

野村グローバルCB投信 (円コース) 年2回決算型

運用報告書(全体版)

第23期(決算日2021年9月21日)

作成対象期間(2021年3月23日~2021年9月21日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2010年7月22日から2025年9月22日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債(以下「グローバルCB」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目的として運用を行います。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。	
主な投資対象	野村グローバルCB投信 (円コース) 年2回決算型	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス	グローバルCBを主要投資対象とします。
	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	野村グローバルCB投信 (円コース) 年2回決算型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建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、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		債組入比率	債券先物比率	投資信託 組入比率	純資産額
		税金 込配分	み騰落 期中率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
19期(2019年9月20日)	14,235	10	0.7	0.3	—	98.7	207
20期(2020年3月23日)	12,693	10	△10.8	0.4	—	98.4	184
21期(2020年9月23日)	14,699	10	15.9	0.3	—	98.3	211
22期(2021年3月22日)	16,342	10	11.2	0.2	—	98.4	256
23期(2021年9月21日)	17,252	10	5.6	0.2	—	98.6	270

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	標準価額		債組入比率	債券先物比率	投資信託 組入比率	債券率
		騰落率	騰落率				
(期首)	円	%	%	%	%	%	%
2021年3月22日	16,342	—	—	0.2	—	98.4	—
3月末	16,141	△1.2	—	0.2	—	98.3	—
4月末	16,845	3.1	—	0.2	—	98.2	—
5月末	16,520	1.1	—	0.2	—	98.6	—
6月末	16,921	3.5	—	0.2	—	98.6	—
7月末	16,877	3.3	—	0.2	—	98.4	—
8月末	17,177	5.1	—	0.2	—	98.2	—
(期末)							
2021年9月21日	17,262	5.6	—	0.2	—	98.6	—

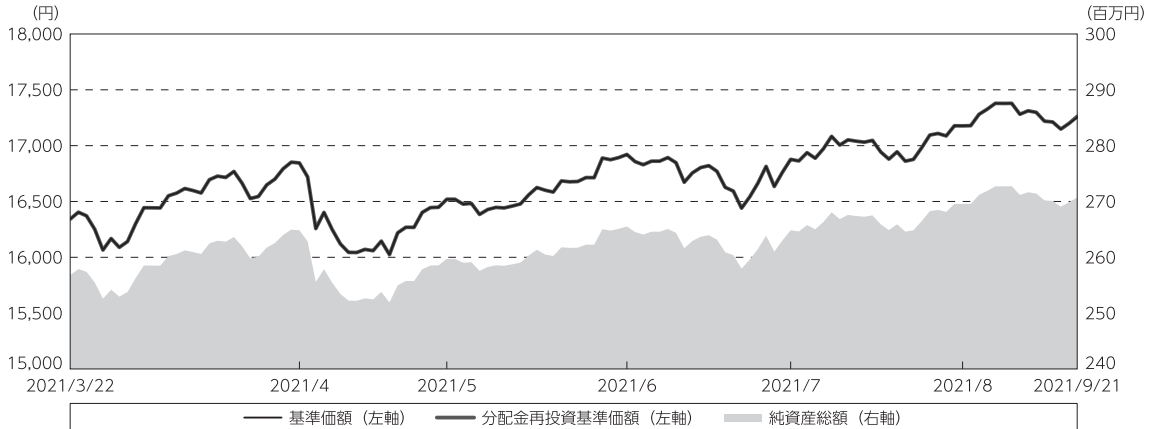
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：16,342円

期 末：17,252円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 5.6%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年3月22日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

基準価額は、期首16,342円から期末には17,252円となりました。

- ・ 実質的に投資している日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債（グローバルCB）からのインカムゲイン（利子収入）
- ・ 実質的に投資している日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債（グローバルCB）からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）

○投資環境

<グローバルCB市場>

グローバルCB市場の騰落は以下のようになりました。



(注) 各市場指数の騰落は、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。また、各市場指数は、米ドル建て指数を用いています。

グローバルCB：米国CBと欧州CBの市場指数を50：50で合成し日やりバランスしたと仮定し算出した指数、米国CB：トムソン・ロイター米国コンバーティブル・ボンド・インデックス、欧州CB：トムソン・ロイター欧州コンバーティブル・ボンド・インデックス（米ドルヘッジベース）

- Thomson Reuters. All rights reserved. トムソン・ロイター・コンバーティブル・インデックス (Thomson Reuters Convertible Index) という名称、および関連するトムソン・ロイターのサブインデックスの名称（以下、総称して「トムソン・ロイター・インデックス」）は、ロイター・リミテッド（以下「トムソン・ロイター」という）の専有財産です。トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスのベンチマークを使用し取得した結果や、特定の日にトムソン・ロイター・インデックスが示す数値や水準のいずれについても、明示または黙示を問わず、いかなる保証や表明も行いません。また、トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスの算出方法の修正・変更につき保証を行わず、トムソン・ロイター・インデックスの算出、出版、配信を継続する義務を負わないものとします。さらに、トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスや当該インデックスの計算・編集（当該インデックスに関連するまたは含まれる情報やデータを含みますが、それらに限りません）の正確性や完全性につき、明示または黙示を問わず、いかなる表明や保証も行いません。トムソン・ロイター・インデックスに係る規則および／またはガイドライン、トムソン・ロイター・インデックスおよび関連計算式の計算・編集のプロセスや基準、ベンチマークの構成やその他の関連要素は、通知を行うことなく、トムソン・ロイターの裁量により、変更または改定される場合があります。

グローバルCB市場は、当作成期初に、ECB（欧州中央銀行）が金融緩和を強化する姿勢を示したことなどを好感して上昇しました。5月以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）の結果を受け米金融政策の正常化が早まるとの見方が強まり、軟調となる場面が見られたものの、パウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げを急がない姿勢を示したことや、バイデン米大統領が超党派の上院議員とインフラ投資法案で合意に達したことなどが好感され底堅く推移しました。当作成期を通じては値上がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村グローバルCB投信（円コース）年2回決算型]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス] 受益証券および [野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス] 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス]

主要投資対象である [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンド] のポートフォリオにおける信用格付け別比率については、当作成期末現在で、AAA格0.8%、AA格8.6%、A格12.6%、BBB格25.4%、BB格34.1%、B格9.1%、CCC格以下および無格付1.1%となりました。

* 格付はS&P社あるいはムーディーズ社のいずれかの格付機関の低い方の格付によります。格付がない場合は副投資顧問会社が同等の信用度を有すると判断した格付によります。

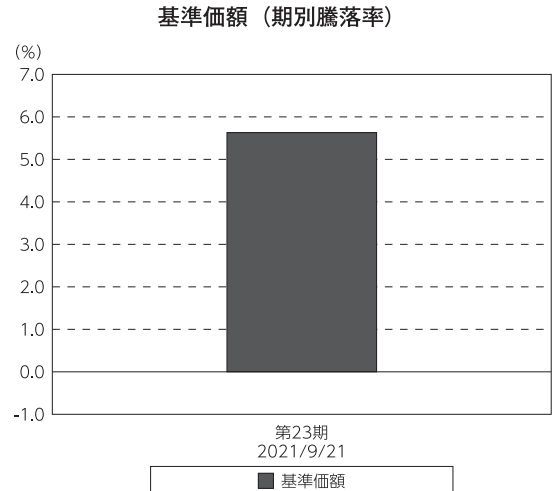
[野村マネー マザーファンド]

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配については、分配原資の範囲内で、基準価額水準等を勘案して決定しました。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23期
	2021年3月23日～ 2021年9月21日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.058%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,655

(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

【野村グローバルCB投信（円コース）年2回決算型】

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス〕 受益証券および〔野村マネー マザーファンド〕 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス〕 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー日本円クラス】

日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債を主要投資対象とします。米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が当該資産について、原則として対米ドルで為替取引を行います。組入資産について、原則として、対円で為替ヘッジを行います。

