

# ノムラ・グローバルトレンド (円コース) 毎月分配型

## 運用報告書(全体版)

第120期 (決算日2021年4月23日) 第121期 (決算日2021年5月24日) 第122期 (決算日2021年6月23日)  
第123期 (決算日2021年7月26日) 第124期 (決算日2021年8月23日) 第125期 (決算日2021年9月24日)

作成対象期間 (2021年3月24日～2021年9月24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/資産複合/特殊型(絶対収益追求型)		
信託期間	2011年4月26日から2026年3月23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マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファ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、世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引および為替予約取引等を実質的な主要取引対象とし、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うことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状態においては、マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファ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	ノムラ・グローバルトレンド (円コース) 毎月分配型	マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファ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。	
	マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドー日本円クラス 野村マネー マザーファンド	世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引および為替予約取引等を主要取引対象とします。 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	ノムラ・グローバルトレンド (円コース) 毎月分配型	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、配当等収益等を中心に安定分配を行うことを基本とします。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や安定分配とならない場合があります。なお、毎年3月および9月の決算時には、基準価額水準等を勘案し、安定分配相当額のほか、分配原資の範囲内で委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。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。 「原則として、配当等収益等を中心に安定分配を行う」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。		

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 組 入 比	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落							
96期(2019年4月23日)	8,029		10		1.9	0.1	—	—	98.8	—	563
97期(2019年5月23日)	8,220		10		2.5	0.1	—	—	98.8	—	569
98期(2019年6月24日)	8,637		10		5.2	0.1	—	—	98.8	—	582
99期(2019年7月23日)	8,655		10		0.3	0.1	—	—	98.8	—	572
100期(2019年8月23日)	9,116		10		5.4	0.1	—	—	98.8	—	600
101期(2019年9月24日)	8,682		10	△	4.7	0.1	—	—	98.8	—	541
102期(2019年10月23日)	8,207		10	△	5.4	0.1	—	—	98.8	—	512
103期(2019年11月25日)	8,138		10	△	0.7	0.1	—	—	98.8	—	507
104期(2019年12月23日)	8,193		10		0.8	0.1	—	—	98.8	—	504
105期(2020年1月23日)	8,322		10		1.7	0.1	—	—	98.8	—	512
106期(2020年2月25日)	8,475		10		2.0	0.1	—	—	98.8	—	517
107期(2020年3月23日)	9,319		10		10.1	0.1	—	—	82.4	—	534
108期(2020年4月23日)	9,070		10	△	2.6	0.2	—	—	98.8	—	416
109期(2020年5月25日)	8,666		10	△	4.3	0.1	—	—	98.7	—	398
110期(2020年6月23日)	8,309		10	△	4.0	0.2	—	—	98.7	—	381
111期(2020年7月27日)	8,503		10		2.5	0.2	—	—	98.7	—	390
112期(2020年8月24日)	8,395		10	△	1.2	0.2	—	—	98.7	—	386
113期(2020年9月23日)	8,472		10		1.0	0.2	—	—	98.7	—	362
114期(2020年10月23日)	8,225		10	△	2.8	0.2	—	—	98.7	—	351
115期(2020年11月24日)	8,120		10	△	1.2	0.1	—	—	98.8	—	334
116期(2020年12月23日)	8,697		10		7.2	0.2	—	—	98.4	—	244
117期(2021年1月25日)	9,250		10		6.5	0.2	—	—	98.6	—	260
118期(2021年2月24日)	9,593		10		3.8	0.2	—	—	98.7	—	265
119期(2021年3月23日)	9,501		10	△	0.9	0.2	—	—	98.1	—	255
120期(2021年4月23日)	9,631		10		1.5	0.2	—	—	98.4	—	254
121期(2021年5月24日)	9,887		10		2.8	0.2	—	—	98.1	—	261
122期(2021年6月23日)	9,499		10	△	3.8	0.3	—	—	98.2	—	251
123期(2021年7月26日)	9,551		10		0.7	0.2	—	—	98.3	—	249
124期(2021年8月23日)	9,552		10		0.1	0.2	—	—	98.3	—	249
125期(2021年9月24日)	9,298		10	△	2.6	0.2	—	—	98.0	—	236

