		390
モーゲージ担保証券 0.3%		
Bluestep Mortgage Securities No. 3 Ltd.		
1.145% due 05/10/2063	SEK 776	89
アイルランド合計		479
(取得原価 \$530)		
イタリア 1.5%		
ソブリン債 1.5%		
Italy Buoni Poliennali del Tesoro		
1.650% due 04/23/2020 (a)	EUR 299	342
2.700% due 03/01/2047	100	113
5.000% due 09/01/2040	25	40
イタリア合計		495
(取得原価 \$536)		
日本 0.6%		
社債・約束手形 0.6%		
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.		
3.200% due 02/26/2023	\$ 200	202
日本合計		202
(取得原価 \$203)		
チャネル諸島ジャージー島 0.6%		
社債・約束手形 0.6%		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
UBS Group Funding Jersey Ltd.		
4.125% due 09/24/2025	200	199
チャネル諸島ジャージー島合計		199
(取得原価 \$201)		
ルクセンブルグ 0.9%		
社債・約束手形 0.9%		
Commerzbank Finance & Covered Bond S.A.		
4.250% due 06/04/2018	EUR 150	177
Wind Acquisition Finance S.A.		
7.000% due 04/23/2021	100	104
ルクセンブルグ合計		281
(取得原価 \$277)		
メキシコ 0.3%		
ソブリン債 0.3%		
Mexico Government International Bond		
4.000% due 03/15/2115	100	88
メキシコ合計		88
(取得原価 \$103)		
オランダ 4.9%		
社債・約束手形 4.9%		
Cooperatieve Rabobank UA		
6.875% due 03/19/2020	100	126
8.375% due 07/26/2016 (b)	\$ 100	101
ING Bank NV		
2.000% due 11/26/2018	200	200
2.625% due 12/05/2022	1,150	1,179
オランダ合計		1,606
(取得原価 \$1,574)		
ノルウェー 0.5%		
社債・約束手形 0.3%		
Eksportfinans ASA		
5.500% due 05/25/2016	100	101
ソブリン債 0.2%		
Norway Government Bond		
3.750% due 05/25/2021	NOK 500	66
ノルウェー合計		167
(取得原価 \$176)		
ポーランド 0.4%		
ソブリン債 0.4%		
Poland Government International Bond		
3.250% due 07/25/2025	PLN 200	52

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
5.750% due 09/23/2022	300	90
ポーランド合計		142
(取得原価 \$159)		

ポルトガル 0.1%		
社債・約束手形 0.1%		
Banco Espirito Santo S.A.		
4.750% due 01/15/2018 (c) EUR	100	34
ポルトガル合計		34
(取得原価 \$113)		

スロベニア 4.2%		
社債・約束手形 0.4%		
Nova Ljubljanska Banka d.d.		
2.875% due 07/03/2017	100	111

ソブリン債 3.8%		
Slovenia Government International Bond		
4.700% due 11/01/2016	500	560
5.850% due 05/10/2023	\$ 600	687
		1,247
スロベニア合計		1,358
(取得原価 \$1,342)		

南アフリカ 1.0%		
ソブリン債 1.0%		
South Africa Government International Bond		
5.375% due 07/24/2044	200	186
6.750% due 03/31/2021 ZAR	2,613	150
南アフリカ合計		336
(取得原価 \$507)		

スペイン 2.5%		
社債・約束手形 0.5%		
Banco Popular Espanol S.A.		
8.250% due 04/10/2020 (b) EUR	200	165

ソブリン債 2.0%		
Autonomous Community of Catalonia		
4.300% due 11/15/2016	100	110
4.950% due 02/11/2020	50	58
Autonomous Community of Madrid		
1.826% due 04/30/2025	100	109
Autonomous Community of Valencia		
2.289% due 09/03/2017	100	110
4.000% due 11/02/2016	100	111

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Spain Government Bond		
5.150% due 10/31/2044	100	163
		661
スペイン合計		826
(取得原価 \$913)		

国際機関 0.3%		
ソブリン債 0.3%		
Inter-American Development Bank		
1.875% due 03/15/2021	\$ 100	102
国際機関合計		102
(取得原価 \$100)		

イギリス 11.4%		
社債・約束手形 5.0%		
Barclays Bank PLC		
7.625% due 11/21/2022	200	203
7.750% due 04/10/2023	200	203
HSBC Holdings PLC		
6.000% due 09/29/2023 (b) EUR	200	202
Lloyds Bank PLC		
4.875% due 03/30/2027	GBP 100	170
12.000% due 12/16/2024 (b)	\$ 200	269
Pizzaexpress Financing 2 PLC		
6.625% due 08/01/2021	GBP 100	141
Royal Bank of Scotland PLC		
9.500% due 03/16/2022	\$ 300	316
Virgin Media Secured Finance PLC		
4.875% due 01/15/2027	GBP 100	125
		1,629

モーゲージ担保証券 4.9%		
Auburn Securities 9 PLC		
1.591% due 08/18/2047	94	130
Eurosail-UK PLC		
1.535% due 06/13/2045	100	131
Gemgarto		
3.543% due 05/14/2045	32	45
Hercules Eclipse PLC		
0.829% due 10/25/2018	69	95
Leek Finance Number Eighteen PLC		
0.830% due 09/21/2038	\$ 256	270
Leek Finance Number Seventeen PLC		
0.850% due 12/21/2037	704	755
Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities PLC		
0.095% due 09/12/2037	EUR 75	75
0.755% due 06/12/2044	GBP 77	96
		1,597

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ソブリン債 1.5%		
United Kingdom Gilt Inflation-Linked		
0.125% due 03/22/2024 (a)	323	492
イギリス合計		3,718
(取得原価 \$3,899)		

アメリカ 36.3%		
資産担保証券 0.5%		
Massachusetts Educational Financing Authority		
1.569% due 04/25/2038	\$ 27	27
SLM Private Credit Student Loan Trust		
0.692% due 03/15/2024	43	42
0.752% due 12/16/2041	100	84
		153

社債・約束手形 8.4%		
Ally Financial, Inc.		
3.600% due 05/21/2018	100	100
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.		
3.300% due 02/01/2023	200	206
AT&T, Inc.		
3.000% due 06/30/2022	200	198
Bank of America Corp.		
3.875% due 08/01/2025	100	103
CCO Safari II LLC		
4.464% due 07/23/2022	100	102
6.384% due 10/23/2035	100	105
Citigroup, Inc.		
1.311% due 04/27/2018	100	99
Goldman Sachs Group, Inc.		
1.779% due 04/23/2020	100	99
3.750% due 05/22/2025	100	101
International Lease Finance Corp.		
6.750% due 09/01/2016	400	407
JPMorgan Chase & Co.		
2.550% due 10/29/2020	200	201
3.900% due 07/15/2025	100	105
Navient Corp.		
5.500% due 01/15/2019	200	198
QUALCOMM, Inc.		
3.450% due 05/20/2025	100	101
UIL Holdings Corp.		
4.625% due 10/01/2020	100	107
UnitedHealth Group, Inc.		
3.750% due 07/15/2025	100	107
Verizon Communications, Inc.		
5.150% due 09/15/2023	100	113
Wells Fargo & Co.		
2.550% due 12/07/2020	100	101