転換社債への投資にあたっては、引き続き、高水準のインカムゲイン（利子収入）の確保とキャピタルゲイン（値上がり益）の獲得を目指し、ポートフォリオの地域別配分、格付別配分、業種別配分等に考慮したポートフォリオの構築を行っていきます。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行う場合があります。

【野村マネー マザーファンド】

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

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年3月23日～2021年9月21日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 86	% 0.513	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(37)	(0.221)	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 ）	(46)	(0.276)	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 ）	(3)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	86	0.514	
期中の平均基準価額は、16,746円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

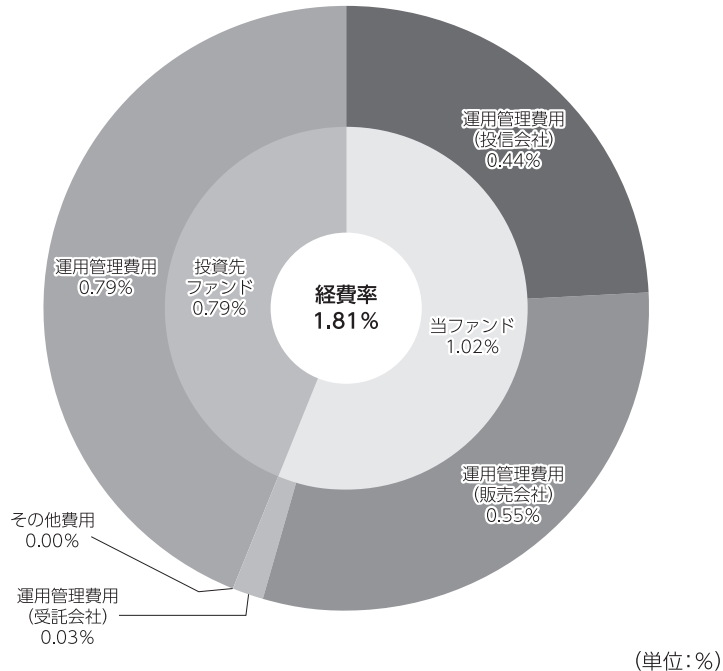
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)**○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）**

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.81%です。



経費率(①+②)	1.81
①当ファンドの費用の比率	1.02
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.79

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年3月23日～2021年9月21日)

投資信託証券

国 内	銘 柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ コンバーティブル・ボンド-日本円クラス	266	2,832 千円	—	— 千円

*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

(2021年3月23日～2021年9月21日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルCB投信（円コース）年2回決算型>
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	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	7,562	30	0.4%	—	—	—

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証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年9月21日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ コンバーティブル・ボンド-日本円クラス	24,125	24,391	24,391	266,861 千円	98.6%
合 計	24,125	24,391	24,391	266,861	98.6%

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 984	千口 984	千円 1,004

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年9月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 266,861	% 97.6
野村マネー マザーファンド	1,004	0.4
コール・ローン等、その他	5,688	2.0
投資信託財産総額	273,553	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（2021年9月21日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	273,553,662
コール・ローン等	5,687,498
投資信託受益証券(評価額)	266,861,931
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,004,233
(B) 負債	2,852,093
未払金	1,336,518
未払収益分配金	156,908
未払解約金	10,348
未払信託報酬	1,345,488
未払利息	4
その他未払費用	2,827
(C) 純資産総額(A-B)	270,701,569
元本	156,908,447
次期繰越損益金	113,793,122
(D) 受益権総口数	156,908,447口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,252円

(注) 期首元本額は157,136,161円、期中追加設定元本額は92,584円、期中一部解約元本額は320,298円、1口当たり純資産額は1.7252円です。

○損益の状況（2021年3月23日～2021年9月21日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,355,920
受取配当金	4,356,391
支払利息	△ 471
(B) 有価証券売買損益	11,434,020
売買益	11,440,765
売買損	△ 6,745
(C) 信託報酬等	△ 1,348,315
(D) 当期損益金(A+B+C)	14,441,625
(E) 前期繰越損益金	55,725,927
(F) 追加信託差損益金	43,782,478
(配当等相当額)	(50,105,108)
(売買損益相当額)	(△ 6,322,630)
(G) 計(D+E+F)	113,950,030
(H) 収益分配金	△ 156,908
次期繰越損益金(G+H)	113,793,122
追加信託差損益金	43,782,478
(配当等相当額)	(50,105,108)
(売買損益相当額)	(△ 6,322,630)
分配準備積立金	70,010,644

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2021年3月23日～2021年9月21日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年3月23日～ 2021年9月21日
a. 配当等収益(経費控除後)	3,985,495円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	10,456,130円
c. 信託約款に定める収益調整金	50,105,108円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	55,725,927円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	120,272,660円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,665円
g. 分配金	156,908円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

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

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。

Nomura Multi Managers Fund—Global Convertible Bond

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド グローバル・コンバーティブル・ボンド

2020年9月20日決算

●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
投 資 目 的	<ul style="list-style-type: none"> ◆日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債(「グローバルCB」といいます)を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目的として運用を行います。 ◆「ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド—グローバル・コンバーティブル・ボンド」には、為替取引手法の異なる3つのクラス(日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)があります。
投 資 態 度	<ul style="list-style-type: none"> ●投資対象資産を、転換先の株式およびREITの主要取引市場や発行通貨等から、各副投資顧問会社の判断により、「米国」、「欧州その他」に分類します。 ●「米国」および「欧州その他」に属する資産への投資比率は、各々50%を中心に40%～60%程度の範囲内とします。 ●銘柄選択にあたっては、最終利回り*が分類先の地域の市場平均を上回る転換社債を中心に選定します。 ※購入時点で、償還期日(売却権利が付与されている場合は権利行使日)まで当該転換社債を保有した場合の最終利回りをいいます。 ●米ドル建て以外の外貨建資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行います。 ファンドには3つのクラス(日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、米ドルを売り、各クラスの通貨(日本円クラス:円、資源国通貨クラス:ブラジルレアル/豪ドル/南アフリカランド、アジア通貨クラス:中国元/インドルピー/インドネシアルピア)を買う為替取引を行うことで、各通貨への投資効果を追求します。 ●運用の効率化を図るために株式先物や債券先物に投資する場合があります。 ●一時的な防衛的措置として、短期金融市場商品に投資する場合があります。 ●転換社債以外の債券および優先証券へ投資を行う場合があります。 ●株式およびREITへの直接投資は行わないことを基本とします。株式およびREITへの投資は優先証券のうち株券または新株引受権証券の性質を有するものまたは転換社債を転換および新株予約権を行使したもののらびに社債権者割当等により取得したものに限りします。 ●通常的环境下では、株式およびREITへの転換は行わないことを基本とします。 ●投資顧問会社が、グローバルCBの運用を行う副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。 ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、グローバルCBの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行います。
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
管 理 事 務 代 行 会 社	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ) エス・イー
保 管 銀 行	

◇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しております。

◇掲載している組入資産の明細および計算書等は、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド—グローバル・コンバーティブル・ボンドの年次報告書から抜粋・邦訳したものです。

純資産計算書
2020年9月20日現在
(金額は米ドル表示)

資産		
投資有価証券時価		84,753,503
(取得原価 : 78,974,787米ドル)		
投資オプション契約時価 (買い)		33,321
(取得原価 : 142,459米ドル)		
現金預金等		12,733,679
外国為替先渡し契約に係る評価損益		3,064,336
デリバティブに係る委託証拠金		355,242
ブローカーからの未収金		1,196,414
未収収益		210,705
		102,347,200
資産合計		
		102,347,200
負債		
投資オプション契約時価 (売り)		212
(取得原価 : 4,693米ドル)		
銀行当座借越		2,620,001
ブローカーへの未払金		1,634,174
未払費用		233,713
未払利息		32
		4,488,132
負債合計		4,488,132
		4,488,132
純資産総額		97,859,068

受益証券一口当たり情報 :

	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス (円)	9,515	117,081	1,114,054,206
アジア通貨クラス (円)	7,136	387,520	2,765,403,691
資源国通貨クラス (円)	4,576	1,388,887	6,355,134,183

運用計算書

2020年9月20日に終了する計測期間

(金額は米ドル表示)

