

野村通貨選択日本株投信 (インドルピーコース) 毎月分配型

運用報告書(全体版)

第35期(決算日2016年6月22日) 第36期(決算日2016年7月22日) 第37期(決算日2016年8月22日)
第38期(決算日2016年9月23日) 第39期(決算日2016年10月24日) 第40期(決算日2016年11月22日)

作成対象期間(2016年5月24日～2016年11月22日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|--|---|
| 商品分類 | 追加型投信/国内/株式 | |
| 信託期間 | 2013年6月27日から2023年11月22日(当初、2018年11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・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンドのインドルピークラス受益証券(以下「投資対象クラス受益証券」といいます。)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、わが国の株式を現実的な主要投資対象とし、わが国の株式市場全体の動きを概ね捉えるとともに、各コースで定められた通貨への投資効果を追求すること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、投資対象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することを基本とします。 | |
| 主な投資対象 | 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 毎月分配型 | 投資対象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、コマース・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。 |
| | 投資対象クラス受益証券 | わが国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村マネー マザーファンド | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。 |
| | 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 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。 |
| 分配方針 | 野村マネー マザーファンド | 株式への投資は行いません。 |
| | 毎決算時に、原則として、配当等収益等を中心に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があります。なお、市況動向や基準価額水準等によっては、分配金額が大きく変動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。 | |

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 | | | 債 組 入 比 | 券 率 | 債 先 物 比 | 券 率 | 投 証 組 入 | 資 信 入 比 | 託 券 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|-------------|--------|--------|--------|------------------|--------|------------------|--------|------------------|------------------|-------------|------------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 | | | | | | | | |
| | 円 | | 円 | | % | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2014年6月23日) | 11,820 | | 60 | | 8.0 | 0.0 | — | | | 99.5 | | 1,247 |
| 12期(2014年7月22日) | 11,608 | | 60 | | △ 1.3 | 0.0 | — | | | 98.7 | | 1,189 |
| 13期(2014年8月22日) | 12,054 | | 60 | | 4.4 | 0.1 | — | | | 99.5 | | 1,201 |
| 14期(2014年9月22日) | 12,975 | | 60 | | 8.1 | 0.0 | — | | | 99.7 | | 2,180 |
| 15期(2014年10月22日) | 11,469 | | 60 | | △11.1 | 0.0 | — | | | 98.5 | | 1,999 |
| 16期(2014年11月25日) | 14,656 | | 60 | | 28.3 | 0.0 | — | | | 99.6 | | 2,613 |
| 17期(2014年12月22日) | 14,707 | | 60 | | 0.8 | 0.0 | — | | | 99.1 | | 2,649 |
| 18期(2015年1月22日) | 14,574 | | 60 | | △ 0.5 | 0.0 | — | | | 97.0 | | 2,874 |
| 19期(2015年2月23日) | 15,409 | | 60 | | 6.1 | 0.0 | — | | | 99.4 | | 3,368 |
| 20期(2015年3月23日) | 16,652 | | 60 | | 8.5 | 0.0 | — | | | 98.8 | | 3,820 |
| 21期(2015年4月22日) | 16,810 | | 60 | | 1.3 | 0.0 | — | | | 99.2 | | 3,898 |
| 22期(2015年5月22日) | 17,072 | | 60 | | 1.9 | 0.0 | — | | | 99.3 | | 4,070 |
| 23期(2015年6月22日) | 17,351 | | 60 | | 2.0 | 0.0 | — | | | 99.4 | | 4,046 |
| 24期(2015年7月22日) | 18,143 | | 60 | | 4.9 | 0.0 | — | | | 99.3 | | 4,224 |
| 25期(2015年8月24日) | 16,183 | | 60 | | △10.5 | 0.0 | — | | | 99.3 | | 3,626 |
| 26期(2015年9月24日) | 14,593 | | 60 | | △ 9.5 | 0.0 | — | | | 99.4 | | 3,370 |
| 27期(2015年10月22日) | 15,261 | | 60 | | 5.0 | 0.0 | — | | | 99.4 | | 3,521 |
| 28期(2015年11月24日) | 16,460 | | 60 | | 8.2 | 0.0 | — | | | 99.4 | | 3,775 |
| 29期(2015年12月22日) | 15,493 | | 60 | | △ 5.5 | 0.0 | — | | | 99.2 | | 3,463 |
| 30期(2016年1月22日) | 12,309 | | 60 | | △20.2 | 0.0 | — | | | 99.2 | | 2,782 |
| 31期(2016年2月22日) | 11,736 | | 60 | | △ 4.2 | 0.0 | — | | | 99.0 | | 2,675 |
| 32期(2016年3月22日) | 12,384 | | 60 | | 6.0 | 0.0 | — | | | 99.2 | | 2,819 |
| 33期(2016年4月22日) | 12,867 | | 60 | | 4.4 | 0.0 | — | | | 99.1 | | 2,645 |
| 34期(2016年5月23日) | 12,221 | | 60 | | △ 4.6 | 0.0 | — | | | 99.1 | | 2,514 |
| 35期(2016年6月22日) | 11,187 | | 60 | | △ 8.0 | 0.0 | — | | | 96.6 | | 2,310 |
| 36期(2016年7月22日) | 11,905 | | 60 | | 7.0 | 0.0 | — | | | 99.1 | | 2,431 |
| 37期(2016年8月22日) | 11,003 | | 60 | | △ 7.1 | 0.0 | — | | | 99.0 | | 2,237 |
| 38期(2016年9月23日) | 11,348 | | 60 | | 3.7 | 0.0 | — | | | 99.1 | | 2,308 |
| 39期(2016年10月24日) | 11,939 | | 60 | | 5.7 | 0.0 | — | | | 99.0 | | 1,571 |
| 40期(2016年11月22日) | 13,147 | | 60 | | 10.6 | 0.0 | — | | | 99.1 | | 1,733 |