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
3.000% due 02/19/2025	100	100
Zimmer Biomet Holdings, Inc.		
2.700% due 04/01/2020	100	100
		2,753

モーゲージ担保証券 7.1%		
Alternative Loan Trust		
0.886% due 09/25/2035 (c)	101	76
American Home Mortgage Investment Trust		
2.314% due 10/25/2034	31	31
Banc of America Re-REMIC Trust		
5.652% due 02/17/2051	86	87
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
2.924% due 03/25/2035	19	19
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
0.636% due 12/25/2036	143	129
Citigroup Mortgage Loan Trust		
0.596% due 12/25/2036	121	78
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
2.628% due 05/25/2035	52	48
Countrywide Asset-Backed Certificates		
0.566% due 12/25/2036 (c)	94	84
0.576% due 06/25/2047 (c)	110	88
0.726% due 07/25/2036	100	89
1.086% due 01/25/2036	100	68
1.686% due 07/25/2035	100	73
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
2.640% due 04/20/2036	73	66
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust		
0.586% due 02/25/2047	107	75
0.616% due 06/25/2037 (c)	38	32
HarborView Mortgage Loan Trust		
0.772% due 06/20/2035	92	86
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust		
0.676% due 04/25/2037	96	56
Impac CMB Trust		
1.436% due 07/25/2033	12	12
JPMorgan Alternative Loan Trust		
2.714% due 12/25/2035 (c)	99	83
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		
0.706% due 08/25/2036	100	65
MASTR Asset Securitization Trust		
5.500% due 11/25/2017	2	2
Merrill Lynch Mortgage Trust		
5.690% due 02/12/2051	71	74
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
0.536% due 04/25/2037	133	72
Morgan Stanley Re-REMIC Trust		
5.794% due 08/15/2045	83	85

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Residential Asset Mortgage Products Trust		
0.647% due 12/25/2035	100	74
Saxon Asset Securities Trust		
2.236% due 05/25/2031	97	83
SG Mortgage Securities Trust		
0.586% due 10/25/2036	200	115
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
0.756% due 10/25/2035	119	97
Structured Asset Investment Loan Trust		
0.566% due 07/25/2036	119	80
2.161% due 10/25/2034	87	72
Thornburg Mortgage Securities Trust		
2.181% due 10/25/2043	201	196
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
0.716% due 11/25/2045	42	36
		2,331

地方債・約束手形 1.2%		
New York, New York, Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds, Series 2010		
5.440% due 06/15/2043	200	251
Ohio, American Municipal Power Revenue Bonds, Series 2010		
7.334% due 02/15/2028	100	132
		383

米国政府機関債 8.2%		
Fannie Mae		
2.500% due 08/01/2028	80	82
4.500% due 06/01/2038	21	23
4.500% due 05/01/2041	393	428
4.500% due 07/01/2041	46	50
Fannie Mae, TBA (e)		
3.000% due 03/01/2046	1,000	1,026
3.500% due 04/01/2046	500	523
Freddie Mac, TBA		
3.500% due 04/01/2046 (e)	200	209
Ginnie Mae, TBA (e)		
3.500% due 04/01/2046	100	105
4.000% due 04/01/2046	200	213
		2,659

国庫債券 10.9%		
Treasury Inflation Protected Securities (a)		
0.250% due 01/15/2025	799	794
0.375% due 07/15/2025	199	201
2.375% due 01/15/2025	2,158	2,543
		3,538
アメリカ合計		11,817
(取得原価 \$11,645)		

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
短期金融商品 19.4%		
コマーシャル・ペーパー 17.2%		
Fannie Mae		
0.290% due 03/14/2016	100	100
Federal Home Loan Bank		
0.280% due 03/03/2016	100	100
0.282% due 03/04/2016 (d)	1,700	1,700
0.284% due 03/09/2016 (d)	600	600
0.290% due 03/21/2016	100	100
0.295% due 03/11/2016	200	200
0.296% due 03/02/2016 (d)	1,500	1,500
0.300% due 03/28/2016	900	900
0.305% due 03/16/2016	400	400
		5,600

定期預金 1.3%			
ANZ National Bank			
0.080% due 03/01/2016	GBP	15	20
0.150% due 03/01/2016	\$	52	52
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.			
(0.130%) due 03/01/2016	¥	2,913	26
0.150% due 03/01/2016	\$	26	26
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.756%) due 03/01/2016	SEK	1	0
(0.250%) due 03/01/2016	DKK	293	43
(0.130%) due 03/01/2016	¥	70	1
0.080% due 03/01/2016	GBP	6	9
0.133% due 03/01/2016	NOK	1	0
6.400% due 03/01/2016	ZAR	1	0
Citibank N.A.			
0.150% due 03/01/2016	\$	52	52
Credit Suisse AG			
(1.000%) due 03/01/2016	CHF	1	1
Deutsche Bank AG			
(0.310%) due 03/01/2016	EUR	7	7
0.005% due 03/01/2016	HKD	1	0
0.050% due 03/01/2016	CAD	2	2
DnB NORBank ASA			
(0.756%) due 03/01/2016	SEK	57	7
0.080% due 03/01/2016	GBP	9	13
0.150% due 03/01/2016	\$	41	41
HSBC Bank			
6.400% due 03/01/2016	ZAR	20	1
JPMorgan Chase & Co.			
0.150% due 03/01/2016	\$	60	60
National Australia Bank Ltd.			
1.229% due 03/01/2016	AUD	1	1
Nordea Bank AB			
0.133% due 03/01/2016	NOK	4	0

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.310%) due 03/01/2016 EUR	9	10
(0.130%) due 03/01/2016 ¥	3,537	31
Wells Fargo Bank		
0.050% due 03/01/2016 CAD	6	5
		408
チェコ共和国短期国債 0.9%		
(0.119)% due 09/02/2016 (d) CZK	8,000	321
短期金融商品合計		6,329

額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
(取得原価 \$6,336)	
投資有価証券合計103.4%	\$ 33,678
(取得原価 \$34,616)	
金融デリバティブ商品0.7%	216
(取得原価またはプレミアム \$(186))	
その他の資産および負債(4.1%)	(1,332)
純資産100.0%	\$ 32,562

- (a) 証券の元本金額はインフレにより調整される。
 (b) 永久債:記載の日付(該当する場合)は次の償還日である。
 (c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
 (d) クーポンは加重平均金利である。
 (e) 発行日取引による有価証券。

◎借入およびその他の金融取引

2016年2月29日現在

●セール・バイバック取引

取引相手	借入金利	借入日	満期日	借入額	単位:千 セール・バイバック取引に 係る未払金
BPS	(0.876%)	02/09/2016	05/04/2016	EUR (100)	\$ (109)
BPS	(0.671%)	02/04/2016	05/04/2016	(316)	(344)
BPS	(0.243%)	02/04/2016	05/04/2016	(36)	(39)
セール・バイバック取引合計					\$ (492)

●担保付借入として会計処理される取引

単位:千

	残存期間				
	翌日物 および継続	30日以下	31日-90日	90日超	合計
セール・バイバック取引 Non-U.S. Government Debt	\$ 0	\$ 0	\$ (492)	\$ 0	\$ (492)
セール・バイバック取引合計	\$ 0	\$ 0	\$ (492)	\$ 0	\$ (492)