収益	
銀行口座利息	67,429
債券利息 (源泉徴収税控除後)	1,093,801
受取配当金等 (源泉徴収税控除後)	603,170
収益合計	<u>1,764,400</u>
費用	
投資顧問報酬	668,149
事務管理代行報酬	79,599
保管費用	30,150
取引銀行報酬	15,489
銀行手数料	38,640
受託報酬	19,916
法務報酬	879
立替費用	9,947
専門家報酬	40,115
印刷出版手数料	5,465
雑費用	1,198
費用合計	<u>909,547</u>
純投資損益	<u>854,853</u>
投資有価証券売買に係る損益	813,249
先物契約に係る損益	(2,938)
オプション契約に係る損益	(34,349)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	(7,305,860)
当期実現純損益	<u>(6,529,898)</u>
投資有価証券評価損益の増減	4,238,565
オプション契約に係る評価損益の増減	(63,224)
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	2,993,400
当期評価差損益	<u>7,168,741</u>
運用の結果による純資産の増減額	<u><u>1,493,696</u></u>

純資産変動計算書
2020年9月20日に終了する計測期間
(金額は米ドル表示)

期首純資産総額	111,927,752
純投資損益	854,853
当期実現純損益	(6,529,898)
当期評価差損益	7,168,741
運用の結果による純資産の増減額	1,493,696
受益証券の発行手取金	751,924
受益証券の買戻支払金	(8,226,591)
	(7,474,667)
受益者への支払分配金	(8,087,713)
期末純資産総額	97,859,068

発行済受益証券数の変動表
2020年9月20日に終了する計測期間
(未監査)

日本円クラス	
期首受益証券数	127,930
発行受益証券数	375
買戻受益証券数	(11,224)
期末発行済受益証券数	117,081
アジア通貨クラス	
期首受益証券数	399,724
発行受益証券数	4,476
買戻受益証券数	(16,680)
期末発行済受益証券数	387,520
資源国通貨クラス	
期首受益証券数	1,513,544
発行受益証券数	10,309
買戻受益証券数	(134,966)
期末発行済受益証券数	1,388,887

統計情報

2020年9月20日現在
(未監査)

	2020	2019	2018
期末純資産総額 (米ドル)	97,859,068	111,927,752	127,863,874
日本円クラス (円)			
期末純資産総額	1,114,054,206	1,210,275,387	1,391,994,773
期末1口当たり純資産価格	9,515	9,460	9,698
アジア通貨クラス (円)			
期末純資産総額	2,765,403,691	3,012,436,006	3,244,549,863
期末1口当たり純資産価格	7,136	7,536	7,806
資源国通貨クラス (円)			
期末純資産総額	6,355,134,183	7,858,218,726	9,711,717,462
期末1口当たり純資産価格	4,576	5,192	5,700

組入資産明細
2020年9月20日現在
(金額は米ドル表示)

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
オーストラリア					
転換社債					
AUD	400,000	SEVEN GROUP HOL CV 2.2000% 05/03/25	312,200	295,856	0.30
AUD	400,000	DEXUS FINANCE CV 2.3000% 19/06/26	275,800	290,386	0.30
			<u>588,000</u>	<u>586,242</u>	<u>0.60</u>
		合計： オーストラリア	<u>588,000</u>	<u>586,242</u>	<u>0.60</u>
オーストリア					
転換社債					
EUR	400,000	AMS AG CV 0% 05/03/25 AMS	376,588	343,564	0.35
EUR	200,000	CA IMMO ANLAGEN CV 0.7500% 04/04/25	238,158	255,106	0.26
			<u>614,746</u>	<u>598,670</u>	<u>0.61</u>
		合計： オーストリア	<u>614,746</u>	<u>598,670</u>	<u>0.61</u>
ベルギー					
転換社債					
EUR	200,000	FIELDLINK CV 3.75% 22/12/21 GREE	217,987	209,973	0.21
			<u>217,987</u>	<u>209,973</u>	<u>0.21</u>
変動金利債					
EUR	500,000	FORTIS BANK CV FRN 19/12/49 CASH	383,633	438,432	0.45
			<u>383,633</u>	<u>438,432</u>	<u>0.45</u>
		合計： ベルギー	<u>601,620</u>	<u>648,405</u>	<u>0.66</u>
バミューダ諸島					
転換社債					
USD	999,000	GOLAR LNG LTD CV 2.7500% 15/02/22	997,024	916,643	0.94
USD	265,000	SHIP FIN INTL CV 5.75% 15/10/21	264,388	258,958	0.26
USD	200,000	LUYE PHARMA CV 1.5000% 09/07/24	196,000	195,440	0.20
USD	200,000	BW OFFSHORE LTD CV 2.5000% 12/11/24	200,000	157,940	0.16
USD	400,000	BORR DRILLING CV 3.8750% 23/05/23	402,033	81,116	0.08
USD	600,000	AFRICAN MINERALS CV 8.5% 10/02/17	610,068	1,200	0.00
			<u>2,669,513</u>	<u>1,611,297</u>	<u>1.64</u>
その他債券					
HKD	2,000,000	REXLOT HLDG CV 4.5% 17/04/19	81,421	7,489	0.01
			<u>81,421</u>	<u>7,489</u>	<u>0.01</u>
優先証券					
--	8,935	BUNGE LTD CV PFD 4.875% 31/12/49	830,326	877,864	0.90
			<u>830,326</u>	<u>877,864</u>	<u>0.90</u>
		合計： バミューダ諸島	<u>3,581,260</u>	<u>2,496,650</u>	<u>2.55</u>
英領ヴァージン諸島					
転換社債					
EUR	600,000	ANLLIAN CAPITAL CV 0% 05/02/25	643,780	685,171	0.69
USD	400,000	PB ISSUER #5 LT CV 3.0000% 10/12/25	400,000	338,220	0.35

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
HKD	2,000,000	SMART INSIGHT CV 4.5000% 05/12/23	255,416	296,770	0.30
HKD	2,000,000	CHINA CONCH VEN CV 0% 05/09/23	254,298	290,190	0.30
USD	266,000	UNIVERSE TREK CV 2.5000% 08/07/25	266,000	266,335	0.27
EUR	200,000	STRATEGIC ITL GP CV 0% 29/06/25	225,450	233,488	0.24
USD	200,000	CP FOODS CAPITA CV 0.5000% 18/06/25	205,200	202,310	0.21
			<u>2,250,144</u>	<u>2,312,484</u>	<u>2.36</u>
		合計： 英領ヴァージン諸島	<u>2,250,144</u>	<u>2,312,484</u>	<u>2.36</u>
		カナダ			
転換社債					
USD	320,000	SHOPIFY INC CV 0.1250% 01/11/25	336,873	341,891	0.35
			<u>336,873</u>	<u>341,891</u>	<u>0.35</u>
		合計： カナダ	<u>336,873</u>	<u>341,891</u>	<u>0.35</u>
		ケイマン諸島			
転換社債					
USD	326,000	SEA LTD CV 1.0000% 01/12/24 144A	706,771	962,549	0.99
HKD	6,000,000	HARVEST INTL CO CV 0% 21/11/22	776,123	837,046	0.87
HKD	4,000,000	ZHONGSHENG CV 0% 21/05/25	516,094	668,378	0.69
USD	500,000	POSEIDON FIN 1 CV 0% 01/02/25	509,742	480,875	0.49
USD	400,000	CHINA OVRES FIN CV 0% 05/01/23	404,560	453,700	0.46
USD	410,000	WEIBO CORP CV 1.2500% 15/11/22	409,618	387,546	0.40
USD	350,000	YY INC CV 0.7500% 15/06/25	330,519	373,324	0.38
EUR	300,000	SINO BIOPHARMA CV 0% 17/02/25	332,505	354,059	0.36
HKD	2,000,000	KINGSOFT CORP CV 0.6250% 29/04/25	247,304	346,782	0.35
USD	400,000	BOSIDENG INTERN CV 1.0000% 17/12/24	366,208	342,500	0.35
USD	390,000	MOMO INC CV 1.2500% 01/07/25	361,704	308,334	0.32
HKD	2,000,000	CHINA YUHUA CV 0.9000% 27/12/24	257,716	288,048	0.29
HKD	2,000,000	CHINA EVERGRAND CV 4.2500% 14/02/23	234,025	247,093	0.25
USD	250,000	BAOZUN INC CV 1.6250% 01/05/24	239,340	235,119	0.24
USD	200,000	GOLDENSEP INVES CV 1.0000% 28/09/21	200,800	200,000	0.20
EUR	100,000	SIEM INDUS CV 2.2500% 02/06/21 SUBC	130,180	110,473	0.11
USD	33,000	SEA LTD CV 2.3750% 01/12/25 144A	33,000	59,670	0.06
			<u>6,056,209</u>	<u>6,655,496</u>	<u>6.81</u>
その他債券					
USD	121,225	POLARCUS L CV 5.6000% 01/07/22 PLCS	131,731	78,796	0.08
			<u>131,731</u>	<u>78,796</u>	<u>0.08</u>
		合計： ケイマン諸島	<u>6,187,940</u>	<u>6,734,292</u>	<u>6.89</u>
		中国			
転換社債					
USD	500,000	CRRC CORP LTD CV 0% 05/02/21	498,625	494,375	0.51
HKD	2,000,000	ANGANG STEEL CV 0% 25/05/23	256,724	257,080	0.26
			<u>755,349</u>	<u>751,455</u>	<u>0.77</u>
		合計： 中国	<u>755,349</u>	<u>751,455</u>	<u>0.77</u>
		キプロス			
転換社債					
USD	200,000	ABIGROVE CV 0% 16/02/22 SVST	214,948	222,712	0.23
			<u>214,948</u>	<u>222,712</u>	<u>0.23</u>
		合計： キプロス	<u>214,948</u>	<u>222,712</u>	<u>0.23</u>