* 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 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|------|----------------------|-------------|--------|----------|-------------|-------------|-----------------|
| | | | 騰 落 率 | 率 | | | |
| 第35期 | (期 首) 2016年 5月23日 | 円 12,221 | % — | % 0.0 | % — | % 99.1 | |
| | 5月末 | 12,331 | 0.9 | 0.0 | — | 99.1 | |
| | (期 末) 2016年 6月22日 | 11,247 | △ 8.0 | 0.0 | — | 96.6 | |
| 第36期 | (期 首) 2016年 6月22日 | 11,187 | — | 0.0 | — | 96.6 | |
| | 6月末 | 10,564 | △ 5.6 | 0.0 | — | 99.1 | |
| | (期 末) 2016年 7月22日 | 11,965 | 7.0 | 0.0 | — | 99.1 | |
| 第37期 | (期 首) 2016年 7月22日 | 11,905 | — | 0.0 | — | 99.1 | |
| | 7月末 | 11,484 | △ 3.5 | 0.0 | — | 99.1 | |
| | (期 末) 2016年 8月22日 | 11,063 | △ 7.1 | 0.0 | — | 99.0 | |
| 第38期 | (期 首) 2016年 8月22日 | 11,003 | — | 0.0 | — | 99.0 | |
| | 8月末 | 11,377 | 3.4 | 0.0 | — | 99.1 | |
| | (期 末) 2016年 9月23日 | 11,408 | 3.7 | 0.0 | — | 99.1 | |
| 第39期 | (期 首) 2016年 9月23日 | 11,348 | — | 0.0 | — | 99.1 | |
| | 9月末 | 11,360 | 0.1 | 0.0 | — | 98.9 | |
| | (期 末) 2016年10月24日 | 11,999 | 5.7 | 0.0 | — | 99.0 | |
| 第40期 | (期 首) 2016年10月24日 | 11,939 | — | 0.0 | — | 99.0 | |
| | 10月末 | 12,303 | 3.0 | 0.0 | — | 99.1 | |
| | (期 末) 2016年11月22日 | 13,207 | 10.6 | 0.0 | — | 99.1 | |

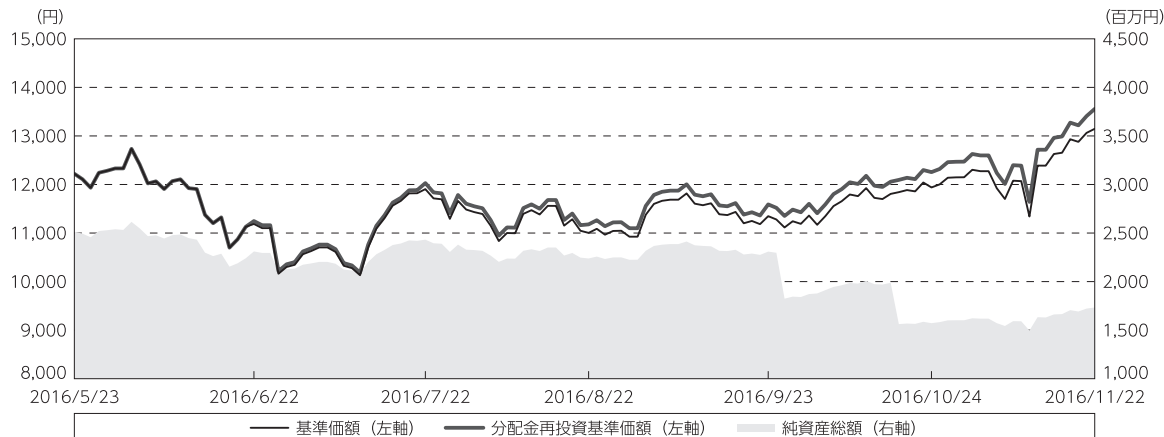
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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



第35期首：12,221円

第40期末：13,147円 (既払分配金(税込み)：360円)

騰落率：10.9% (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(2016年5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) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、当作成期首12,221円から当作成期末13,147円(分配後)となりました。

- ・ 実質的に投資している国内株式からのキャピタルゲイン(またはロス)(株価変動損益)
- ・ 実質的に投資している国内株式からのインカムゲイン(配当収益)
- ・ 実質的に投資している為替取引からのキャピタルゲイン(またはロス)(為替変動損益)
- ・ 実質的に投資している為替取引からのプレミアム(金利差益)またはディスカウント(金利差損)

○投資環境

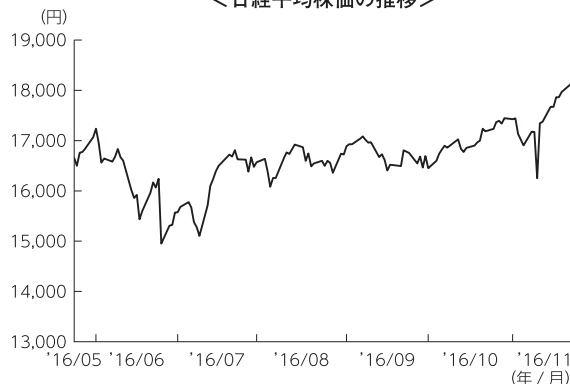
<国内株式市場>

2016年6月には英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票にて、離脱派の勝利が決定したことを受け、リスク回避の動きが鮮明となったことから国内株式市場は下落しました。

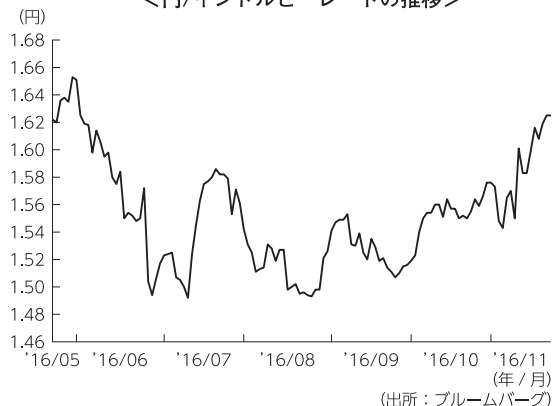
7月には米国株が過去最高値を更新したことや参議院議員選挙での与党勝利を受けて政府による大規模な景気対策への期待が高まったことなどから、国内株式市場は上昇しました。それ以降は概ね一進一退の動きとなりました。