●空売り

単位:千

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	元本金額	受取額	空売りに係る未払金
GSC	Fannie Mae	4.000%	04/01/2046	\$ 300	\$ (320)	\$ (320)
GSC	Fannie Mae	4.500%	03/01/2046	300	(325)	(326)
MSC	Fannie Mae	4.000%	03/01/2046	1,000	(1,067)	(1,067)
空売り合計					\$ (1,712)	\$ (1,713)

◎上場金融デリバティブ商品

2016年2月29日現在

●先物契約

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現 評価損益	単位:千(契約数を除く) 変動証拠金	
					資産	負債
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06/2016	2	\$ (2)	\$ 0	\$ 0
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03/2017	6	(12)	0	0
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2016	3	(4)	0	0
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09/2017	4	(1)	0	0
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12/2016	7	(12)	0	0
90-Day Sterling September Futures	Short	09/2016	6	0	0	0
90-Day Sterling September Futures	Long	09/2017	6	2	0	0
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03/2016	2	8	0	0
Canada Government 10-Year Bond June Futures	Short	06/2016	2	1	2	0
Euro-Bobl 5-Year Note June Futures	Long	06/2016	37	9	9	0
Euro-BTP 10-Year Bond June Futures	Long	06/2016	4	2	2	0
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	06/2016	22	(1)	0	(2)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03/2016	1	(17)	0	0
Euro-Schatz 2-Year Note June Futures	Short	06/2016	17	0	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2016	7	1	1	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2016	52	4	7	0
Call Option Strike @ EUR 163.000 on Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	05/2016	2	(4)	0	(1)
先物契約合計				\$ (26)	\$ 21	\$ (3)

●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

インデックス/トランシェ	受取 固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	単位:千 変動証拠金	
						資産	負債
CDX.HY-25 Index	5.000%	12/20/2020	\$ 150	\$ 1	\$ (5)	\$ 2	\$ 0
CDX.IG-25 Index	1.000%	12/20/2020	6,350	(10)	(34)	8	0
				\$ (9)	\$ (39)	\$ 10	\$ 0

金利スワップ

単位: 千

変動金利 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 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	3-Month Canadian Bank Bill	2.200%	06/16/2026	CAD 200	\$ (11)	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.013%	01/23/2025	SEK 500	0	0	0	0
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	1,300	1	3	0	0
Pay	3-Month SEK-STIBOR	1.036%	01/23/2025	500	0	0	0	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.300%	05/06/2017	\$ 2,300	(11)	(2)	0	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	12/16/2017	4,600	(65)	(15)	0	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.250%	12/16/2022	5,600	(362)	(363)	0	(5)
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.300%	01/13/2023	500	(33)	(31)	0	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.500%	12/16/2025	2,500	(229)	(260)	0	(4)
Receive	3-Month USD-LIBOR	2.250%	06/15/2026	700	(40)	(38)	0	(1)
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.500%	06/15/2036	100	8	4	0	0
Pay	3-Month USD-LIBOR	2.500%	06/15/2046	700	61	89	2	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.000%	03/16/2018	ZAR 4,500	0	0	0	(1)
Receive	6-Month EURIBOR	0.150%	03/16/2018	EUR 500	(4)	(3)	0	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.500%	03/16/2021	450	13	3	1	0
Pay	6-Month EURIBOR	1.000%	03/16/2026	3,500	191	161	14	0
Receive	6-Month EURIBOR	1.500%	03/16/2046	400	(61)	(67)	0	(1)
Receive	6-Month GBP-LIBOR	1.500%	09/16/2017	GBP 1,100	(13)	(13)	0	0
Receive	6-Month GBP-LIBOR	1.500%	03/16/2018	700	(15)	(10)	0	0
Receive	6-Month GBP-LIBOR	1.750%	09/16/2018	1,300	(37)	(38)	0	(1)
Pay	6-Month GBP-LIBOR	1.750%	03/16/2021	1,500	92	27	4	0
Pay	6-Month GBP-LIBOR	1.250%	09/21/2021	200	4	5	1	0
Pay	6-Month GBP-LIBOR	2.000%	03/16/2026	550	54	24	3	0
Pay	6-Month GBP-LIBOR	2.250%	03/16/2046	100	26	17	2	0
Pay	6-Month JPY-LIBOR	0.150%	03/22/2018	¥ 430,000	26	24	3	0
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.500%	09/17/2021	20,000	(6)	(5)	0	0
Receive	6-Month JPY-LIBOR	0.300%	03/18/2026	10,000	(1)	(1)	0	0
Pay	6-Month JPY-LIBOR	1.500%	12/20/2045	40,000	69	54	0	(2)
Pay	IBMEXID	4.725%	10/31/2017	MXN 24,900	0	1	0	(1)
Pay	IBMEXID	5.085%	02/02/2021	1,600	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	5.610%	07/07/2021	27,200	10	0	0	(1)
Pay	IBMEXID	5.630%	10/11/2021	400	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	5.715%	10/15/2021	3,400	2	(4)	0	0
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	5.795%	12/10/2021	4,800	4	(3)	0	0
Pay	IBMEXID	6.000%	07/18/2022	800	1	1	0	0
スワップ契約合計						\$ (327)	\$ (441)	\$ 30
						\$ (336)	\$ (480)	\$ 40
							\$ (17)	\$ (17)

◎店頭金融デリバティブ商品

2016年2月29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
AZD	05/2016	TWD	802	\$	24	\$	0
AZD	05/2016	\$	70	IDR	961,531		0
BOA	03/2016	BRL	444	\$	112		0
BOA	03/2016	\$	112	BRL	444		0
BOA	03/2016		21	KRW	25,743		0
BOA	03/2016		146	MXN	2,704		0
BOA	03/2016		41	RUB	3,357		0
BOA	04/2016		110	BRL	444		0
BOA	05/2016	NZD	211	\$	140		0
BOA	05/2016	TWD	5,575		167		0
BOA	05/2016	\$	193	CNY	1,297		0
BOA	05/2016		161	ZAR	2,419		(10)
BOA	01/2017	CNY	575	\$	83		(2)
BPS	04/2016	KRW	48,320		40		0
BPS	04/2016	TWD	1,339		40		0
BPS	04/2016	\$	235	CLP	167,018		0
BPS	04/2016		118	CNH	790		0
BPS	05/2016		121	MYR	528		0
BRC	03/2016		179	MXN	3,290		0
BRC	03/2016		160	PEN	538		(8)
BRC	03/2016		88	ZAR	1,424		0
BRC	05/2016		121	KRW	143,264		(6)
BRC	05/2016		39	MYR	160		(1)
BRC	05/2016		32	TWD	1,059		0
BRC	09/2016	CNH	166	\$	25		0
CBK	03/2016	CAD	43		32		0
CBK	03/2016	JPY	1,376		12		0
CBK	03/2016	\$	94	MXN	1,638		(4)
CBK	04/2016		208	CZK	5,058		(5)
CBK	05/2016	EUR	27	\$	30		0
CBK	05/2016	GBP	455		654	20	0
CBK	05/2016	\$	604	AUD	860	9	0
CBK	05/2016		134	CAD	185	3	0
CBK	05/2016		226	ILS	879	0	0
CBK	05/2016		756	INR	52,299	0	(1)
CBK	05/2016		23	KRW	28,300	0	(1)
CBK	05/2016		188	SEK	1,585	0	(3)
CBK	09/2016	CNH	86	\$	13	0	0
DUB	03/2016	BRL	444		112	0	0
DUB	03/2016	\$	112	BRL	444	0	0
DUB	03/2016		1	RUB	82	0	0
DUB	05/2016		47	KRW	56,109	0	(2)
DUB	05/2016		12	MYR	50	0	0
DUB	05/2016		337	PLN	1,339	0	(3)