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
デンマーク					
転換社債					
EUR	100,000	GN STORE NORD CV 0% 21/05/24	108,812	135,353	0.14
			<u>108,812</u>	<u>135,353</u>	<u>0.14</u>
		合計： デンマーク	<u>108,812</u>	<u>135,353</u>	<u>0.14</u>
フランス					
転換社債					
USD	800,000	MICHELIN CV 0% 10/11/23 MLFP	730,503	770,049	0.80
USD	600,000	CARREFOUR SA CV 0% 14/06/23 CAFP	518,475	574,260	0.59
USD	400,000	VALEO SA CV 0% 16/06/21 FRT	367,158	394,976	0.40
--	2,217	ORPEA CV 0.3750% 17/05/27	364,774	366,821	0.37
EUR	200,000	ATOS SE CV 0% 06/11/24	241,909	313,609	0.32
--	4,733	NEXITY CV 0.2500% 02/03/25	350,884	306,088	0.31
--	4,558	KORIAN SA CV 0.8750% 06/03/27	248,651	285,103	0.29
--	6,429	MAISONS DU MOND CV 0.1250% 06/12/23	241,353	278,164	0.28
EUR	200,000	ORPAR CV 0% 20/06/24 RCO	223,860	265,168	0.27
GBP	200,000	ORANGE CV 0.3750% 27/06/21 BT/A	271,088	254,799	0.26
EUR	4,500	NEOEN SAS CV 1.8750% 07/10/24 NEOE	148,433	250,446	0.26
EUR	200,000	KERING CV 0% 30/09/22 PUM	241,862	249,833	0.26
--	5,576	VEOLIA ENVRNMT CV 0% 01/01/25	192,220	201,661	0.21
--	2,284	EDENRED CV 0% 06/09/24 EDEN	171,246	168,096	0.17
--	2,000	NEXITY CV 0.1250% 01/01/23 NEX	123,628	137,897	0.14
--	727	WORLDLINE SA CV 0% 30/07/26	87,903	100,686	0.10
--	352	SOITEC CV 0% 28/06/23	46,409	56,213	0.06
--	211	WORLDLINE SA CV 0% 30/07/25	31,025	31,540	0.03
			<u>4,601,381</u>	<u>5,005,409</u>	<u>5.12</u>
変動金利債					
EUR	8,182	KORIAN SA CV FRN 01/01/69 KORI	389,073	399,825	0.40
EUR	4,436	QUADIEN SAS CV FRN 16/12/68 NEO	256,413	289,115	0.30
			<u>645,486</u>	<u>688,940</u>	<u>0.70</u>
		合計： フランス	<u>5,246,867</u>	<u>5,694,349</u>	<u>5.82</u>
ドイツ					
転換社債					
EUR	700,000	DELIVERY HERO A CV 1.5000% 15/01/28	793,730	815,198	0.83
USD	775,000	DEUTSCHE BK LON CV 1.0000% 01/05/23	700,336	762,405	0.78
EUR	500,000	DEUTSCHE WOHNEN CV 0.6000% 05/01/26	597,579	661,691	0.68
EUR	400,000	TAG IMMO AG CV 0.6250% 27/08/26	478,275	489,264	0.50
EUR	400,000	MTU AERO EN CV 0.0500% 18/03/27 MTX	380,657	437,228	0.45
EUR	300,000	LEG IMMOBILIEN CV 0.4000% 30/06/28	339,510	374,784	0.38
EUR	200,000	DELIVERY HERO A CV 1.0000% 23/01/27	223,020	280,127	0.29
EUR	200,000	ZALANDO SE CV 0.6250% 06/08/27 B	235,400	267,868	0.27
EUR	200,000	ZALANDO SE CV 0.0500% 06/08/25 A	260,854	267,657	0.27
USD	250,000	BASF SE CV 0.9250% 09/03/23 BAS	238,783	248,105	0.25
EUR	200,000	RAG-STIFTUNG CV 0% 16/03/23 EVK	218,993	235,852	0.24
EUR	100,000	HELLOFRESH SE CV 0.7500% 13/05/25	116,591	134,486	0.14
EUR	100,000	CONSUS REAL CV 4.0000% 29/11/22 CC1	113,586	117,014	0.12

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
EUR	100,000	DELIVERY HERO A CV 0.8750% 15/07/25	113,504	116,673	0.12
			4,810,818	5,208,352	5.32
		合計： ドイツ	4,810,818	5,208,352	5.32
香港					
転換社債					
USD	200,000	LENOVO GROUP LT CV 3.3750% 24/01/24	201,750	217,824	0.22
			201,750	217,824	0.22
		合計： 香港	201,750	217,824	0.22
インド					
転換社債					
USD	200,000	BHARTI AIR CV 1.5000% 17/02/25 REGS	203,600	220,124	0.22
			203,600	220,124	0.22
		合計： インド	203,600	220,124	0.22
アイルランド					
転換社債					
EUR	200,000	GLANBIA CO-OP CV 1.375% 09/06/21	225,279	228,745	0.23
			225,279	228,745	0.23
		合計： アイルランド	225,279	228,745	0.23
イタリア					
転換社債					
EUR	400,000	NEXI CV 1.7500% 24/04/27	466,570	570,052	0.58
EUR	200,000	SNAM SPA 0% 20/03/22	230,028	246,896	0.25
EUR	200,000	TELECOM ITALIA CV 1.125% 26/03/22	218,885	235,438	0.24
EUR	200,000	PRYSMIAN SPA CV 0% 17/01/22 PRY1	214,795	234,999	0.24
EUR	200,000	COVIVIO CV 0.8750% 31/01/21 BNS	203,471	232,657	0.24
			1,333,749	1,520,042	1.55
		合計： イタリア	1,333,749	1,520,042	1.55
ジャージー					
転換社債					
GBP	200,000	PHP FIN JERS CV 2.8750% 15/07/25	250,491	292,424	0.31
USD	200,000	SIRIUS MINRLS CV 5.0000% 23/05/27	287,500	285,000	0.29
GBP	200,000	REMGRO JERS GBP CV 2.625% 22/03/21	288,022	255,416	0.26
GBP	500,000	INTU JERSEY LTD CV 2.875% 01/11/22	627,934	149,149	0.15
USD	200,000	TULLOW OIL CV 6.625% 12/07/21 TLW	204,600	137,000	0.14
USD	400,000	NMC HEALTH CV 1.8750% 30/04/25	389,373	32,000	0.03
			2,047,920	1,150,989	1.18
		合計： ジャージー	2,047,920	1,150,989	1.18
ルクセンブルグ					
転換社債					
EUR	300,000	CORESTATE CV 1.3750% 28/11/22 CCAP	353,916	275,194	0.29
EUR	200,000	LAGFIN CV 2.0000% 02/07/25	224,890	258,779	0.26
EUR	300,000	VIC PROPERTIES CV 3.0000% 28/05/25	300,699	238,175	0.24
EUR	200,000	ELIOTT CAPITAL CV 0% 30/12/22	206,540	232,276	0.24
EUR	200,000	KLOECKNER & CO CV 2% 08/09/23 KCO	224,560	228,072	0.23