11月には米国大統領選挙において、大方の市場予想に反し共和党のトランプ氏の当選が濃厚となるとリスク回避の動きが強まり、外国為替市場では円高米ドル安が進行、国内株式市場は下落しました。その後は、トランプ氏の政策期待の高まりなどから米国株式市場が過去最高値を更新、外国為替市場では円安米ドル高が進行、国内株式市場も上昇しました。

<日経平均株価の推移>



<円/インドルピーレートの推移>



○当ファンドのポートフォリオ

[野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型]

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス〕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〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス〕の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・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス]

株式組入比率（株価指数先物を含む）は、当作成期を通じて概ね高位を維持しました。

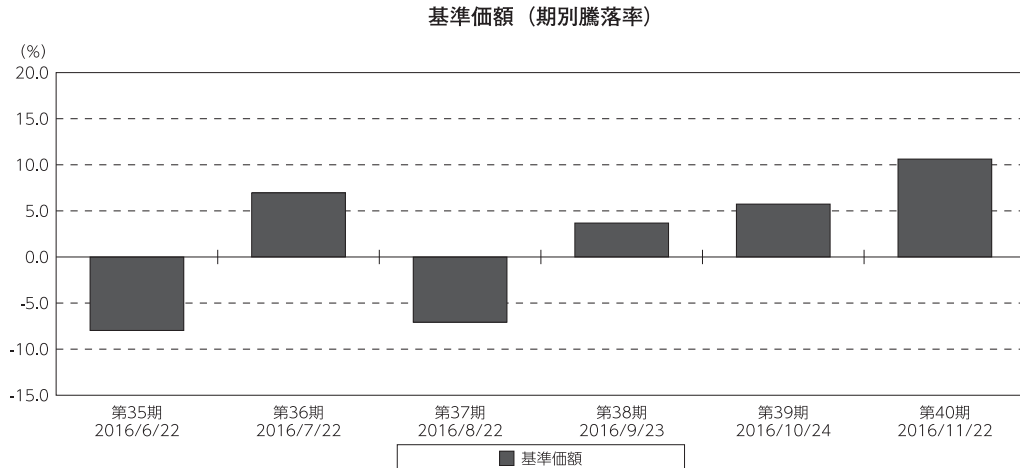
[野村マネー マザーファンド]

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、値動きを表わ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・配当等収益、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35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 | 第39期 | 第40期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| | 2016年5月24日～ 2016年6月22日 | 2016年6月23日～ 2016年7月22日 | 2016年7月23日～ 2016年8月22日 | 2016年8月23日～ 2016年9月23日 | 2016年9月24日～ 2016年10月24日 | 2016年10月25日～ 2016年11月22日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 60 0.533% | 60 0.501% | 60 0.542% | 60 0.526% | 60 0.500% | 60 0.454% |
| 当期の収益 | 53 | 60 | 55 | 60 | 60 | 60 |
| 当期の収益以外 | 6 | — | 4 | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 7,745 | 7,746 | 7,742 | 7,742 | 7,760 | 7,761 |

(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

【野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型】

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス〕 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・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス〕 受益証券への投資比率を高位に維持します。

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス〕

日本企業の株式を主要投資対象とし、わが国の株式市場全体の動きを概ね捉えるとともに、インドルピーへの投資効果を追求することを目的として運用を行ないます。株式への投資にあたっては、代表的なわが国の株価指数※を構成する株式に主に投資を行ない、当該株価指数の動きを概ね捉える投資成果を目指して株式ポートフォリオを構築することを基本とします。

※日経平均株価とします。ただし、変更する場合があります。

【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ない、あわせて債券現先取引やコール・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の動きについて

店頭デリバティブ取引に関して、将来、国際的に規制の強化等が予定されています。ファンドが投資対象とする外国投資信託が原則として活用する店頭デリバティブ取引（オプション、NDFおよびNDO等を含みます。）が当該規制強化等の対象取引となり、かつ、当該取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合、当該現金等を資産の一部として追加的に保有することとなります。その場合、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

(2016年5月24日～2016年11月22日)

| 項 目 | 第35期～第40期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 37 | % 0.319 | (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) | (6) | (0.054) | 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) | (29) | (0.249) | 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 | 0.002 | (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 | 37 | 0.321 | |
| 作成期間の平均基準価額は、11,569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

(2016年5月24日～2016年11月22日)

投資信託証券

| 銘 柄 | 第35期～第40期 | | | |
|---|-----------|---------|--------|-----------|
| | 買 付 | | 売 付 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内 | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| ノムラ・マネージド・マスター・トラスト- ジャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンドインドルピークラス | 14,325 | 158,041 | 90,226 | 1,007,137 |

*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

(2016年5月24日～2016年11月22日)

利害関係人との取引状況

<野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型>
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 | 第35期～第40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 24,221 | 百万円 1,362 | % 5.6 | 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

(2016年11月22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34期末 | 第40期末 | | |
|--|--------------|--------------|-----------------|-----------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| ノムラ・マネージド・マスター・トラストー ジャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド インドルピークラス | 口 210,169 | 口 134,268 | 千円 1,716,884 | % 99.1 |
| 合計 | 210,169 | 134,268 | 1,716,884 | 99.1 |