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	
DUB	05/2016		SGD 180	251	0	(1)
DUB	05/2016		THB 285	10,157	0	(1)
FBF	03/2016	BRL	\$ 24	6	0	0
FBF	03/2016	\$	6	BRL 24	0	0
GLM	03/2016	BRL	1,647	\$ 414	0	0
GLM	03/2016	\$	416	BRL 1,647	0	(2)
GLM	03/2016		961	MXN 16,484	0	(51)
GLM	03/2016		31	PLN 125	0	0
GLM	04/2016	BRL	1,647	\$ 412	2	0
GLM	05/2016	DKK	290	43	1	0
GLM	05/2016	JPY	37,600	330	0	(4)
GLM	05/2016	NOK	140	16	0	0
GLM	05/2016	\$	38	EUR 34	0	(1)
GLM	05/2016		257	HKD 2,002	0	0
GLM	05/2016		2,081	JPY 241,735	65	0
GLM	05/2016		19	PHP 907	0	0
GLM	06/2016		339	COP 1,143,162	1	0
HUS	03/2016		67	MXN 1,213	0	0
HUS	03/2016		18	PEN 61	0	(1)
HUS	03/2016		113	RUB 9,063	7	0
HUS	03/2016		24	TRY 71	0	0
HUS	04/2016	SGD	56	\$ 39	0	(1)
HUS	05/2016	CNH	772	117	0	0
HUS	05/2016	IDR	438,720	32	0	0
HUS	05/2016	KRW	164,501	137	4	0
HUS	05/2016	TWD	3,095	93	1	0
HUS	05/2016	\$	1,910	EUR 1,702	0	(56)
HUS	05/2016		11	KRW 13,023	0	(1)
HUS	05/2016		34	MYR 141	0	(1)
HUS	05/2016		24	TWD 795	0	0
HUS	09/2016	CNH	86	\$ 13	0	0
HUS	09/2016	CZK	8,010	337	14	0
HUS	01/2017	\$	198	CNY 1,365	4	0
JPM	03/2016	BRL	1,623	\$ 386	0	(22)
JPM	03/2016	\$	408	BRL 1,623	0	0
JPM	03/2016		100	MXN 1,830	1	0
JPM	03/2016		72	TRY 214	0	0
JPM	05/2016	CNH	396	\$ 60	0	0
JPM	05/2016	KRW	31,538	26	1	0
JPM	05/2016	\$	966	KRW 1,164,957	0	(30)
JPM	05/2016		38	MYR 160	0	0
JPM	05/2016		385	TWD 12,735	0	(4)
JPM	09/2016		52	CNH 339	0	(1)
JPM	10/2016	DKK	3,225	\$ 489	15	0
MSB	03/2016	MXN	678	36	0	(1)
MSB	05/2016	GBP	12	17	1	0
MSB	05/2016	\$	39	ILS 152	0	0
RBC	05/2016	SEK	120	\$ 14	0	0
SCX	03/2016	\$	334	TRY 1,027	12	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
SCX	05/2016	AUD	89	\$	64	0	0
SCX	05/2016	CNH	607		92	0	0
SCX	05/2016		853		129	0	0
SCX	05/2016		496		75	0	0
SCX	05/2016		126		19	0	0
SCX	05/2016	\$	416	CHF	412	0	(1)
SCX	05/2016		92	CNY	607	0	0
SCX	05/2016		19		126	0	0
SCX	05/2016		129		853	0	0
SCX	05/2016		75		496	0	0
SCX	05/2016		199	GBP	137	0	(8)
SCX	05/2016		236	JPY	27,200	5	0
SCX	05/2016		39	MYR	164	0	0
SCX	05/2016		68	NZD	102	0	(1)
SOG	03/2016		174	RON	719	0	0
SOG	01/2017	CNY	790	\$	114	0	(3)
UAG	05/2016	DKK	2,260		340	10	0
UAG	05/2016	EUR	99		110	3	0
UAG	05/2016	KRW	60,791		50	2	0
UAG	05/2016	\$	358	EUR	323	0	(7)
UAG	05/2016		229	PHP	10,984	1	0
UAG	09/2016	CNH	1,363	\$	206	2	0
UAG	09/2016	\$	200	CNH	1,304	0	(4)
						\$ 213	\$ (248)

● Institutional FC(JPY, Hedged)及びJ(JPY, Hedged)の外国為替先渡し契約

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	03/2016	EUR	3	\$	3	\$ 0	\$ 0
BOA	03/2016	GBP	204		292	7	0
BOA	03/2016	JPY	344,624		3,074	21	0
BOA	03/2016	NZD	12		8	0	0
BOA	03/2016	\$	129	AUD	180	0	0
BOA	03/2016		2	CAD	3	0	0
BOA	03/2016		1	GBP	1	0	0
BOA	03/2016		1,290	JPY	153,325	68	0
BOA	03/2016		8	NZD	12	0	0
BOA	04/2016	AUD	180	\$	129	0	0
BOA	04/2016	NZD	12		8	0	0
BOA	04/2016	\$	3,078	JPY	344,624	0	(21)
BPS	03/2016		5	EUR	5	0	0
CBK	03/2016	DKK	378	\$	55	0	0
CBK	03/2016	EUR	75		84	3	0
CBK	03/2016		3		3	0	0
CBK	03/2016	JPY	270,283		2,393	0	(2)
CBK	03/2016	NOK	152		17	0	0
CBK	03/2016	SEK	501		59	0	0
CBK	03/2016	\$	333	CAD	461	7	0

取引相手	決済月			受取通貨	未実現評価損益	
					資産	負債
CBK	03/2016		91	CHF 91	0	0
CBK	03/2016		8	EUR 7	0	0
CBK	03/2016		11	JPY 1,215	0	0
CBK	04/2016	CAD	461	\$ 333	0	(7)
CBK	04/2016	CHF	91	91	0	0
CBK	04/2016	\$	2,381	JPY 268,517	1	0
DUB	03/2016	JPY	2,279	\$ 19	0	(1)
DUB	03/2016	\$	11	JPY 1,334	1	0
IND	03/2016	JPY	344,816	\$ 3,080	25	0
IND	04/2016	\$	3,083	JPY 344,816	0	(25)
JPM	03/2016	CAD	427	\$ 300	0	(16)
JPM	03/2016	JPY	5,299	47	0	0
JPM	03/2016	\$	2,305	JPY 272,353	108	0
MSB	03/2016	CHF	91	\$ 89	0	(1)
MSB	03/2016	\$	1,931	EUR 1,761	0	(17)
MSB	04/2016	EUR	1,761	\$ 1,933	17	0
NAB	03/2016	AUD	180	126	0	(3)
NAB	03/2016	\$	2,305	JPY 271,672	102	0
RBC	03/2016	JPY	5,158	\$ 46	0	0
RBC	03/2016	\$	60	JPY 6,772	0	0
SCX	03/2016	CAD	37	\$ 27	0	0
SCX	03/2016	JPY	1,101	10	0	0
SCX	03/2016	\$	3	EUR 3	0	0
SCX	03/2016		283	GBP 203	0	0
SCX	03/2016		2,302	JPY 272,356	111	0
SCX	04/2016	EUR	3	\$ 3	0	0
SCX	04/2016	GBP	203	283	0	0
SCX	04/2016	\$	10	JPY 1,101	0	0
UAG	03/2016	EUR	1,702	\$ 1,845	0	(4)
UAG	03/2016	JPY	7,165	63	0	(1)
UAG	03/2016	\$	7	EUR 6	0	0
UAG	03/2016		70	JPY 8,471	5	0
外国為替先渡し契約合計					\$ 476	\$ (98)
					\$ 689	\$ (346)