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
EUR	200,000	EUROPEAN T CV 4.0000% 21/09/21 SMCP	218,395	107,345	0.11
			1,529,000	1,339,841	1.37
変動金利債					
EUR	250,000	AGEASFINLUX SA CV FRN 07/11/49	164,197	183,667	0.19
			164,197	183,667	0.19
		合計： ルクセンブルグ	1,693,197	1,523,508	1.56
マレーシア					
転換社債					
USD	200,000	CERAH CAPITAL CV 0% 08/08/24	192,600	188,500	0.19
			192,600	188,500	0.19
		合計： マレーシア	192,600	188,500	0.19
マルタ					
転換社債					
GBP	200,000	BRAIT SE CV 6.5000% 04/12/24	257,080	209,424	0.21
			257,080	209,424	0.21
		合計： マルタ	257,080	209,424	0.21
オランダ					
転換社債					
USD	250,000	BRENNTAG FINANC CV 1.8750% 02/12/22	248,875	260,449	0.28
EUR	200,000	JUST EAT TAKEA CV 1.2500% 30/04/26	222,555	259,142	0.26
CHF	200,000	DUFREY ONE BV CV 1.0000% 04/05/23	204,750	248,819	0.25
USD	200,000	QIAGEN NV CV 1.0000% 13/11/24	202,350	247,952	0.25
USD	200,000	YANDEX NV CV 0.7500% 03/03/25	200,000	236,860	0.24
EUR	200,000	COSMO PHARMA NV CV 2.5000% 05/12/23	213,889	225,544	0.23
USD	200,000	STMICROELECTRON CV 0% 04/08/25 A	211,600	218,990	0.22
USD	200,000	ELM BV FOR CV 3.2500% 13/06/24 SREN	199,763	212,620	0.22
EUR	200,000	PHARMING NV CV 3.0000% 21/01/25	222,730	211,255	0.22
EUR	200,000	KONINKLIJK CV 3.5000% 13/06/21 BAMN	224,633	197,869	0.20
EUR	100,000	IBERDROLA INTL CV 0% 11/11/22 IBE	127,973	150,528	0.15
			2,279,118	2,470,028	2.52
		合計： オランダ	2,279,118	2,470,028	2.52
ニュージーランド					
転換社債					
USD	200,000	XERO INVMNTS LT CV 2.3750% 04/10/23	200,000	313,500	0.32
			200,000	313,500	0.32
		合計： ニュージーランド	200,000	313,500	0.32
韓国					
転換社債					
KRW	600,000,000	LOTTE SHOPPING CV 0% 04/04/23	528,255	503,863	0.51
USD	200,000	LG CHEM LTD CV 0% 16/04/21 USD	201,500	262,804	0.27
EUR	100,000	LG CHEM LTD CV 0% 16/04/21 EUR	113,978	144,217	0.15
			843,733	910,884	0.93
		合計： 韓国	843,733	910,884	0.93

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
シンガポール					
転換社債					
SGD	750,000	CAPITALAND CV 2.8% 08/06/25 REGS	523,047	562,815	0.57
SGD	750,000	CAPITALAND CV 2.95% 20/06/22	540,577	554,953	0.56
SGD	500,000	SUNTEC REIT CV 1.7500% 30/11/24	374,077	368,568	0.38
SGD	250,000	KEPPEL REIT CV 1.9000% 10/04/24	181,627	183,363	0.19
SGD	250,000	OUE LTD CV 1.5000% 13/04/23	190,411	182,441	0.19
			<u>1,809,739</u>	<u>1,852,140</u>	<u>1.89</u>
		合計： シンガポール	<u>1,809,739</u>	<u>1,852,140</u>	<u>1.89</u>
スペイン					
転換社債					
EUR	400,000	CELLNEX TE CV 0.5000% 05/07/28 CLNX	451,373	646,846	0.66
EUR	400,000	INTL CONSOL CV 0.6250% 17/11/22 IAG	391,256	402,409	0.41
EUR	300,000	CO ECONOMICA CV 1% 01/12/23 EBRO	356,990	342,510	0.35
EUR	300,000	ENCE ENRGA CV 1.2500% 05/03/23 ENC	311,033	314,558	0.32
EUR	200,000	SACYR SA CV 3.7500% 25/04/24	225,230	234,414	0.24
EUR	100,000	AMADEUS IT GROU CV 1.5000% 09/04/25	120,366	153,307	0.16
EUR	100,000	ALMIRALL SA CV 0.2500% 14/12/21	104,755	114,762	0.12
			<u>1,961,003</u>	<u>2,208,806</u>	<u>2.26</u>
		合計： スペイン	<u>1,961,003</u>	<u>2,208,806</u>	<u>2.26</u>
スウェーデン					
転換社債					
SEK	2,000,000	RECIPHARM AB CV 2.75% 06/10/21 RECI	224,458	246,362	0.25
			<u>224,458</u>	<u>246,362</u>	<u>0.25</u>
		合計： スウェーデン	<u>224,458</u>	<u>246,362</u>	<u>0.25</u>
スイス					
転換社債					
CHF	440,000	SIKA AG CV 0.1500% 05/06/25	453,851	619,198	0.64
CHF	235,000	SWISS PRIM CV 0.3250% 16/01/25 SPSN	240,446	258,022	0.26
CHF	235,000	IMPLENIA AG CV 0.5% 30/06/22 IMPN	243,142	247,476	0.25
CHF	200,000	IDORSIA LTD CV 0.7500% 17/07/24	204,010	237,642	0.24
CHF	250,000	SANTHERA PHARMA CV 5% 17/02/22 SANN	242,686	103,866	0.11
			<u>1,384,135</u>	<u>1,466,204</u>	<u>1.50</u>
		合計： スイス	<u>1,384,135</u>	<u>1,466,204</u>	<u>1.50</u>
イギリス					
転換社債					
GBP	300,000	VODAFONE GROUP CV 0% 26/11/20 VOD	429,561	387,731	0.39
GBP	221,000	STOBART FIN CV 2.7500% 08/05/24	288,151	172,322	0.18
GBP	100,000	OCADO GROUP PLC CV 0.7500% 18/01/27	126,840	162,898	0.17
			<u>844,552</u>	<u>722,951</u>	<u>0.74</u>
		合計： イギリス	<u>844,552</u>	<u>722,951</u>	<u>0.74</u>
アメリカ					
転換社債					
USD	1,297,000	ARES CAPITAL CO CV 3.7500% 01/02/22	1,303,503	1,318,596	1.36
USD	833,000	MICROCHIP TECH CV 1.6250% 15/02/27	853,855	1,260,621	1.29
USD	593,000	LIBERTY INTER CV 1.75% 30/09/46 144	665,426	1,083,180	1.11