\* 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	騰 落 率		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	信 託 券 率
			騰 落 率	騰 落 率				
第120期	(期 首) 2021年 3月23日	円 9,501	% -		% 0.2	% -		% 98.1
	3月末	9,370	△1.4		0.2	-		98.3
	(期 末) 2021年 4月23日	9,641	1.5		0.2	-		98.4
第121期	(期 首) 2021年 4月23日	9,631	-		0.2	-		98.4
	4月末	9,868	2.5		0.2	-		98.4
	(期 末) 2021年 5月24日	9,897	2.8		0.2	-		98.1
第122期	(期 首) 2021年 5月24日	9,887	-		0.2	-		98.1
	5月末	10,042	1.6		0.2	-		98.2
	(期 末) 2021年 6月23日	9,509	△3.8		0.3	-		98.2
第123期	(期 首) 2021年 6月23日	9,499	-		0.3	-		98.2
	6月末	9,736	2.5		0.2	-		98.3
	(期 末) 2021年 7月26日	9,561	0.7		0.2	-		98.3
第124期	(期 首) 2021年 7月26日	9,551	-		0.2	-		98.3
	7月末	9,739	2.0		0.2	-		98.4
	(期 末) 2021年 8月23日	9,562	0.1		0.2	-		98.3
第125期	(期 首) 2021年 8月23日	9,552	-		0.2	-		98.3
	8月末	9,524	△0.3		0.2	-		98.3
	(期 末) 2021年 9月24日	9,308	△2.6		0.2	-		98.0

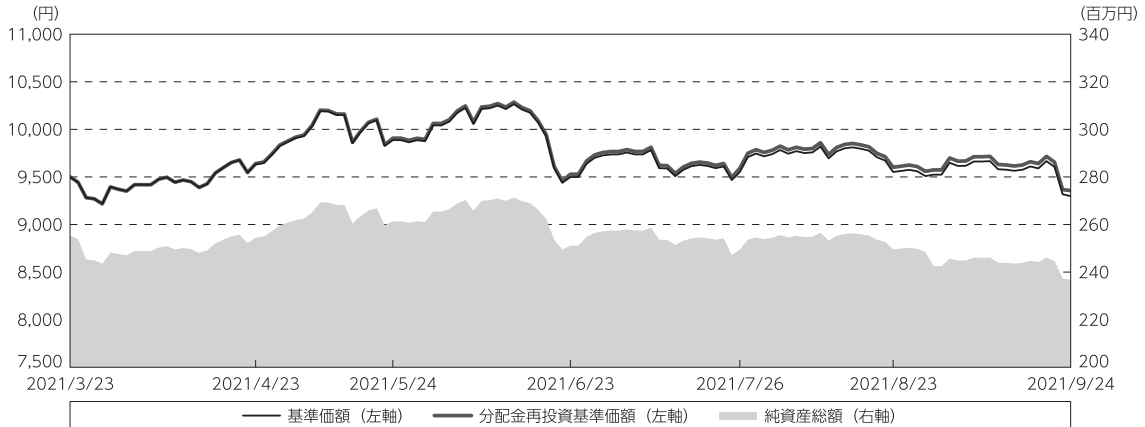
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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（2021年3月23日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

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

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

実質的に投資している世界各国の取引所に上場されている様々な先物取引等からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）

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

### ○投資環境

2021年4月は、新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったことや、米欧の堅調な企業決算などを受けて、米国株式市場は上昇しました。

5月は、米欧の景気回復を背景とした原油需要への期待の高まりなどを背景に、商品市場は上昇しました。

6月は、5月の米雇用統計が市場予想を下回ったこと、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などから、米国債券市場は上昇しました。

7月は、新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒感などを受けた投資家のリスク回避姿勢の強まりや、米国や欧州の量的緩和の早期縮小観測の後退などを背景に、円高・米ドル安となりました。

8月は、市場予想を上回る米欧の4－6月期企業決算や、パウエルFRB議長が慎重に金融政策の正常化を進める姿勢を示したことなどから、米国株式市場は上昇しました。

9月は、FOMC（米連邦公開市場委員会）でテーパリング（量的金融緩和の縮小）開始時期については年内が適切との見方を示したことなどから、米国債券市場は下落しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### 【ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型】

【マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドー日本円クラス】および【野村マネー マザーファンド】の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする【マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドー日本円クラス】の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

### 【マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドー日本円クラス】

主に世界各国の取引所に上場されている様々な先物取引等に投資するとともに、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用しました。

- ・ 共通ポートフォリオにおける各セクターの代表的なロング・ポジション（買い持ち残高）、ショート・ポジション（売り持ち残高）の寄与は以下のようになりました。

- 【通貨】 カナダドル/米ドルのロングなどがマイナスとなり、通貨セクターとしてはマイナスの影響
- 【債券】 韓国国債のロングなどがマイナスとなり、債券セクターとしてはマイナスの影響
- 【金属】 アルミニウムのロングなどがプラスとなり、金属セクターとしてはプラスの影響
- 【短期金利】 ユーロダラー※のロングなどがマイナスとなり、短期金利セクターとしてはマイナスの影響
- 【株式】 スイスSMI指数のロングなどがプラスとなり、株式セクターとしてはプラスの影響
- 【エネルギー】 天然ガスのロングなどがプラスとなり、エネルギーセクターとしてはプラスの影響
- 【農産物】 トウモロコシのショートなどがプラスとなり、農産物セクターとしてはプラスの影響

※ユーロダラー（米国外の銀行に預けられた米ドル）に対して3ヵ月物金利を取引する先物

- ・ 当作成期におけるファンドの騰落率はマイナスとなりました。ファンド全体では、天然ガスのロングなどから主に収益を計上した一方、カナダドル/米ドルのロングなどから主に損失を計上しました。

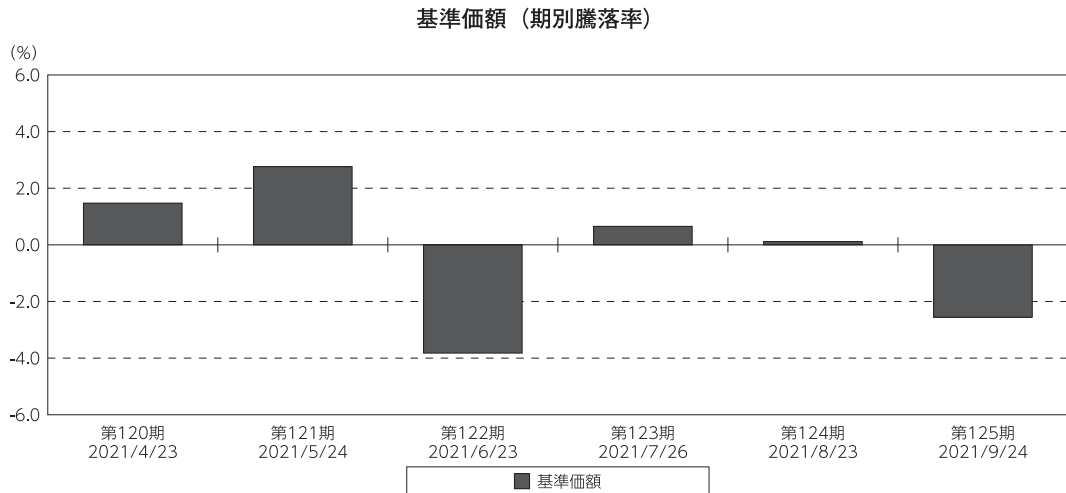
### [野村マネー マザーファンド]

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

### ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

収益分配金については、各期毎の利子・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案して分配を行ないました。

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ないます。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期
	2021年3月24日～ 2021年4月23日	2021年4月24日～ 2021年5月24日	2021年5月25日～ 2021年6月23日	2021年6月24日～ 2021年7月26日	2021年7月27日～ 2021年8月23日	2021年8月24日～ 2021年9月24日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.104%	10 0.101%	10 0.105%	10 0.105%	10 0.105%	10 0.107%
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,677	3,709	3,733	3,760	3,786	3,811

(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

### [ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型]

〔マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファ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〔マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドー日本円クラス〕受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