●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 支払/受取	行使レート	満期日	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	\$ 42

外国通貨オプション

単位:千

取引 相手	銘柄	行使価格	満期日	想定元本	費用	市場価格
BOA	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	\$ 1.059	05/06/2016	EUR 503	\$ 3	\$ 5
BOA	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	1.120	05/06/2016	503	11	21
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 117.250	05/06/2016	\$ 469	7	3
CBK	Put - OTC U.S. dollar versus Russian ruble	RUB 76.000	01/24/2017	100	4	6
FBF	Call - OTC U.S. dollar versus Brazilian real	BRL 4.000	05/19/2016	300	18	13
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥ 117.250	05/06/2016	427	7	3
HUS	Put - OTC U.S. dollar versus Russian ruble	RUB 76.840	02/02/2017	50	2	3
JPM	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	\$ 1.039	05/06/2016	EUR 356	1	2
JPM	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	1.099	05/06/2016	356	5	10
SCX	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY 6.520	10/31/2016	\$ 16	4	10
						\$ 62 \$ 76
						\$ 74 \$ 118

買建オプション合計

●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 支払/受取	行使レート	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	市場価格
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.400%	04/29/2016	EUR 500	\$ (2)	\$ 0
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	1.400%	04/29/2016	500	(4)	(1)
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Receive	1.700%	03/10/2016	GBP 300	(2)	(18)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Pay	2.250%	03/10/2016	300	(2)	0
GST	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	1.493%	09/01/2016	EUR 300	(11)	(48)
							\$ (21)	\$ (67)

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	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	市場価格
BOA	Put - CDX.IG-25 Index	Sell	1.600%	04/20/2016	\$ 100	\$ (1)	\$ 0
CBK	Put - CDX.IG-25 Index	Sell	1.600%	04/20/2016	100	0	0
JPM	Put - iTraxx Europe Series 24 Index	Sell	1.000%	04/20/2016	EUR 800	(3)	(4)
						\$ (4)	\$ (4)

外国通貨オプション

単位:千

取引 相手	銘柄	行使価格	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	市場価格
AZD	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY	7.000	11/01/2016	\$ 100	\$ (1) \$ (2)
BOA	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	\$	1.086	05/06/2016	EUR 755	(7) (15)
BOA	Put - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNH	6.600	04/27/2016	\$ 76	(1) (1)
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	122.450	05/06/2016	469	(2) (1)
CBK	Call - OTC U.S. dollar versus Russian ruble	RUB	110.000	01/24/2017	100	(4) (3)
CBK	Put - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNH	6.600	04/27/2016	76	(1) (1)
FBF	Call - OTC U.S. dollar versus Brazilian real	BRL	4.300	05/19/2016	300	(8) (5)
FBF	Call - OTC U.S. dollar versus Brazilian real		6.300	01/11/2018	100	(5) (5)
FBF	Put - OTC U.S. dollar versus Brazilian real		3.850	05/19/2016	300	(3) (4)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Japanese yen	¥	122.450	05/06/2016	427	(2) (1)
HUS	Call - OTC U.S. dollar versus Russian ruble	RUB	110.000	02/02/2017	50	(2) (2)
JPM	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	\$	1.070	05/06/2016	EUR 534	(4) (7)
NGF	Put - OTC U.S. dollar versus South Korean won	KRW	1,145.000	01/24/2017	\$ 100	(3) (1)
SOG	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNY	7.000	11/01/2016	300	(4) (5)
SOG	Put - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi	CNH	6.600	04/27/2016	148	(1) (2)
UAG	Put - OTC U.S. dollar versus South Korean won	KRW	1,145.000	01/17/2017	100	(2) (1)
					\$ (50)	\$ (56)

インフレーションキャップドオプション

単位:千

取引 相手	銘柄	インシャルインデックス	変動金利	満期日	想定元本	プレミアム (受取額)	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
						\$ (5)	\$ 0
売建オプション合計						\$ (80)	\$ (127)

2016年2月29日に終了した期間の売建オプション

	想定元本 \$	想定元本 AUD	想定元本 EUR	想定元本 GBP	想定元本 NZD	プレミアム
Balance at 02/28/2015	\$ 3,190	AUD 0	EUR 16,100	GBP 0	NZD 0	\$ (54)
Sales	11,146	500	12,269	4,000	1,000	(180)
Closing Buys	(3,300)	0	(19,400)	(700)	(1,000)	73
Expirations	(7,590)	(500)	(5,580)	(2,700)	0	81
Exercised	0	0	0	0	0	0
Balance at 02/29/2016	\$ 3,446	AUD 0	EUR 3,389	GBP 600	NZD 0	\$ (80)

●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)－買い

単位:千

取引 相手	参照債務	支払		2016/2/29時点の		プレミアム (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
		固定金利	満期日	信用スプレッド	想定元本			資産	負債
BRC	Navient Corp.	(5.000%)	03/20/2019	5.073%	\$ 200	\$ (15)	\$ 13	\$ 0	\$ (2)
FBF	Altria Group, Inc.	(1.000%)	12/20/2020	0.281%	100	(3)	0	0	(3)
GST	Reynolds American, Inc.	(1.000%)	12/20/2020	0.404%	100	(3)	0	0	(3)
JPM	Pfizer, Inc.	(1.000%)	12/20/2020	0.199%	100	(4)	0	0	(4)
JPM	Wind Acquisition Finance S.A.	(5.000%)	06/20/2021	5.384%	EUR 100	(2)	3	1	0
SOG	United Utilities PLC	(1.000%)	12/20/2020	0.988%	100	0	0	0	0
						\$ (27)	\$ 16	\$ 1	\$ (12)