*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34期末 | 第40期末 | |
|---------------|-----------|-----------|-------------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| 野村マネー マザーファンド | 千口 981 | 千口 981 | 千円 1,002 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年11月22日現在)

| 項 目 | 第40期末 | |
|---------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 1,716,884 | 97.5 |
| 野村マネー マザーファンド | 1,002 | 0.1 |
| コール・ローン等、その他 | 43,881 | 2.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,761,767 | 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35期末 | 第36期末 | 第37期末 | 第38期末 | 第39期末 | 第40期末 |
|--------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2016年6月22日現在 | 2016年7月22日現在 | 2016年8月22日現在 | 2016年9月23日現在 | 2016年10月24日現在 | 2016年11月22日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 2,325,315,035 | 2,455,365,977 | 2,252,495,122 | 2,322,767,252 | 1,591,173,637 | 1,761,767,310 |
| コール・ローン等 | 91,878,517 | 34,301,450 | 35,164,171 | 34,346,986 | 28,904,221 | 43,880,333 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 2,232,020,032 | 2,409,144,498 | 2,216,020,290 | 2,287,102,749 | 1,556,656,816 | 1,716,884,916 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,002,159 | 1,002,159 | 1,002,159 | 1,002,061 | 1,002,061 | 1,002,061 |
| 未収入金 | 414,327 | 10,917,870 | 308,502 | 315,456 | 4,610,539 | — |
| (B) 負債 | 14,853,047 | 23,615,634 | 14,516,734 | 14,000,646 | 19,456,642 | 28,668,396 |
| 未払金 | 1,190,697 | — | 990,822 | 496,432 | 3,594,140 | 11,186,921 |
| 未払収益分配金 | 12,391,779 | 12,255,861 | 12,203,828 | 12,206,915 | 7,898,941 | 7,909,517 |
| 未払解約金 | — | 10,182,447 | 66,720 | — | 6,923,155 | 8,748,339 |
| 未払信託報酬 | 1,264,013 | 1,171,340 | 1,248,974 | 1,290,692 | 1,035,119 | 819,404 |
| 未払利息 | 140 | 43 | 49 | 56 | 35 | 59 |
| その他未払費用 | 6,418 | 5,943 | 6,341 | 6,551 | 5,252 | 4,156 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,310,461,988 | 2,431,750,343 | 2,237,978,388 | 2,308,766,606 | 1,571,716,995 | 1,733,098,914 |
| 元本 | 2,065,296,579 | 2,042,643,521 | 2,033,971,371 | 2,034,485,938 | 1,316,490,300 | 1,318,252,964 |
| 次期繰越損益金 | 245,165,409 | 389,106,822 | 204,007,017 | 274,280,668 | 255,226,695 | 414,845,950 |
| (D) 受益権総口数 | 2,065,296,579口 | 2,042,643,521口 | 2,033,971,371口 | 2,034,485,938口 | 1,316,490,300口 | 1,318,252,964口 |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 11,187円 | 11,905円 | 11,003円 | 11,348円 | 11,939円 | 13,147円 |

(注) 第35期首元本額は2,057,294,412円、第35～40期中追加設定元本額は137,665,033円、第35～40期中一部解約元本額は876,706,481円、1口当たり純資産額は、第35期1.1187円、第36期1.1905円、第37期1.1003円、第38期1.1348円、第39期1.1939円、第40期1.13147円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 | 第39期 | 第40期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| | 2016年5月24日～ 2016年6月22日 | 2016年6月23日～ 2016年7月22日 | 2016年7月23日～ 2016年8月22日 | 2016年8月23日～ 2016年9月23日 | 2016年9月24日～ 2016年10月24日 | 2016年10月25日～ 2016年11月22日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 12,356,935 | 12,537,155 | 12,468,038 | 12,437,990 | 8,147,161 | 8,013,482 |
| 受取配当金 | 12,358,282 | 12,538,805 | 12,469,221 | 12,439,359 | 8,149,076 | 8,014,191 |
| 支払利息 | △ 1,347 | △ 1,650 | △ 1,183 | △ 1,369 | △ 1,915 | △ 709 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 206,666,410 | 147,460,241 | △ 182,161,619 | 70,717,333 | 76,268,183 | 159,172,294 |
| 売買益 | 1,948,563 | 148,905,990 | 461,721 | 71,289,696 | 91,144,427 | 159,936,559 |
| 売買損 | △ 208,614,973 | △ 1,445,749 | △ 182,623,340 | △ 572,363 | △ 14,876,244 | △ 764,265 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,270,431 | △ 1,177,283 | △ 1,255,315 | △ 1,297,243 | △ 1,040,371 | △ 823,560 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 195,579,906 | 158,820,113 | △ 170,948,896 | 81,858,080 | 83,374,973 | 166,362,216 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 230,642,111 | △ 433,223,312 | △ 284,110,600 | △ 464,588,581 | △ 245,908,349 | △ 169,173,374 |
| (F) 追加信託差損益金 | 683,779,205 | 675,765,882 | 671,270,341 | 669,218,084 | 425,659,012 | 425,566,625 |
| (配当等相当額) | (710,376,528) | (703,605,124) | (704,517,612) | (709,836,169) | (475,739,322) | (481,096,016) |
| (売買損益相当額) | (△ 26,597,323) | (△ 27,839,242) | (△ 33,247,271) | (△ 40,618,085) | (△ 50,080,310) | (△ 55,529,391) |
| (G) 計(D+E+F) | 257,557,188 | 401,362,683 | 216,210,845 | 286,487,583 | 263,125,636 | 422,755,467 |
| (H) 収益分配金 | △ 12,391,779 | △ 12,255,861 | △ 12,203,828 | △ 12,206,915 | △ 7,898,941 | △ 7,909,517 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 245,165,409 | 389,106,822 | 204,007,017 | 274,280,668 | 255,226,695 | 414,845,950 |
| 追加信託差損益金 | 683,779,205 | 675,765,882 | 671,270,341 | 669,218,084 | 425,659,012 | 425,566,625 |
| (配当等相当額) | (710,376,529) | (703,605,134) | (704,517,612) | (709,836,170) | (475,739,326) | (481,096,026) |
| (売買損益相当額) | (△ 26,597,324) | (△ 27,839,252) | (△ 33,247,271) | (△ 40,618,086) | (△ 50,080,314) | (△ 55,529,401) |
| 分配準備積立金 | 889,294,279 | 878,786,462 | 870,228,641 | 865,384,069 | 545,948,064 | 542,105,765 |
| 繰越損益金 | △ 1,327,908,075 | △ 1,165,445,522 | △ 1,337,491,965 | △ 1,260,321,485 | △ 716,380,381 | △ 552,826,440 |