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
USD	542,000	SQUARE INC CV 0.5000% 15/05/23	587,410	1,063,642	1.09
USD	736,000	ON SEMICON CV 1.6250% 15/10/23 144A	815,887	973,964	1.00
USD	747,000	INSULET CORP CV 0.3750% 01/09/26	795,692	931,270	0.95
USD	806,000	LIVE NATION ENT CV 2.5000% 15/03/23	828,097	927,585	0.95
USD	658,000	ZILLOW GRP CV 1.5000% 01/07/23	670,405	906,987	0.93
USD	852,000	DEXCOM INC CV 0.2500% 15/11/25	899,924	893,186	0.91
USD	703,000	OKTA INC CV 0.1250% 01/09/25	754,107	888,388	0.91
USD	726,000	BURLINGTON STOR CV 2.2500% 15/04/25	840,984	882,308	0.90
USD	526,000	COUPA SOFTWARE CV 0.1250% 15/06/25	650,274	873,649	0.89
USD	584,000	WORKDAY INC CV 0.2500% 01/10/22	643,629	851,046	0.87
USD	675,000	JP MORGAN CHASE CV 0.1250% 01/01/23	823,584	829,089	0.85
USD	754,000	ILLUMINA INC CV 0% 15/08/23	769,882	806,199	0.82
USD	710,000	AKAMAI TECHNOLO CV 0.3750% 01/09/27	724,801	805,367	0.82
USD	351,000	MERCADOLIBRE IN CV 2.0000% 15/08/28	794,344	803,857	0.82
USD	530,000	IAC FINANCECO 3 CV 2.0000% 15/01/30	532,226	785,667	0.80
USD	575,000	SOUTHWEST AIR CV 1.2500% 01/05/25	685,233	783,351	0.80
USD	635,000	PALO ALTO NET CV 0.7500% 01/07/23	645,171	713,492	0.73
USD	558,000	MONGODB INC CV 0.2500% 15/01/26	623,541	685,749	0.70
USD	516,000	SNAP INC CV 0.7500% 01/08/26	518,632	677,539	0.69
USD	471,000	CHEGG INC CV 0.1250% 15/03/25	560,359	656,668	0.67
USD	270,000	ZILLOW GRP CV 1.3750% 01/09/26	278,918	615,743	0.63
USD	595,000	RINGCENTRAL INC CV 0% 01/03/25	633,910	614,879	0.63
USD	456,000	BOOKING HLDS IN CV 0.7500% 01/05/25	585,404	599,790	0.61
USD	440,000	SPLUNK INC CV 0.5000% 15/09/23	440,000	576,858	0.59
USD	228,000	IAC FINANCECO CV 0.8750% 01/10/22	240,094	567,882	0.58
USD	523,000	REALPAGE INC CV 1.5000% 15/05/25	572,557	542,497	0.55
USD	574,000	SUNPOWER CORP CV 0.875% 01/06/21	454,158	541,141	0.55
USD	363,000	SPLUNK INC CV 1.1250% 15/09/25	363,000	499,459	0.51
USD	384,000	CLOUDFLARE CV 0.7500% 15/05/25	400,578	479,228	0.49
USD	418,000	ZSCALER INC CV 0.1250% 01/07/25	468,160	472,340	0.48
USD	175,000	DOCUSIGN INC CV 0.5000% 15/09/23	212,275	470,694	0.48
USD	428,000	BIOMARIN PHARM CV 0.5990% 01/08/24	426,042	458,504	0.47
USD	372,000	DATADOG INC CV 0.1250% 15/06/25	450,995	449,953	0.46
USD	211,000	ATLASSIAN INC CV 0.6250% 01/05/23	447,042	447,343	0.46
USD	464,000	EXACT SCIENCES CV 0.3750% 01/03/28	470,566	430,917	0.44
USD	365,000	INPHI CORP CV 0.7500% 15/04/25	409,723	429,762	0.44
USD	351,000	SLACK TECHNOLOG CV 0.5000% 15/04/25	480,379	398,515	0.41
USD	400,000	JP MORGAN CHASE CV 0% 11/01/21 DUFN	382,500	394,380	0.40
EUR	300,000	JP MORGAN CHASE CV 0% 18/09/22	373,569	393,650	0.40
USD	118,000	TWILIO INC CV 0.2500% 01/06/23	477,164	373,085	0.38
USD	386,000	LIVE NATION ENT CV 2.0000% 15/02/25	326,350	355,123	0.36
USD	400,000	GLENCORE FDG LL CV 0% 27/03/25 GLEN	356,616	353,152	0.36
USD	250,000	IAC FINANCECO 2 CV 0.8750% 15/06/26	268,438	352,075	0.36
USD	304,000	PROSPECT CAPITA CV 6.3750% 01/03/25	299,060	310,968	0.32
USD	85,000	SERVICENOW INC CV 0% 01/06/22	269,100	285,289	0.29
USD	277,000	GOLDMAN SACHS B CV 4.5000% 01/04/22	284,895	280,274	0.29
GBP	200,000	NATIONAL GRID CV 0.9% 02/11/20 NGLN	271,529	258,386	0.26
USD	250,000	HERCULES C CV 4.3750% 01/02/22 144A	253,725	250,725	0.26
USD	78,000	RINGCENTRAL INC CV 0% 15/03/23	101,976	242,242	0.25
USD	168,000	ZYNGA INC CV 0.2500% 01/06/24	229,740	202,712	0.21
USD	200,000	JP MORGAN CHASE CV 0% 11/01/21 DUFN	193,600	197,032	0.20
			28,409,029	33,245,998	33.98

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
優先証券					
--	1,308	BROADCOM IN CV PFD 8.0000% 30/09/22	1,388,289	1,648,080	1.69
--	11,412	SEMPRA ENER CV PFD 6.7500% 15/07/21	1,186,172	1,200,999	1.23
--	758	BK OF AMERICA CV PFD 7.25% 31/12/49	861,404	1,155,571	1.18
--	844	WELLS FARGO CO PFD 7.5% 31/12/49	1,049,701	1,152,997	1.18
--	18,640	BECTON DICK CV PFD 6.0000% 01/06/23	1,029,458	964,247	0.99
--	18,894	NEXTERA ENE CV PFD 6.2190% 01/09/23	891,207	896,709	0.92
--	5,547	COLFAX CORP PFD 5.75% CV 15/01/22	577,486	812,247	0.83
--	511	DANAHER COR CV PFD 4.7500% 15/04/22	637,228	737,981	0.75
--	14,736	INTERNATION CV PFD 6.0000% 15/09/21	753,635	667,393	0.68
--	5,963	DOMINION EN CV PFD 7.2500% 01/06/22	619,814	610,373	0.62
--	5,581	ENERGIZER H CV PFD 7.5000% 15/01/22	572,074	480,022	0.49
			<u>9,566,468</u>	<u>10,326,619</u>	<u>10.56</u>
		合計： アメリカ	<u>37,975,497</u>	<u>43,572,617</u>	<u>44.54</u>
		組入資産合計	<u>78,974,787</u>	<u>84,753,503</u>	<u>86.61</u>