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	参照債務	受取		2016/2/29時点の		プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	スワップ契約時価	
		固定金利	満期日	信用スプレッド	想定元本			資産	負債
BOA	France Government Bond	0.250%	03/20/2020	0.280%	\$ 200	\$ (1)	\$ 1	\$ 0	\$ 0
BOA	South Africa Government International Bond	1.000%	09/20/2019	3.043%	200	(6)	(8)	0	(14)
BOA	Volkswagen International Finance NV	1.000%	12/20/2016	1.360%	EUR 100	(1)	1	0	0
BPS	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2019	1.900%	\$ 300	(6)	(3)	0	(9)
BPS	Petrobras Global Finance BV	1.000%	09/20/2019	10.333%	200	(10)	(43)	0	(53)
BRC	France Government Bond	0.250%	03/20/2020	0.280%	100	0	0	0	0
BRC	Indonesia Government International Bond	1.000%	09/20/2019	1.819%	100	(1)	(1)	0	(2)
BRC	Indonesia Government International Bond	1.000%	03/20/2024	2.887%	100	(14)	1	0	(13)
BRC	Russia Government International Bond	1.000%	09/20/2016	1.033%	200	(3)	3	0	0
BRC	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2019	3.125%	700	(29)	(22)	0	(51)
BRC	Tesco PLC	1.000%	12/20/2020	3.142%	EUR 100	(9)	(2)	0	(11)
CBK	Freeport-McMoRan, Inc.	1.000%	03/20/2016	2.545%	\$ 100	0	0	0	0
CBK	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2019	2.948%	150	(6)	(3)	0	(9)
DUB	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2019	1.900%	100	(2)	(1)	0	(3)
GST	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2019	3.886%	200	(6)	(14)	0	(20)
GST	France Government Bond	0.250%	03/20/2020	0.280%	300	(3)	3	0	0
GST	Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.	1.000%	09/20/2020	4.050%	200	(29)	5	0	(24)
GST	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2019	1.900%	100	(2)	(1)	0	(3)
HUS	Brazil Government International Bond	1.000%	06/20/2016	0.663%	300	(2)	3	1	0
HUS	Brazil Government International Bond	1.000%	09/20/2019	3.754%	200	(2)	(15)	0	(17)
HUS	Indonesia Government International Bond	1.000%	06/20/2023	2.817%	25	(2)	(1)	0	(3)
HUS	Russia Government International Bond	1.000%	09/20/2016	1.033%	200	(2)	3	1	0
JPM	France Government Bond	0.250%	03/20/2020	0.280%	200	(2)	2	0	0
JPM	France Government Bond	0.250%	06/20/2020	0.299%	100	(1)	0	0	(1)
JPM	Indonesia Government International Bond	1.000%	09/20/2019	1.819%	100	(1)	(1)	0	(2)
JPM	Indonesia Government International Bond	1.000%	12/20/2019	1.900%	200	(4)	(2)	0	(6)
JPM	Kingdom of Saudi Arabia	1.000%	12/20/2020	1.759%	200	(5)	(2)	0	(7)
MYC	Tesco PLC	1.000%	12/20/2020	3.142%	EUR 100	(10)	0	0	(10)
UAG	Export-Import Bank of China	1.000%	06/20/2016	0.550%	\$ 100	(2)	2	0	0
						\$ (161)	\$ (95)	\$ 2	\$ (258)

クロス通貨スワップ

単位:千

取引 相手	受取	支払	満期日	想定元本 通貨受取	想定元本 通貨支払	プレミアム支払額 (受取額)	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	03/16/2021	\$ 1,426	EUR 1,300	\$ (4)	\$ 21	\$ 17	\$ 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	03/16/2026	108	100	1	3	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	06/15/2026	107	100	(1)	6	5	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	12/16/2020	650	600	1	14	15	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	03/16/2021	633	577	(1)	7	6	0
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	03/16/2026	921	850	10	21	31	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	03/16/2021	1,097	1,000	(1)	13	12	0
								\$ 5	\$ 85
								\$ 90	\$ 0

金利スワップ

取引 相手	変動金利 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	プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	単位:千 スワップ契約時価	
								資産	負債
GLM	Pay	UK Retail Price Index	3.188%	01/15/2031	GBP 100	\$ 0	\$ 4	\$ 4	\$ 0
MYC	Pay	UK Retail Price Index	3.213%	01/15/2031	100	2	3	5	0
RYL	Pay	UK Retail Price Index	3.220%	01/15/2031	100	1	3	4	0
						\$ 3	\$ 10	\$ 13	\$ 0

ボラティリティスワップ

取引 相手	ボラティリティ 支払/受取	原資産	ボラティリティ		想定 元本	プレミアム支払額 (受取額)	未実現 評価損益	単位:千 スワップ契約時価	
			行使レート	満期日				資産	負債
DUB	Pay	Euro versus Swiss franc	8.350%	08/16/2016	CHF 1	\$ 0	\$ 1	\$ 1	\$ 0
DUB	Pay	Euro versus Swiss franc	8.700%	08/16/2016	1	0	2	2	0
DUB	Pay	Euro versus Swiss franc	9.000%	08/16/2016	1	0	2	2	0
DUB	Receive	U.S. dollar versus Swiss franc	10.550%	08/16/2016	1	0	0	0	0
DUB	Receive	U.S. dollar versus Swiss franc	10.900%	08/16/2016	1	0	0	0	0
DUB	Receive	U.S. dollar versus Swiss franc	11.200%	08/16/2016	1	0	0	0	0
						\$ 0	\$ 5	\$ 5	\$ 0
スワップ契約合計						\$ (180)	\$ 21	\$ 111	\$ (270)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2015年8月19日）

作成対象期間（2014年8月20日～2015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/>

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		期 騰 落	中 率			
9 期(2011年 8 月19日)	円		%	%	%	百万円
	10, 170		0. 1	91. 3	－	5, 916
10期(2012年 8 月20日)	10, 181		0. 1	100. 7	－	2, 216
11期(2013年 8 月19日)	10, 191		0. 1	80. 9	－	5, 297
12期(2014年 8 月19日)	10, 199		0. 1	59. 7	－	8, 648
13期(2015年 8 月19日)	10, 206		0. 1	44. 7	－	22, 034

* 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。

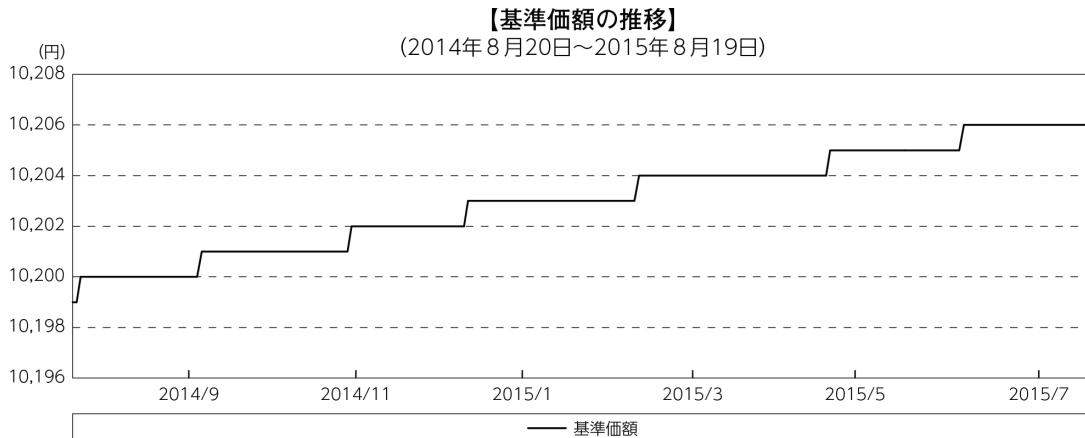
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落	率		
(期 首) 2014年 8 月19日	円		%	%	%
	10, 199		－	59. 7	－
8 月末	10, 200		0. 0	70. 0	－
9 月末	10, 200		0. 0	62. 3	－
10月末	10, 201		0. 0	52. 6	－
11月末	10, 202		0. 0	52. 6	－
12月末	10, 202		0. 0	54. 3	－
2015年 1 月末	10, 203		0. 0	90. 0	－
2 月末	10, 203		0. 0	59. 5	－
3 月末	10, 204		0. 0	52. 3	－
4 月末	10, 204		0. 0	62. 6	－
5 月末	10, 205		0. 1	59. 8	－
6 月末	10, 205		0. 1	41. 2	－
7 月末	10, 206		0. 1	46. 2	－
(期 末) 2015年 8 月19日	10, 206		0. 1	44. 7	－