* 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(2016年5月24日～2016年11月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 | 第39期 | 第40期 |
|------------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| | 2016年5月24日～ 2016年6月22日 | 2016年6月23日～ 2016年7月22日 | 2016年7月23日～ 2016年8月22日 | 2016年8月23日～ 2016年9月23日 | 2016年9月24日～ 2016年10月24日 | 2016年10月25日～ 2016年11月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 11,086,801円 | 12,445,258円 | 11,213,064円 | 12,244,332円 | 8,047,094円 | 7,974,350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 | 710,376,529円 | 703,605,134円 | 704,517,612円 | 709,836,170円 | 475,739,326円 | 481,096,026円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 890,599,257円 | 878,597,065円 | 871,219,405円 | 865,346,652円 | 545,799,911円 | 542,040,932円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 1,612,062,587円 | 1,594,647,457円 | 1,586,950,081円 | 1,587,427,154円 | 1,029,586,331円 | 1,031,111,308円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 7,805円 | 7,806円 | 7,802円 | 7,802円 | 7,820円 | 7,821円 |
| g. 分配金 | 12,391,779円 | 12,255,861円 | 12,203,828円 | 12,206,915円 | 7,898,941円 | 7,909,517円 |
| h. 分配金(1万円当たり) | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 |

○分配金のお知らせ

| | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 | 第39期 | 第40期 |
|----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60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11月22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(18,247,277千口)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40期末 | | | | | | |
|---------------------|--------------|--------------|---------|--------------------|-----------|------|--------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地方債証券 | 988,910 | 990,656 | 5.3 | — | — | — | 5.3 |
| | (988,910) | (990,656) | (5.3) | (—) | (—) | (—) | (5.3) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 5,155,000 | 5,161,523 | 27.7 | — | — | — | 27.7 |
| | (5,155,000) | (5,161,523) | (27.7) | (—) | (—) | (—) | (27.7) |
| 金融債券 | 4,280,000 | 4,283,439 | 23.0 | — | — | — | 23.0 |
| | (4,280,000) | (4,283,439) | (23.0) | (—) | (—) | (—) | (23.0) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 4,400,000 | 4,411,348 | 23.7 | — | — | — | 23.7 |
| | (4,400,000) | (4,411,348) | (23.7) | (—) | (—) | (—) | (23.7) |
| 合 計 | 14,823,910 | 14,846,968 | 79.7 | — | — | — | 79.7 |
| | (14,823,910) | (14,846,968) | (79.7) | (—) | (—) | (—) | (79.7) |

*（ ）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 | 利 率 | 第40期末 | | |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 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10回 | 1.9 | 200,000 | 200,388 | 2016/12/28 |
| 北海道 公募（5年）平成23年度第12回 | 0.38 | 5,000 | 5,003 | 2017/1/31 |
| 北海道 公募（5年）平成23年度第14回 | 0.35 | 200,000 | 200,268 | 2017/3/23 |
| 神奈川県 公募第143回 | 1.77 | 100,000 | 100,141 | 2016/12/20 |
| 神奈川県 公募第145回 | 1.8 | 100,000 | 100,567 | 2017/3/20 |
| 群馬県 公募第3回 | 1.9 | 9,000 | 9,001 | 2016/11/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第44回 | 1.8 | 100,000 | 100,022 | 2016/11/25 |
| 島根県 公募平成23年度第1回 | 0.38 | 2,500 | 2,500 | 2016/11/25 |
| 横浜市 公募平成18年度第3回 | 1.87 | 200,000 | 200,300 | 2016/12/20 |
| 川崎市 公募（5年）第31回 | 0.27 | 2,000 | 2,001 | 2017/3/17 |
| 広島市 公募平成18年度第1回 | 1.82 | 6,000 | 6,010 | 2016/12/26 |
| 仙台市 公募平成23年度第1回 | 0.36 | 59,410 | 59,442 | 2017/1/27 |
| さいたま市 公募第4回 | 1.8 | 5,000 | 5,008 | 2016/12/26 |
| 小 計 | | 988,910 | 990,656 | |
| 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21回 | 1.8 | 125,000 | 125,060 | 2016/11/30 |
| 銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第26回 | 0.1 | 350,000 | 350,089 | 2017/1/20 |
| 新関西国際空港社債 財投機関債第7回 | 0.217 | 100,000 | 100,023 | 2016/12/20 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第19回 | 0.445 | 300,000 | 300,123 | 2016/12/20 |
| 地方公共団体金融機構債券（5年）第9回 | 0.34 | 100,000 | 100,157 | 2017/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券（2年）第2回 | 0.1 | 200,000 | 200,103 | 2017/3/28 |
| 公営企業債券 第24回財投機関債 | 1.94 | 100,000 | 100,155 | 2016/12/20 |
| 阪神高速道路 第7回 | 0.448 | 130,000 | 130,038 | 2016/12/20 |
| 国際協力銀行債券 第27回財投機関債 | 1.77 | 100,000 | 100,558 | 2017/3/17 |
| 都市再生債券 財投機関債第14回 | 1.9 | 100,000 | 100,599 | 2017/3/17 |
| 都市再生債券 財投機関債第82回 | 0.187 | 100,000 | 100,016 | 2016/12/20 |
| 関西国際空港社債 財投機関債第34回 | 0.535 | 100,000 | 100,036 | 2016/12/20 |
| 福祉医療機構債券 第36回財投機関債 | 0.167 | 100,000 | 100,018 | 2016/12/20 |
| 中部国際空港社債 財投機関債第2回 | 0.489 | 1,500,000 | 1,502,015 | 2017/2/24 |
| 成田国際空港 第3回 | 1.92 | 600,000 | 600,754 | 2016/12/20 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第38回 | 0.1 | 400,000 | 400,143 | 2017/2/20 |
| 東日本高速道路 第18回 | 0.387 | 30,000 | 30,103 | 2017/9/20 |
| 中日本高速道路社債 第15回 | 0.931 | 420,000 | 421,259 | 2017/3/17 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第12回 | 1.91 | 200,000 | 200,249 | 2016/12/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第50回 | 0.204 | 100,000 | 100,014 | 2016/12/20 |
| 小 計 | | 5,155,000 | 5,161,523 | |
| 金融債券 | | | | |
| 商工債券 利付第738回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,015 | 2016/11/25 |
| 商工債券 利付第739回い号 | 0.5 | 200,000 | 200,100 | 2016/12/27 |
| 商工債券 利付第743回い号 | 0.4 | 300,000 | 300,522 | 2017/4/27 |
| 農林債券 利付第738回い号 | 0.5 | 280,000 | 280,030 | 2016/11/25 |
| 農林債券 利付第739回い号 | 0.5 | 800,000 | 800,399 | 2016/12/27 |
| 農林債券 利付第740回い号 | 0.5 | 200,000 | 200,185 | 2017/1/27 |
| 農林債券 利付第741回い号 | 0.5 | 100,000 | 100,132 | 2017/2/27 |
| 農林債券 利付第742回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,312 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第265回 | 0.5 | 500,000 | 500,231 | 2016/12/27 |