### [マネージド・フューチャーズ・ディバースファイド・ファンドー日本円クラス]

世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引、および為替予約取引等を積極的に活用し、主として市場動向の方向性にそって多数の先物等についてロング・ポジション、あるいはショート・ポジションを構築することにより、中期的に米ドルベースでの絶対収益<sup>※</sup>の獲得を目指して運用を行なうことを基本とします。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

また、原則として純資産総額とほぼ同額程度、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行ないません。

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なう場合があります。

### [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ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※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うけ、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24日～2021年9月24日)

項 目	第120期～第125期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 51	% 0.530	(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 ）	(15)	(0.151)	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 ）	(35)	(0.362)	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)	(0.017)	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	0.002	(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)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	51	0.532	
作成期間の平均基準価額は、9,713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。

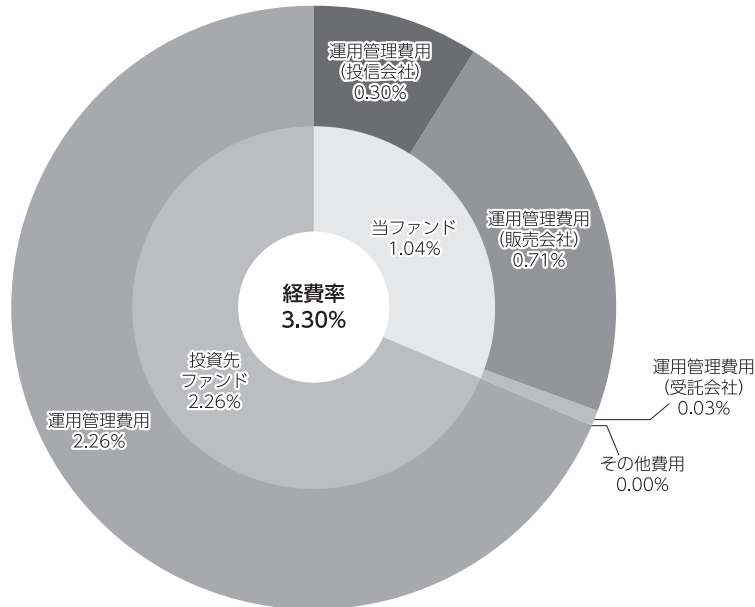
\* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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。

**（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。）**

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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3.30%です。



(単位:%)

<b>経費率(①+②)</b>	<b>3.30</b>
①当ファンドの費用の比率	1.04
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	2.26

(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24日～2021年9月24日)

## 投資信託証券

銘柄		第120期～第125期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	マネージド・フューチャーズ・ディバシファイド・ファンド-日本円クラス	525	3,510	1,996	13,009

\*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24日～2021年9月24日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型&gt;

該当事項はございません。

&lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区分	第120期～第125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 7,562	百万円 30	% 0.4	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

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

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

## ○組入資産の明細

(2021年9月24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119期末	第125期末		
	口数	口数	評価額	比率
マネージド・フューチャーズ・ディバシファイド・ファンド-日本円クラス	38,044	36,573	232,019	98.0
合計	38,044	36,573	232,019	98.0

\*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	第119期末	第125期末	
	口数	口数	評価額
野村マネー マザーファンド	千口 983	千口 983	千円 1,003

\*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24日現在)

項目	第125期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 232,019	% 97.8
野村マネー マザーファンド	1,003	0.4
コール・ローン等、その他	4,229	1.8
投資信託財産総額	237,251	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120期末	第121期末	第122期末	第123期末	第124期末	第125期末
	2021年4月23日現在	2021年5月24日現在	2021年6月23日現在	2021年7月26日現在	2021年8月23日現在	2021年9月24日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	254,961,809	261,790,041	251,595,440	253,054,607	250,707,959	237,251,226
コール・ローン等	3,662,246	4,364,612	3,954,562	6,756,607	4,340,012	4,228,769
投資信託受益証券(評価額)	250,296,120	256,421,986	246,637,435	245,294,655	245,364,602	232,019,112
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,443	1,003,443	1,003,443	1,003,345	1,003,345	1,003,345
(B) 負債	486,477	497,508	492,886	3,597,923	1,172,008	480,057
未払金	—	—	—	—	706,104	—
未払収益分配金	264,212	264,275	264,338	261,171	261,233	254,651
未払解約金	—	—	—	3,096,183	—	—
未払信託報酬	221,575	232,503	227,836	239,819	204,030	224,701
未払利息	1	3	3	5	3	3
その他未払費用	689	727	709	745	638	702
(C) 純資産総額(A-B)	254,475,332	261,292,533	251,102,554	249,456,684	249,535,951	236,771,169
元本	264,212,031	264,275,815	264,338,000	261,171,862	261,233,385	254,651,507
次期繰越損益金	△ 9,736,699	△ 2,983,282	△ 13,235,446	△ 11,715,178	△ 11,697,434	△ 17,880,338
(D) 受益権総口数	264,212,031口	264,275,815口	264,338,000口	261,171,862口	261,233,385口	254,651,507口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,631円	9,887円	9,499円	9,551円	9,552円	9,298円