* 騰落率は期首比です。
* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

* 基準価額は0.07%の上昇

基準価額は、期首10,199円から期末は10,206円となりました。

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

国内経済は、企業収益や雇用・所得環境が改善する中で緩やかな回復を続けてきましたが、4-6月期は個人消費や輸出といった内外需が落ち込み、景気回復が小休止状態にあることを示しました。

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、2014年10月の金融政策決定会合では、資産買入れ額の拡大および長期国債買入れの平均残存年限の長期化を図るなど金融緩和を強化しました。

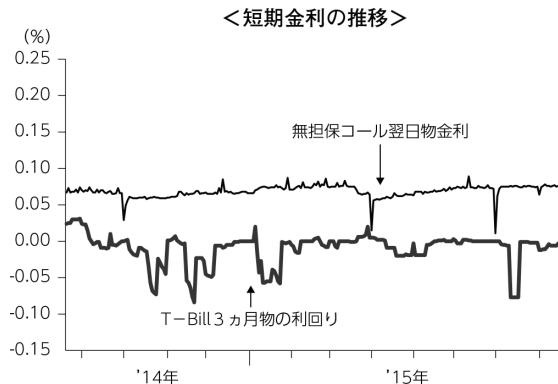
・無担保コール翌日物金利の推移

期を通じて概ね0.06%台から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

2014年9月以降、国内投資家の恒常的な国債需要に加え、日本銀行による買入や海外からの資金流入などによる需給ひっ迫から利回りは低下し、マイナスとなりました。

その後、一時的な需給の緩みにより利回りがプラス圏に戻る局面もありましたが、期末にかけて概ねマイナス圏で推移しました。



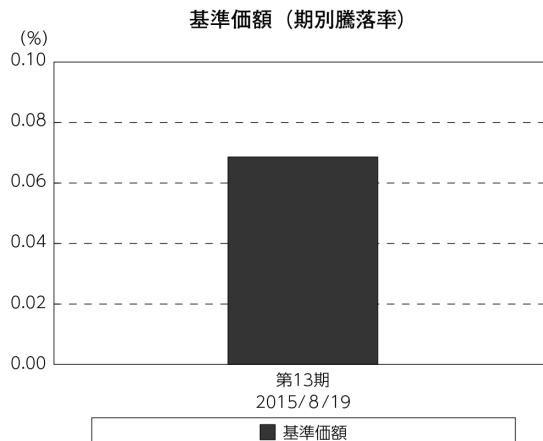
○当ファンドのポートフォリオ

今期の運用につきましては、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

今後も、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 万口当たりの費用明細

(2014年 8 月20日～2015年 8 月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 0	% 0.002	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(そ の 他)	(0)	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、10,202円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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。

○売買及び取引の状況

(2014年 8 月20日～2015年 8 月19日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 57,121,186	千円 33,710,730 (24,409,350)
	地方債証券	3,262,292	— (1,970,000)
	特殊債券	10,876,852	— (7,504,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,312,770	— (2,240,000)

*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。

その他有価証券

		買 付 額	売 付 額
国 内	コマーシャル・ペーパー	千円 7,297,610	千円 — (5,300,000)

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2014年 8 月20日～2015年 8 月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	40,912	5,799	14.2	50	—	—

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 8 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			未			
	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
国債証券	千円	千円	%	%	%	%	%
	1,180,000	1,180,008	5.4	—	—	—	5.4
地方債証券	(1,130,000)	(1,129,999)	(5.1)	(—)	(—)	(—)	(5.1)
	1,281,600	1,287,899	5.8	—	—	—	5.8
特殊債券 (除く金融債)	(1,281,600)	(1,287,899)	(5.8)	(—)	(—)	(—)	(5.8)
	4,686,000	4,703,401	21.3	—	—	—	21.3
金融債券	(4,686,000)	(4,703,401)	(21.3)	(—)	(—)	(—)	(21.3)
	1,470,000	1,473,440	6.7	—	—	—	6.7
普通社債券 (含む投資法人債券)	(1,470,000)	(1,473,440)	(6.7)	(—)	(—)	(—)	(6.7)
	1,200,000	1,207,103	5.5	—	—	—	5.5
合 計	(1,200,000)	(1,207,103)	(5.5)	(—)	(—)	(—)	(5.5)
	9,817,600	9,851,853	44.7	—	—	—	44.7
	(9,767,600)	(9,801,844)	(44.5)	(—)	(—)	(—)	(44.5)

* () 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。

(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	
国庫短期証券 第541回			—	500,000	499,999	2015/9/28
国庫短期証券 第542回			—	200,000	199,999	2015/10/5
国庫短期証券 第546回			—	100,000	99,999	2015/10/19
国庫短期証券 第547回			—	300,000	299,999	2015/10/26
国庫短期証券 第548回			—	30,000	29,999	2015/11/2
国庫債券 利付（2年）第333回			0.1	50,000	50,009	2015/10/15
小 計				1,180,000	1,180,008	
地方債証券						
東京都 公募第625回			1.41	200,000	200,218	2015/9/18
北海道 公募平成17年度第6回			1.4	105,100	105,142	2015/8/31
北海道 公募平成17年度第12回			1.6	50,000	50,365	2016/2/24
神奈川県 公募第136回			1.5	90,000	90,421	2015/12/28
大阪府 公募第284回			1.6	300,000	301,207	2015/11/27
兵庫県 公募平成18年度第7回			2.1	80,000	81,503	2016/7/27
新潟県 公募平成18年度第1回			2.1	6,500	6,617	2016/7/27
共同発行市場地方債 公募第31回			1.5	50,000	50,123	2015/10/23
共同発行市場地方債 公募第32回			1.6	100,000	100,391	2015/11/25
共同発行市場地方債 公募第34回			1.4	200,000	201,130	2016/1/25
共同発行市場地方債 公募第35回			1.6	100,000	100,778	2016/2/25
小 計				1,281,600	1,287,899	
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346回			1.4	300,000	300,095	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	352,411	2015/9/22
首都高速道路債券 政府保証第199回			1.4	50,000	50,018	2015/8/28
阪神高速道路債券 政府保証第148回			1.3	20,000	20,028	2015/9/30
本州四国連絡橋債券 政府保証第27回			1.4	300,000	300,141	2015/8/31
公営企業債券 政府保証第861回			1.6	29,000	29,256	2016/3/17
公営企業債券 政府保証第862回			1.8	117,000	118,337	2016/4/20
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	100,499	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	590,000	593,701	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	562,454	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	171,994	2016/4/26
首都高速道路債券 政府保証第1回			1.6	400,000	403,726	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
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第119回			0.067	200,000	199,993	2015/12/18
地方公共団体金融機構債券 2年第1回			0.135	200,000	200,056	2016/2/26
首都高速道路社債 第6回			0.315	100,000	100,024	2015/9/24
阪神高速道路社債 財投機関債第6回			0.589	100,000	100,166	2015/12/18
中日本高速道路債券 財投機関債第20回			0.417	100,000	100,025	2015/9/18
中日本高速道路社債 財投機関債第37回			0.385	200,000	200,314	2016/2/26
西日本高速道路 第16回			0.246	200,000	200,038	2015/9/18
西日本高速道路 第17回			0.196	300,000	300,113	2015/12/18
小 計				4,686,000	4,703,401	
金融債券						
商工債券 利付第724回い号			0.5	320,000	320,138	2015/9/25
商工債券 利付第733回い号			0.55	300,000	301,185	2016/6/27