| 銘 | 柄 | 第40期末 | | | |
|------------------------|--------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 金融債券 | | % | 千円 | 千円 | |
| しんきん中金債券 | 利付第266回 | 0.45 | 300,000 | 300,267 | 2017/1/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第268回 | 0.4 | 500,000 | 500,694 | 2017/3/27 |
| 商工債券 | 利付（3年）第166回 | 0.2 | 100,000 | 100,001 | 2016/11/25 |
| 商工債券 | 利付（3年）第167回 | 0.2 | 100,000 | 100,019 | 2016/12/27 |
| 商工債券 | 利付（3年）第169回 | 0.2 | 100,000 | 100,057 | 2017/2/27 |
| 商工債券 | 利付（3年）第171回 | 0.2 | 100,000 | 100,092 | 2017/4/27 |
| 商工債券 | 利付（3年）第173回 | 0.2 | 300,000 | 300,376 | 2017/6/27 |
| 小 | 計 | | 4,280,000 | 4,283,439 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| 関西電力 | 第491回 | 0.527 | 100,000 | 100,044 | 2016/12/20 |
| 三菱商事 | 第77回担保提供制限等財務上特約無 | 0.56 | 400,000 | 400,208 | 2016/12/26 |
| みずほコーポレート銀行 | 第7回特定社債間限定同順位特約付 | 2.08 | 100,000 | 101,401 | 2017/7/27 |
| みずほコーポレート銀行 | 第28回特定社債間限定同順位特約付 | 0.515 | 100,000 | 100,092 | 2017/1/25 |
| みずほコーポレート銀行 | 第29回特定社債間限定同順位特約付 | 0.46 | 100,000 | 100,194 | 2017/4/21 |
| みずほコーポレート銀行 | 第30回特定社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 200,000 | 200,487 | 2017/7/25 |
| 三菱東京UFJ銀行 | 第132回特定社債間限定同順位特約付 | 0.46 | 500,000 | 500,405 | 2017/1/24 |
| 三井住友銀行 | 第56回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 600,000 | 600,461 | 2017/1/20 |
| ホンダファイナンス | 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.465 | 300,000 | 300,087 | 2016/12/20 |
| ホンダファイナンス | 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.372 | 200,000 | 200,432 | 2017/6/20 |
| 三井住友ファイナンス&リース | 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.554 | 200,000 | 200,272 | 2017/2/23 |
| 三菱UFJリース | 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.66 | 600,000 | 600,219 | 2016/12/14 |
| 三菱UFJリース | 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.578 | 100,000 | 100,148 | 2017/2/28 |
| 三菱地所 | 第79回担保提供制限等財務上特約無 | 1.79 | 100,000 | 100,545 | 2017/3/17 |
| 小田急電鉄 | 第64回社債間限定同順位特約付 | 0.21 | 100,000 | 100,035 | 2017/1/25 |
| 東日本旅客鉄道 | 第5回 | 3.3 | 500,000 | 504,166 | 2017/2/25 |
| 大阪瓦斯 | 第7回社債間限定同順位特約付 | 3.4 | 200,000 | 202,142 | 2017/3/20 |
| 小 | 計 | | 4,400,000 | 4,411,348 | |
| 合 | 計 | | 14,823,910 | 14,846,968 | |

* 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40期末 | |
|-------------|---------------|----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 999,992 | % 5.4 |

* 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。

ノムラ・マネージド・マスター・トラストー
 ジャパン・ストック・パッシブ・インベストメント・ファンド
 (米ドルクラス、ユーロクラス、豪ドルクラス、ブラジルリアルクラス、
 トルコリラクラス、メキシコペソクラス、中国元クラス、
 インドネシアルピアクラス、インドルピークラス、ロシアルーブルクラス)