(注) 第120期首元本額は268,826,123円、第120～125期中追加設定元本額は378,433円、第120～125期中一部解約元本額は14,553,049円、1口当たり純資産額は、第120期0.9631円、第121期0.9887円、第122期0.9499円、第123期0.9551円、第124期0.9552円、第125期0.9298円です。

## ○損益の状況

項 目	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期
	2021年3月24日～ 2021年4月23日	2021年4月24日～ 2021年5月24日	2021年5月25日～ 2021年6月23日	2021年6月24日～ 2021年7月26日	2021年7月27日～ 2021年8月23日	2021年8月24日～ 2021年9月24日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	1,123,784	1,127,410	1,127,366	1,120,847	1,122,565	1,097,120
受取配当金	1,123,830	1,127,460	1,127,460	1,120,937	1,122,630	1,097,190
支払利息	△ 46	△ 50	△ 94	△ 90	△ 65	△ 70
(B) 有価証券売買損益	2,805,337	6,125,866	△10,885,944	734,084	△ 636,157	△ 7,113,290
売買益	2,839,399	6,125,866	—	758,469	—	26,966
売買損	△ 34,062	—	△10,885,944	△ 24,385	△ 636,157	△ 7,140,256
(C) 信託報酬等	△ 222,264	△ 233,230	△ 228,545	△ 240,564	△ 204,668	△ 225,403
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,706,857	7,020,046	△ 9,987,123	1,614,367	281,740	△ 6,241,573
(E) 前期繰越損益金	752,701	4,195,346	10,951,117	699,652	2,052,848	2,039,241
(F) 追加信託差損益金	△13,932,045	△13,934,399	△13,935,102	△13,768,026	△13,770,789	△13,423,355
(配当等相当額)	( 48,008,556)	( 48,032,015)	( 48,055,080)	( 47,491,751)	( 47,514,890)	( 46,329,536)
(売買損益相当額)	(△61,940,601)	(△61,966,414)	(△61,990,182)	(△61,259,777)	(△61,285,679)	(△59,752,891)
(G) 計(D+E+F)	△ 9,472,487	△ 2,719,007	△12,971,108	△11,454,007	△11,436,201	△17,625,687
(H) 収益分配金	△ 264,212	△ 264,275	△ 264,338	△ 261,171	△ 261,233	△ 254,651
次期繰越損益金(G+H)	△ 9,736,699	△ 2,983,282	△13,235,446	△11,715,178	△11,697,434	△17,880,338
追加信託差損益金	△13,932,045	△13,934,399	△13,935,102	△13,768,026	△13,770,789	△13,423,355
(配当等相当額)	( 48,008,556)	( 48,032,015)	( 48,055,080)	( 47,491,751)	( 47,514,890)	( 46,329,536)
(売買損益相当額)	(△61,940,601)	(△61,966,414)	(△61,990,182)	(△61,259,777)	(△61,285,679)	(△59,752,891)
分配準備積立金	49,166,374	49,993,606	50,628,446	50,732,855	51,389,698	50,718,990
繰越損益金	△44,971,028	△39,042,489	△49,928,790	△48,680,007	△49,316,343	△55,175,973

\* 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（2021年3月24日～2021年9月24日）は以下の通りです。