⁽¹⁾ 額面価格は発行通貨建て表示

財務書類に関する注記
2020年9月20日現在

注記1 - 外国為替先渡し契約

2020年9月20日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
BRL	22,200,798	USD	3,974,848	2020年10月2日	260,771
BRL	19,200,151	USD	3,433,000	2020年10月2日	230,135
BRL	19,174,403	USD	3,433,000	2020年10月2日	225,223
BRL	18,967,578	USD	3,402,000	2020年10月2日	216,764
BRL	18,961,115	USD	3,402,000	2020年10月2日	215,530
BRL	11,464,618	USD	2,049,023	2020年10月2日	138,274
ZAR	306,924	USD	18,205	2020年9月30日	732
ZAR	307,421	USD	18,205	2020年10月15日	730
BRL	194,231	USD	36,410	2020年10月2日	646
AUD	25,165	USD	18,205	2020年10月15日	203
AUD	25,166	USD	18,205	2020年9月30日	203
ZAR	71,995	USD	4,288	2020年9月30日	154
ZAR	72,113	USD	4,288	2020年10月15日	154
BRL	45,592	USD	8,576	2020年10月2日	122
ZAR	41,612	USD	2,468	2020年9月30日	99
ZAR	41,679	USD	2,468	2020年10月15日	99
BRL	26,333	USD	4,936	2020年10月2日	88
AUD	3,411	USD	2,468	2020年10月15日	28
AUD	3,411	USD	2,468	2020年9月30日	28
AUD	5,897	USD	4,288	2020年9月30日	26
AUD	5,897	USD	4,288	2020年10月15日	26
USD	3,089	JPY	328,410	2020年10月15日	(52)
USD	3,088	JPY	328,410	2020年9月30日	(52)
USD	12,533	JPY	1,325,000	2020年9月30日	(138)
USD	13,432	JPY	1,427,805	2020年10月15日	(224)
USD	13,429	JPY	1,427,805	2020年9月30日	(225)
USD	18,921	JPY	2,010,000	2020年9月30日	(301)
ZAR	227,344,301	USD	13,452,869	2020年10月15日	550,281
ZAR	104,535,387	USD	6,122,172	2020年9月30日	327,780
AUD	20,577,817	USD	14,785,044	2020年9月30日	267,126
JPY	665,549,727	USD	6,267,587	2020年10月15日	98,599
JPY	425,101,707	USD	4,018,190	2020年9月30日	47,166
AUD	7,144,077	USD	5,207,143	2020年10月15日	18,794
USD	44,238	AUD	59,943	2020年9月30日	391
USD	3,441	AUD	4,735	2020年10月15日	(23)
USD	3,441	AUD	4,735	2020年9月30日	(23)
USD	3,441	ZAR	58,228	2020年10月15日	(145)
USD	3,441	ZAR	58,132	2020年9月30日	(146)
USD	33,846	AUD	46,475	2020年9月30日	(149)

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	6,882	BRL	37,004	2020年10月2日	(177)
USD	61,745	AUD	84,969	2020年10月15日	(410)
USD	61,745	AUD	84,974	2020年9月30日	(411)
USD	67,693	BRL	357,561	2020年10月2日	(524)
USD	33,846	ZAR	565,448	2020年9月30日	(1,042)
USD	44,238	ZAR	742,225	2020年9月30日	(1,558)
USD	61,745	ZAR	1,044,767	2020年10月15日	(2,606)
USD	61,745	ZAR	1,043,055	2020年9月30日	(2,612)
USD	123,491	BRL	663,961	2020年10月2日	(3,184)
USD	47,767	BRL	268,173	2020年10月2日	(3,396)
USD	88,476	BRL	481,897	2020年10月2日	(3,463)
CNY	57,880,593	USD	8,154,378	2020年9月25日	402,990
INR	636,642,346	USD	8,475,568	2020年9月25日	180,114
IDR	125,245,980,037	USD	8,364,788	2020年9月25日	130,032
CNY	61,986,993	USD	9,000,579	2020年12月18日	111,133
USD	10,586,300	EUR	8,860,000	2020年9月25日	86,032
IDR	131,073,180,037	USD	8,815,198	2020年10月23日	52,335
USD	1,971,976	GBP	1,490,000	2020年10月16日	39,211
USD	8,966,961	INR	658,623,346	2020年9月25日	12,429
CNY	4,106,400	USD	600,000	2020年9月25日	7,112
USD	1,270,566	CHF	1,150,000	2020年12月11日	1,618
USD	593,678	AUD	810,000	2020年12月11日	1,056
USD	202,478	EUR	170,000	2020年9月25日	1,006
USD	178,606	EUR	150,000	2020年10月14日	763
EUR	150,000	USD	177,182	2020年10月14日	661
EUR	130,000	USD	153,712	2020年9月25日	355
USD	25,000	CHF	22,492	2020年10月14日	224
SGD	25,000	USD	18,270	2020年10月14日	158
USD	12,000	GBP	9,160	2020年10月14日	117
USD	11,000	GBP	8,468	2020年10月14日	15
USD	80,850	HKD	626,690	2020年10月14日	10
HKD	426,269	USD	55,000	2020年10月14日	(13)
USD	130,401	EUR	110,000	2020年10月14日	(17)
USD	12,000	EUR	10,138	2020年10月14日	(20)
USD	140,000	HKD	1,085,509	2020年10月14日	(26)
USD	1,985,525	HKD	15,400,000	2020年12月11日	(66)
USD	47,317	EUR	40,000	2020年9月25日	(87)
USD	94,699	EUR	80,000	2020年9月25日	(111)
USD	1,283,310	HKD	9,950,000	2020年10月14日	(196)
USD	250,505	SEK	2,200,000	2020年12月11日	(268)
USD	8,000	GBP	6,376	2020年10月14日	(271)
USD	250,000	EUR	211,208	2020年10月14日	(414)
USD	11,000	CHF	10,369	2020年10月14日	(423)
USD	1,105,136	SGD	1,500,000	2020年12月11日	(691)
USD	35,000	SGD	48,751	2020年10月14日	(937)
INR	21,981,000	USD	300,000	2020年9月25日	(1,150)
USD	130,000	EUR	113,537	2020年10月14日	(4,613)
IDR	5,827,200,000	USD	400,000	2020年9月25日	(4,770)
USD	167,141	KRW	200,000,000	2020年10月14日	(5,120)
USD	202,051	GBP	160,000	2020年10月14日	(5,492)
USD	160,432	EUR	140,000	2020年10月14日	(5,555)

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	329,491	KRW	390,000,000	2020年9月25日	(6,418)
USD	185,000	EUR	162,044	2020年10月14日	(7,124)
USD	405,689	CHF	380,000	2020年10月14日	(12,902)
INR	658,623,346	USD	8,941,336	2020年10月23日	(14,107)
USD	718,504	SGD	1,000,000	2020年10月14日	(18,642)
USD	8,844,344	IDR	131,073,180,037	2020年9月25日	(45,707)
USD	9,049,196	CNY	61,986,993	2020年9月25日	(115,283)
USD	6,228,999	EUR	5,500,000	2020年10月14日	(291,923)
					3,064,336

注記2 - オプション契約

2020年9月20日現在、ファンドは以下の未決済オプション契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
買い持ちポジション						
EUR	20	C EAD GR 80 18/12/20	2020年12月18日	13,761	8,034	(5,727)
HKD	3	C HSI HK 25600 29/09/20	2020年9月29日	15,638	387	(15,251)
EUR	248	C SGM GR 28 18/09/20	2020年9月18日	61,132	294	(60,838)
EUR	20	C SX5E 3400 18/12/20	2020年12月18日	37,112	20,334	(16,778)
EUR	210	C TIT IM 0.56 18/09/20	2020年9月18日	7,296	0	(7,296)
USD	16	C YNDX UN 65 20/11/20	2020年11月20日	7,520	4,272	(3,248)
				142,459	33,321	(109,138)
売り持ちポジション						
EUR	(10)	P EAD GR 56 18/09/20	2020年9月18日	(3,013)	(12)	3,001
USD	(8)	P YNDX UW 40 20/11/20	2020年11月20日	(1,680)	(200)	1,480
				(4,693)	(212)	4,481
				137,766	33,109	(104,657)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年8月19日）

作成対象期間（2020年8月20日～2021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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰	中率			
15期(2017年8月21日)	円 10,208		% △0.0	% 64.0	% —	百万円 17,754
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