2016年3月31日決算

(計算期間:2015年4月1日～2016年3月31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 | 日本企業の株式を主要投資対象とし、わが国の株式市場全体の動きを概ね捉えるとともに、各クラス名に表示されている通貨への投資効果を追求することを目的として運用を行うことを基本とします。 |
| 投 資 対 象 | わが国の株式 |
| 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 |
| 保 管 ・ 事 務 代 行 会 社 | ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー |

*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3月31日に終了する計測期間

(円)

収益

| | |
|--------|----------------------|
| 受取配当金等 | 2,387,514,173 |
| 収益合計 | <u>2,387,514,173</u> |

費用

| | |
|----------|--------------------|
| 投資顧問報酬 | 635,668,779 |
| 事務管理代行報酬 | 141,193,232 |
| 保管費用 | 52,975,863 |
| 取引銀行報酬 | 22,980,271 |
| 銀行手数料 | 1,135,000 |
| 受託報酬 | 35,315,858 |
| 法務報酬 | 134,774 |
| 立替費用 | 3,978,474 |
| 専門家報酬 | 2,142,032 |
| 創業費償却 | 870,872 |
| 雑費用 | 13,651 |
| 費用合計 | <u>896,408,806</u> |

| | |
|--------------|----------------------|
| 純投資損益 | <u>1,491,105,367</u> |
|--------------|----------------------|

| | |
|-----------------------|-------------------------|
| 投資有価証券売買に係る損益 | 15,045,354,387 |
| 先物取引契約に係る損益 | (1,085,802,700) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | <u>(12,299,287,497)</u> |

| | |
|----------------|----------------------|
| 当期実現純損益 | <u>1,660,264,190</u> |
|----------------|----------------------|

| | |
|-------------------|--------------------|
| 投資有価証券評価差損益 | (33,735,473,707) |
| 先物取引契約に係る評価差損益 | (316,705,000) |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損益 | <u>395,731,278</u> |

| | |
|----------------|-------------------------|
| 当期評価差損益 | <u>(33,656,447,429)</u> |
|----------------|-------------------------|

| | |
|------------------------|--------------------------------|
| 運用の結果による純資産の増減額 | <u><u>(30,505,077,872)</u></u> |
|------------------------|--------------------------------|

組入資産明細
2016年3月31日現在
(円)

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|-----------|--------------------------------|----------------|----------|
| | 日本 | | |
| 普通株 | | | |
| 288,000 | FAST RETAILING CO LTD | 10,373,760,000 | 7.89 |
| 1,728,000 | KDDI CORP | 5,194,368,000 | 3.96 |
| 288,000 | FANUC CORPORATION | 5,035,680,000 | 3.84 |
| 864,000 | SOFTBANK GROUP | 4,636,224,000 | 3.53 |
| 576,000 | KYOCERA CORP | 2,855,232,000 | 2.17 |
| 288,000 | DAIKIN INDUSTRIES LTD | 2,422,656,000 | 1.84 |
| 288,000 | SECOM CO LTD | 2,409,408,000 | 1.83 |
| 576,000 | TERUMO CORP | 2,324,160,000 | 1.77 |
| 1,440,000 | ASTELLAS PHARMA INC | 2,154,960,000 | 1.64 |
| 288,000 | TOKYO ELECTRON LTD | 2,112,768,000 | 1.61 |
| 288,000 | EISAI CO LTD | 1,949,760,000 | 1.48 |
| 288,000 | NITTO DENKO CORP | 1,802,016,000 | 1.37 |
| 288,000 | TDK CORP | 1,800,000,000 | 1.37 |
| 576,000 | HONDA MOTOR CO LTD | 1,777,536,000 | 1.35 |
| 288,000 | KAO CORP | 1,728,864,000 | 1.31 |
| 288,000 | TOYOTA MOTOR CORP | 1,714,176,000 | 1.30 |
| 288,000 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD | 1,677,312,000 | 1.27 |
| 288,000 | DENTSU | 1,627,200,000 | 1.24 |
| 288,000 | NTT DATA CORP | 1,627,200,000 | 1.24 |
| 288,000 | SHIONOGI & CO LTD | 1,525,536,000 | 1.16 |
| 288,000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | 1,479,168,000 | 1.12 |
| 432,000 | CANON INC | 1,449,360,000 | 1.10 |
| 288,000 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | 1,380,096,000 | 1.05 |
| 288,000 | JAPAN TOBACCO INC | 1,350,720,000 | 1.03 |
| 288,000 | DENSO CORP | 1,302,912,000 | 0.99 |
| 288,000 | FUJIFILM HOLDINGS CORP | 1,281,888,000 | 0.97 |
| 288,000 | OLYMPUS CORP | 1,260,000,000 | 0.96 |
| 288,000 | BRIDGESTONE CORP | 1,211,040,000 | 0.92 |
| 288,000 | TREND MICRO INC | 1,186,560,000 | 0.90 |
| 288,000 | FUJI HEAVY INDUSTRIES LTD | 1,144,800,000 | 0.87 |
| 288,000 | KIKKOMAN CORP | 1,065,600,000 | 0.81 |
| 288,000 | ASAHI GROUP HOLDINGS | 1,010,016,000 | 0.77 |
| 288,000 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | 1,003,680,000 | 0.76 |
| 288,000 | YAMAHA CORP | 976,320,000 | 0.74 |
| 288,000 | KONAMI HOLDINGS CORP | 959,040,000 | 0.73 |
| 288,000 | SUMITOMO REALTY & DEV CO LTD | 948,672,000 | 0.72 |
| 288,000 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | 911,808,000 | 0.69 |
| 288,000 | SUZUKI MOTOR CORP | 867,168,000 | 0.66 |
| 288,000 | NISSAN CHEMICAL INDUSTRIES LTD | 835,200,000 | 0.63 |
| 288,000 | SONY CORP | 833,184,000 | 0.63 |
| 288,000 | MITSUI FUDOSAN CO LTD | 808,704,000 | 0.61 |
| 288,000 | TOYOTA TSUSHO CORP | 732,384,000 | 0.56 |
| 288,000 | AJINOMOTO CO INC | 731,376,000 | 0.56 |
| 288,000 | SHISEIDO CO LTD | 723,456,000 | 0.55 |
| 288,000 | DAIICHI SANKYO CO LTD | 720,720,000 | 0.55 |