項 目	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期
	2021年3月24日～ 2021年4月23日	2021年4月24日～ 2021年5月24日	2021年5月25日～ 2021年6月23日	2021年6月24日～ 2021年7月26日	2021年7月27日～ 2021年8月23日	2021年8月24日～ 2021年9月24日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,060,542円	1,091,507円	899,178円	975,697円	918,076円	871,929円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補償後)	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	48,008,556円	48,032,015円	48,055,080円	47,491,751円	47,514,890円	46,329,536円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	48,370,044円	49,166,374円	49,993,606円	50,018,329円	50,732,855円	50,101,712円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	97,439,142円	98,289,896円	98,947,864円	98,485,777円	99,165,821円	97,303,177円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	3,687円	3,719円	3,743円	3,770円	3,796円	3,821円
g. 分配金	264,212円	264,275円	264,338円	261,171円	261,233円	254,651円
h. 分配金(1万円当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

## ○分配金のお知らせ

	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	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。

# マネーゾド・フューチャーズ・ディバーシファイド・ファンド (日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)

2020年6月30日決算

(計算期間：2019年7月1日～2020年6月30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
主 要 取 引 対 象	世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引、および為替予約取引等
運 用 方 針	世界各国の債券先物取引、株価指数先物取引、金利先物取引、商品先物取引、および為替予約取引等を積極的に活用し、主として市場動向の方向性にそって多数の先物等についてロング・ポジション、あるいはショート・ポジションを構築することにより、中期的に米ドルベースでの絶対収益の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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	AHLパートナーズ・エルエルピー
共 同 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 保 管 銀 行	ノムラ・バンク (ルクセンブルグ) エス・エー
副 管 理 事 務 代 行 会 社	シトコ・ファンド・サービスズ (アイルランド) リミテッド
モ ニ タ リ ン グ 会 社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社

\*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  
2020年6月30日に終了する計測期間  
(米ドル)

<b>収益</b>			
銀行口座利息		17,564	
収益合計		17,564	
<b>費用</b>			
共同投資顧問報酬		66,527	
モニタリング費用		22,934	
管理費用		45,870	
保管費用		14,047	
銀行手数料		20,945	
受託報酬		9,175	
法務報酬		5,489	
立替費用		4,585	
専門家報酬		24,802	
印刷、出版手数料		33,197	
雑費用		895	
費用合計		248,466	
<b>純投資損益</b>		<b>(230,902)</b>	
投資有価証券売買に係る損益		5,124,635	
外国通貨および為替先渡し契約に係る損益		(2,403,659)	
<b>当期実現純損益</b>		<b>2,720,976</b>	
投資有価証券評価差損益		(1,888,726)	
外国為替先渡し契約に係る評価差損益		(638,961)	
<b>当期評価差損益</b>		<b>(2,527,687)</b>	
<b>運用の結果による純資産の増減額</b>		<b>(37,613)</b>	
	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産
Class ASC (in JPY)	7,595	141,240	1,072,758,833
Class RSC (in JPY)	4,087	394,712	1,613,197,624
Class JPY (in JPY)	5,941	270,828	1,609,020,883



組入資産明細  
2020年6月30日現在  
(米ドル)

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
ケイマン諸島			
投資信託			
317,337	MFDF-INVESTMENT PORTFOLIO ACCOUNT	38,708,824	97.12
		38,708,824	97.12
	ケイマン諸島計	38,708,824	97.12
投資有価証券合計		<b>38,708,824</b>	<b>97.12</b>

外国為替先渡し契約

2020年6月30日現在

通貨(買い)	通貨(売り)	満期日	未実現損益(米ドル)
USD 51,708	JPY 5,550,000	July 10, 2020	201
USD 27,619	JPY 2,963,520	July 10, 2020	116
USD 8,902	JPY 955,215	July 10, 2020	37
AUD 6,998	USD 4,811	July 10, 2020	7
AUD 4,515	USD 3,104	July 10, 2020	5
USD 467	JPY 50,000	July 27, 2020	4
USD 467	JPY 50,000	July 10, 2020	4
AUD 227	USD 155	July 10, 2020	2
AUD 227	USD 155	July 10, 2020	2
BRL 1,690	USD 310	August 04, 2020	2
ZAR 2,714	USD 155	July 10, 2020	1
ZAR 2,719	USD 155	July 27, 2020	1
ZAR 2,713	USD 155	July 10, 2020	1
ZAR 2,718	USD 155	July 27, 2020	1
ZAR 8,121	USD 469	July 10, 2020	1
ZAR 8,136	USD 469	July 27, 2020	1
AUD 226	USD 155	July 27, 2020	0