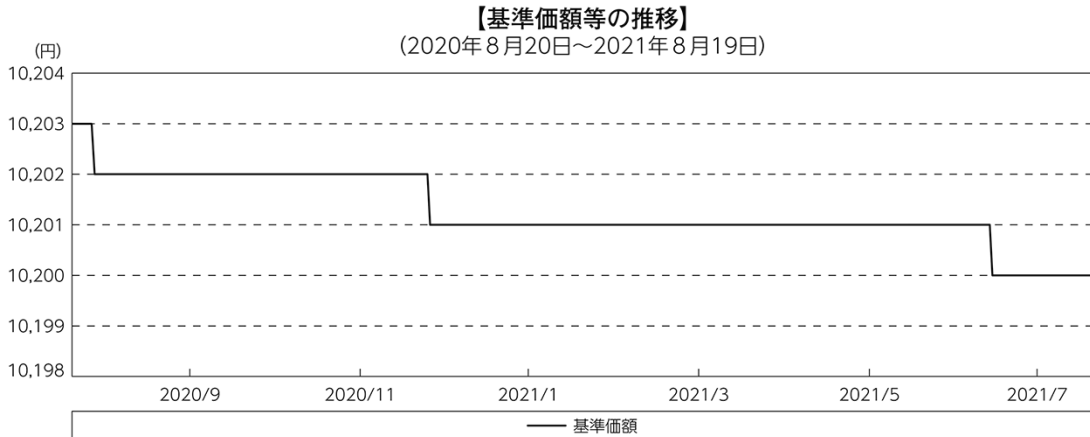
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年8月19日	円 10,203		% —	% 68.2	% —
8月末	10,202		△0.0	58.9	—
9月末	10,202		△0.0	50.4	—
10月末	10,202		△0.0	56.6	—
11月末	10,202		△0.0	28.3	—
12月末	10,201		△0.0	48.3	—
2021年1月末	10,201		△0.0	58.0	—
2月末	10,201		△0.0	56.6	—
3月末	10,201		△0.0	53.8	—
4月末	10,201		△0.0	59.8	—
5月末	10,201		△0.0	58.1	—
6月末	10,201		△0.0	57.9	—
7月末	10,200		△0.0	55.9	—
(期末) 2021年8月19日	10,200		△0.0	60.1	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.07%程度で推移しました。

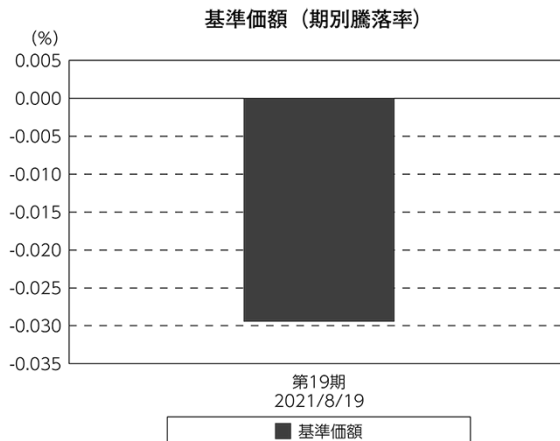
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年8月20日～2021年8月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年8月20日～2021年8月19日)

公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 2,933,243	千円 — (2,410,000)
	特殊債券	7,744,464	— (6,142,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	4,656,400	— (3,416,400)

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

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

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 200,000	千円 — (200,000)

*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

(2020年8月20日～2021年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 15,334	百万円 130	% 0.8	百万円 -	百万円 -	% -

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

○組入資産の明細

(2021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 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	1,300,000 (1,300,000)	1,302,420 (1,302,420)	14.2 (14.2)	- (-)	- (-)	- (-)	14.2 (14.2)
特殊債券 (除く金融債)	1,167,000 (1,167,000)	1,168,119 (1,168,119)	12.8 (12.8)	- (-)	- (-)	- (-)	12.8 (12.8)
金融債券	1,230,000 (1,230,000)	1,230,089 (1,230,089)	13.4 (13.4)	- (-)	- (-)	- (-)	13.4 (13.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,800,000 (1,800,000)	1,801,060 (1,801,060)	19.7 (19.7)	- (-)	- (-)	- (-)	19.7 (19.7)
合 計	5,497,000 (5,497,000)	5,501,690 (5,501,690)	60.1 (60.1)	- (-)	- (-)	- (-)	60.1 (60.1)

* ()内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期		末
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第702回	1.04	100,000	100,353	2021/12/20
大阪府 公募第354回	1.03	100,000	100,201	2021/10/28
共同発行市場地方債 公募第102回	1.03	500,000	500,520	2021/9/24
熊本県 公募平成23年度第2回	1.0	340,000	340,645	2021/10/28
広島市 公募平成23年度第2回	1.0	200,000	200,380	2021/10/25
広島市 公募平成23年度第5回	1.01	60,000	60,319	2022/2/25
小 計		1,300,000	1,302,420	
特殊債券(除く金融債)				
政保 地方公共団体金融機構債券(8年)第2回	0.502	30,000	30,058	2021/12/24
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第152回	1.1	77,000	77,321	2021/12/28
首都高速道路 第19回	0.07	500,000	500,131	2021/12/20
阪神高速道路 第19回	0.02	460,000	460,073	2021/12/20
成田国際空港 第11回	1.067	100,000	100,534	2022/2/18
小 計		1,167,000	1,168,119	
金融債券				
商工債券 利付第802回い号	0.06	30,000	30,002	2022/3/25
しんきん中金債券 利付第321回	0.03	150,000	150,002	2021/8/27
しんきん中金債券 利付第322回	0.03	450,000	450,018	2021/9/27
商工債券 利付(3年)第223回	0.11	500,000	500,053	2021/8/27
商工債券 利付(3年)第224回	0.11	100,000	100,013	2021/9/27
小 計		1,230,000	1,230,089	
普通社債券(含む投資法人債券)				
中部電力 第522回	0.13	300,000	300,284	2022/4/25
関西電力 第525回	0.14	100,000	100,050	2021/12/20
クレディセゾン 第53回社債間限定同順位特約付	0.435	600,000	600,488	2021/10/22
トヨタファイナンス 第66回社債間限定同順位特約付	0.233	100,000	100,018	2021/9/17
三菱UFJリース 第43回社債間限定同順位特約付	0.06	500,000	500,088	2021/10/25
三井不動産 第44回社債間限定同順位特約付	1.173	200,000	200,129	2021/9/6
小 計		1,800,000	1,801,060	
合 計		5,497,000	5,501,690	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年8月19日現在)

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公社債	千円		%
	5,501,690		60.1
コール・ローン等、その他	3,657,462		39.9
投資信託財産総額	9,159,152		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 (2021年8月19日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	9,159,152,994
コール・ローン等	3,648,709,633
公社債(評価額)	5,501,690,180
未収利息	6,302,831
前払費用	2,450,350
(B) 負債	3,052
未払利息	3,052
(C) 純資産総額(A-B)	9,159,149,942
元本	8,979,256,768
次期繰越損益金	179,893,174
(D) 受益権総口数	8,979,256,768口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,200円

(注) 期首元本額は3,112,610,329円、期中追加設定元本額は11,088,903,882円、期中一部解約元本額は5,222,257,443円、1口当たり純資産額は1.0200円です。

○損益の状況 (2020年8月20日～2021年8月19日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	26,935,137
受取利息	27,892,600
支払利息	△ 957,463
(B) 有価証券売買損益	△ 28,401,101
売買損	△ 28,401,101
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,465,964
(D) 前期繰越損益金	63,039,317
(E) 追加信託差損益金	223,303,118
(F) 解約差損益金	△ 104,983,297
(G) 計(C+D+E+F)	179,893,174
次期繰越損益金(G)	179,893,174

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用)	2,690,621,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,977,425,742
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家限定先限付)	1,413,674,178
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)	287,434,434
野村世界業種別投資シリーズ(マネーパブル・ファンド)	241,214,028
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーパブル・ファンド)	101,692,450
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投資	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
ネクストコア	2,282,012
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第12回 野村短期公社債ファンド	1,901,723
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
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	984,834
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	984,834
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	984,834
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	984,834
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	984,834

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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	984,834
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,898
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	982,898
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	982,898
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	982,898
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	982,898
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	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投資	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,608
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	982,608
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	982,608
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	982,608
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	982,608
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	982,608
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	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,608
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	982,608
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	982,608
野村新エマージング債券投資 (円コース) 年2回決算型	982,608
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	982,608
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	982,608
野村アジアCB投資 (毎月分配型)	982,608
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	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投資 (中国元コース) 毎月分配型	982,607

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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	982,607
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	982,607
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投資 (米ドルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投資 (米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 年2回決算型	980,297
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投資 (メキシコペソコース) 毎月分配型	626,503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	398,357
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715
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	373,897
第7回 野村短期公社債ファンド	204,767
野村通貨選択日本株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投資 (インドルピーコース) 毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村通貨選択日本株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投資 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイトータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

〇お知らせ

該当事項はございません。