銘柄		当 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734回い号	0.55	150,000	150,655	2016/ 7 /27
農林債券	利付第723回い号	0.55	150,000	150,020	2015/ 8 /27
農林債券	利付第724回い号	0.5	50,000	50,021	2015/ 9 /25
農林債券	利付第733回い号	0.55	100,000	100,392	2016/ 6 /27
商工債券	利付（3年）第152回	0.2	100,000	100,013	2015/ 9 /25
商工債券	利付（3年）第153回	0.2	100,000	100,026	2015/10/27
商工債券	利付（3年）第161回	0.25	100,000	100,144	2016/ 6 /27
商工債券	利付（10年）第2回	1.78	100,000	100,841	2016/ 2 /19
小計			1,470,000	1,473,440	
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	200,415	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	100,429	2016/ 4 /20
トヨタファイナンス	第19回社債間限定同等特約付	2.04	200,000	202,217	2016/ 3 /18
三菱ＵＦＪリース	第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	502,336	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	100,066	2016/ 2 /26
東邦瓦斯	第30回社債間限定同順位特約付	2.07	100,000	101,639	2016/ 6 /20
小計			1,200,000	1,207,103	
合計			9,817,600	9,851,853	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,499,141	% 11.3

* 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。

○投資信託財産の構成

(2015年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	9,851,853	44.3
その他有価証券	2,499,141	11.2
コール・ローン等、その他	9,864,830	44.5
投資信託財産総額	22,215,824	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 (2015年8月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,215,824,811
コール・ローン等	847,502,284
公社債(評価額)	9,851,853,649
その他有価証券	2,499,141,851
未収利息	15,014,658
前払費用	12,080,826
差入保証金	8,990,231,543
(B) 負債	181,800,841
未払金	181,483,841
未払解約金	317,000
(C) 純資産総額(A－B)	22,034,023,970
元本	21,588,342,274
次期繰越損益金	445,681,696
(D) 受益権総口数	21,588,342,274口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,206円

(注) 期首元本額8,478百万円、期中追加設定元本額20,130百万円、期中一部解約元本額7,020百万円、計算口数当たり純資産額10,206円。

○損益の状況 (2014年8月20日～2015年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	61,355,124
受取利息	58,968,909
その他収益金	2,386,215
(B) 有価証券売買損益	△ 49,857,397
売買益	19,664
売買損	△ 49,877,061
(C) 保管費用等	△ 261,886
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	11,235,841
(E) 前期繰越損益金	169,135,352
(F) 追加信託差損益金	408,020,917
(G) 解約差損益金	△142,710,414
(H) 計(D＋E＋F＋G)	445,681,696
次期繰越損益金(H)	445,681,696

* 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(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。

○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
バンクローンファンド（為替ヘッジあり）2014-09	98
バンクローンファンド（為替ヘッジあり）2015-06	146
野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド	20
野村米国ハイ・イールド債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型	90
野村新中國株投資 マネーボール・ファンド	78
野村日本ブランド株投資（マネーボールファンド）年2回決算型	745
野村新米国ハイ・イールド債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型	9
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド	9
野村RCM・グリーン・テックノロジー マネーボール・ファンド	1
野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド	5
野村世界業種別投資シリーズ（マネーボール・ファンド）	12
ノムラ・アジア・シリーズ（マネーボール・ファンド）	2,033
野村新エマージング債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型	5
野村グローバル・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	8
野村グローバルCB投信（マネーボールファンド）年2回決算型	6
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（マネーボールファンド）年2回決算型	133
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（マネーボールファンド）年2回決算型	0
野村日本スマートシティ株投資 マネーボールファンド	1
野村世界高金利通貨投信	151
野村新世界高金利通貨投信	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・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジリアルコース）毎月分配型	0
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	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジリアルコース）年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資（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（ブラジリアルコース）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（円コース）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（ブラジリアルコース）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・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	0
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	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジリアルコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジリアルコース）年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投信（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・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	0
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	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信 Bコース	0
野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	0
野村新エマージング債券投信（ブラジリアルコース）毎月分配型	0
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	0
野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型	0
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	0
野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型	0
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	0
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	0
野村新エマージング債券投信（ブラジリアルコース）年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型	0
野村新エマージング債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型	0
野村新エマージング債券投信（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ズ（野村SMA向け）	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（円コース）毎月分配型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）毎月分配型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）毎月分配型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（ブラジリアルコース）毎月分配型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（円コース）年2回決算型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）年2回決算型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）年2回決算型	0
野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信（ブラジリアルコース）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信（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信（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信（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信（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信（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信（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）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
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
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

ファンド名	当期末 元本額 百万円
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・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投信 (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信 (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信 (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・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	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
野村カルニニャック・ファンド Aコース	0
野村カルニニャック・ファンド Bコース	0
野村通貨選択日本株投信 (米ドルコース) 毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信 (ユーロコース) 毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信 (ブラジリアルコース) 毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信 (トルコリラコース) 毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信 (中国元コース) 毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信 (インドルビオコース) 毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信 (米ドルコース) 年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信 (ユーロコース) 年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信 (ブラジリアルコース) 年2回決算型	0
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	0
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	0
野村通貨選択日本株投信 (中国元コース) 年2回決算型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信 (インドルビオコース) 年2回決算型	0
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	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

ファンド名	当期末 元本額 百万円
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
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村新興国高配当株トリプルウィング ブラジルリアル毎月分配型	0
ビムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	0
ビムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	0
ビムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	0
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	0
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)	0
ノムラ THE ASIA Aコース	0
ノムラ THE ASIA Bコース	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
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)	5,276
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)	3,422
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型) Zプライス(適格機関投資家専用)	2,296
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型) Dプライス(適格機関投資家専用)	4,635
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型) 1305(適格機関投資家販売制限付)	1,186
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型) 1308(適格機関投資家販売制限付)	1,019
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	0
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース	0

*単位未満は切り捨て。

○お知らせ

①デリバティブ取引等に係る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：2014年12月4日＞

②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：2015年2月23日＞

＜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お願いいたします。

（2016年6月27日現在）

年 月	日
2016年 6 月	－
7 月	4
8 月	－
9 月	5
10月	－
11月	24
12月	26

※ 2016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、諸事情等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。