通貨(買い)		通貨(売り)		満期日	未実現損益(米ドル)
AUD	226	USD	155	July 10, 2020	0
AUD	225	USD	155	July 10, 2020	0
AUD	225	USD	155	July 27, 2020	0
AUD	226	USD	155	July 27, 2020	0
AUD	226	USD	155	July 10, 2020	0
ZAR	2,677	USD	155	July 10, 2020	0
ZAR	2,677	USD	155	July 10, 2020	0
AUD	224	USD	155	July 10, 2020	0
ZAR	2,680	USD	155	July 10, 2020	0
ZAR	2,685	USD	155	July 27, 2020	0
AUD	223	USD	155	July 10, 2020	(1)
ZAR	2,654	USD	155	July 10, 2020	(2)
ZAR	2,649	USD	155	July 10, 2020	(2)
BRL	1,674	USD	311	August 04, 2020	(2)
AUD	678	USD	469	July 27, 2020	(2)
AUD	678	USD	469	July 10, 2020	(2)
ZAR	53,587	USD	3,104	July 10, 2020	(3)
ZAR	83,060	USD	4,811	July 10, 2020	(4)
BRL	1,649	USD	311	August 04, 2020	(7)
BRL	4,871	USD	938	August 04, 2020	(38)
BRL	2,242,979	USD	418,000	August 04, 2020	(3,457)
BRL	2,177,311	USD	413,000	August 04, 2020	(10,594)
BRL	11,235,182	USD	2,093,000	August 04, 2020	(16,535)
BRL	3,527,865	USD	679,057	August 04, 2020	(27,044)
BRL	6,538,692	USD	1,241,000	August 04, 2020	(32,531)
JPY	844,969,442	USD	7,773,377	July 10, 2020	68,453
USD	201,115	ZAR	3,391,781	July 10, 2020	4,817
AUD	3,621,954	USD	2,491,835	July 27, 2020	1,959
USD	211,574	AUD	307,267	July 10, 2020	28
USD	9,203	ZAR	158,782	July 10, 2020	14
JPY	100,000	USD	915	July 10, 2020	12
USD	457	ZAR	7,731	July 10, 2020	10
JPY	50,000	USD	457	July 10, 2020	7
JPY	50,000	USD	457	July 10, 2020	7
USD	457	AUD	656	July 10, 2020	6
USD	3,010	ZAR	51,935	July 10, 2020	5

通貨(買い)		通貨(売り)		満期日	未実現損益(米ドル)
USD	152	ZAR	2,568	July 10, 2020	4
USD	152	ZAR	2,568	July 10, 2020	4
USD	152	AUD	218	July 10, 2020	2
USD	152	AUD	218	July 10, 2020	2
USD	153	ZAR	2,617	July 10, 2020	1
USD	153	ZAR	2,617	July 10, 2020	1
USD	311	ZAR	5,384	July 27, 2020	1
USD	311	ZAR	5,375	July 10, 2020	1
JPY	50,000	USD	463	July 10, 2020	0
USD	153	AUD	222	July 10, 2020	0
USD	153	AUD	222	July 10, 2020	0
USD	311	AUD	453	July 10, 2020	0
USD	311	AUD	453	July 27, 2020	0
USD	623	BRL	3,383	August 04, 2020	(1)
JPY	50,000	USD	469	July 10, 2020	(6)
JPY	50,000	USD	469	July 27, 2020	(6)
JPY	550,000	USD	5,125	July 10, 2020	(21)
USD	3,010	AUD	4,421	July 10, 2020	(34)
USD	9,203	AUD	13,517	July 10, 2020	(103)
JPY	2,950,000	USD	27,492	July 10, 2020	(115)
JPY	24,750,000	USD	231,660	July 27, 2020	(1,917)
JPY	24,750,000	USD	231,614	July 10, 2020	(1,920)
ZAR	42,395,012	USD	2,451,310	July 27, 2020	(2,515)
AUD	3,897,082	USD	2,689,178	July 10, 2020	(6,127)
ZAR	45,753,932	USD	2,673,181	July 10, 2020	(25,187)
JPY	846,003,724	USD	7,912,655	July 27, 2020	(59,550)
CNY	23,518,960	USD	3,303,317	September 25, 2020	8,873
INR	258,203,970	USD	3,405,760	July 22, 2020	7,071
USD	300,000	IDR	4,290,000,000	July 22, 2020	677
USD	100,000	INR	7,580,000	July 22, 2020	(189)
IDR	51,108,040,000	USD	3,627,951	July 22, 2020	(62,029)
					(157,603)

金額は四捨五入されている。1未満の価額はゼロとして開示されている。

# 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	純総資産額
		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

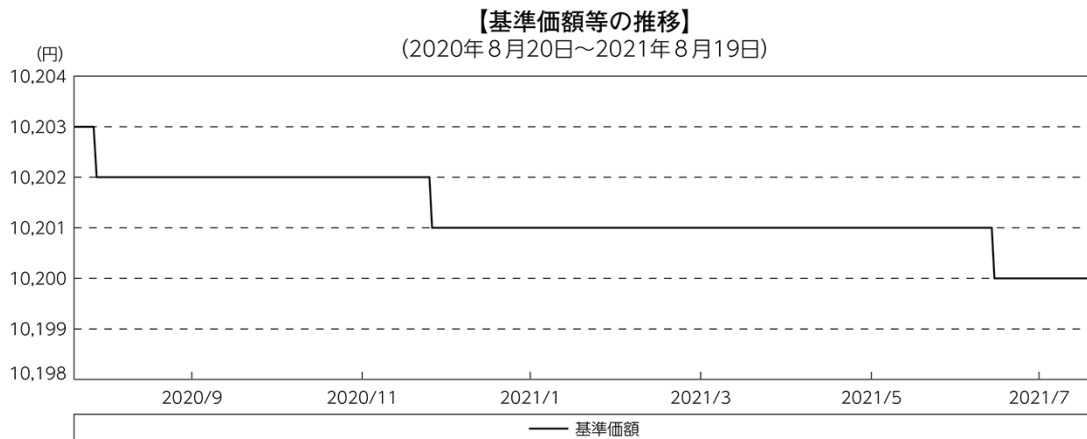
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年8月19日	円 10,203		% —	% 68.2	% —
8月末	10,202		△0.0	58.9	—
9月末	10,202		△0.0	50.4	—
10月末	10,202		△0.0	56.6	—
11月末	10,202		△0.0	28.3	—
12月末	10,201		△0.0	48.3	—
2021年1月末	10,201		△0.0	58.0	—
2月末	10,201		△0.0	56.6	—
3月末	10,201		△0.0	53.8	—
4月末	10,201		△0.0	59.8	—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

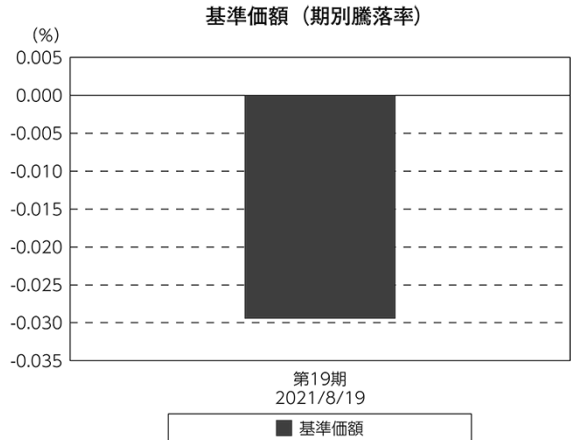
## ○当ファンドのポートフォリオ

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	
<b>地方債証券</b>	%	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		
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
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		
<b>金融債券</b>					
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		
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
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(適格機関投資家販売制限付)	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(マネーボール・ファンド)	241,214,028
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・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
野村テンプルトン・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
野村(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
野村(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テンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプレートン・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。