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|----------------------------------|-------------|----------|
| 288,000 | NH FOODS LTD | 714,240,000 | 0.54 |
| 288,000 | CASIO COMPUTER CO LTD | 654,048,000 | 0.50 |
| 288,000 | YAMATO HOLDINGS CO LTD | 647,136,000 | 0.49 |
| 288,000 | TOYO SEIKAN GROUP HOLDINGS LTD | 607,104,000 | 0.46 |
| 288,000 | mitsubishi ESTATE CO LTD | 602,064,000 | 0.46 |
| 576,000 | ADVANTEST CORP | 599,616,000 | 0.46 |
| 288,000 | NGK INSULATORS LTD | 598,752,000 | 0.46 |
| 28,800 | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO | 573,264,000 | 0.44 |
| 288,000 | ALPS ELECTRIC CO LTD | 565,056,000 | 0.43 |
| 288,000 | CREDIT SAISON CO LTD | 564,192,000 | 0.43 |
| 288,000 | KOMATSU LTD | 551,808,000 | 0.42 |
| 288,000 | MITSUBISHI CORP | 548,928,000 | 0.42 |
| 144,000 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | 547,200,000 | 0.42 |
| 288,000 | SEKISUI HOUSE LTD | 547,056,000 | 0.42 |
| 57,600 | MEIJI HOLDING CO LTD | 521,280,000 | 0.40 |
| 288,000 | KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD | 517,248,000 | 0.39 |
| 288,000 | NISSHIN SEIFUN GROUP INC | 515,232,000 | 0.39 |
| 288,000 | HITACHI CONST MACH CO LTD | 514,944,000 | 0.39 |
| 144,000 | TOTO LTD | 505,440,000 | 0.38 |
| 288,000 | COMSYS HOLDINGS CORP | 500,544,000 | 0.38 |
| 288,000 | NIKON CORP | 495,936,000 | 0.38 |
| 288,000 | JGC CORP | 485,280,000 | 0.37 |
| 288,000 | AEON CO LTD | 468,288,000 | 0.36 |
| 288,000 | MARUI GROUP CO LTD | 464,544,000 | 0.35 |
| 288,000 | KEISEI ELECTRIC RAILWAY CO LTD | 455,904,000 | 0.35 |
| 288,000 | KIRIN HOLDINGS CO LTD | 454,464,000 | 0.35 |
| 288,000 | KUBOTA CORP | 442,512,000 | 0.34 |
| 288,000 | MITSUBISHI LOGISTICS CORP | 425,664,000 | 0.32 |
| 288,000 | JTEKT CORP | 420,480,000 | 0.32 |
| 288,000 | ITOCHU CORP | 399,168,000 | 0.30 |
| 288,000 | KURARAY CO LTD | 396,288,000 | 0.30 |
| 288,000 | SUMITOMO ELECTRIC IND LTD | 394,272,000 | 0.30 |
| 288,000 | isetan MITSUKOSHI HOLDINGS LTD | 378,720,000 | 0.29 |
| 288,000 | YASKAWA ELECTRIC CORPORATION | 374,112,000 | 0.28 |
| 288,000 | SUMITOMO DAINIPPON PHARMA CO LTD | 373,248,000 | 0.28 |
| 288,000 | MITSUI & CO LTD | 372,960,000 | 0.28 |
| 288,000 | ODAKYU ELECTRIC RAILWAY CO LTD | 352,800,000 | 0.27 |
| 288,000 | HINO MOTORS LTD | 350,496,000 | 0.27 |
| 288,000 | NISSHINBO HOLDINGS INC | 344,160,000 | 0.26 |
| 288,000 | MITSUBISHI ELECTRIC CORP | 339,696,000 | 0.26 |
| 288,000 | YOKOGAWA ELECTRIC CORP | 334,944,000 | 0.25 |
| 288,000 | RICOH CO LTD | 330,048,000 | 0.25 |
| 288,000 | NIPPON KAYAKU CO LTD | 327,744,000 | 0.25 |
| 288,000 | SUMITOMO CORP | 322,128,000 | 0.24 |
| 288,000 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD | 321,840,000 | 0.24 |
| 288,000 | OBAYASHI CORP | 319,680,000 | 0.24 |
| 288,000 | AMADA HOLDINGS CO LTD | 316,224,000 | 0.24 |
| 288,000 | TAIYO YUDEN CO LTD | 316,224,000 | 0.24 |
| 288,000 | NISSAN MOTOR CO LTD | 299,952,000 | 0.23 |
| 288,000 | PANASONIC CORP | 297,648,000 | 0.23 |
| 288,000 | NSK LIMITED | 296,640,000 | 0.23 |

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|--------------------------------|-------------|----------|
| 288,000 | SHOWA SHELL SEKIYU KK | 290,880,000 | 0.22 |
| 288,000 | DAI NIPPON PRINTING CO LTD | 288,000,000 | 0.22 |
| 288,000 | KEIO CORP | 284,544,000 | 0.22 |
| 28,800 | EAST JAPAN RAILWAY CO | 279,734,400 | 0.21 |
| 57,600 | NIPPON TELG & TEL CORP NTT | 279,244,800 | 0.21 |
| 288,000 | TORAY INDUSTRIES INC | 276,249,600 | 0.21 |
| 288,000 | MATSUI SECURITIES CO LTD | 276,192,000 | 0.21 |
| 288,000 | KONICA MINOLTA INC | 275,328,000 | 0.21 |
| 288,000 | SHIMIZU CORP | 274,752,000 | 0.21 |
| 288,000 | TOPPAN PRINTING CO LTD | 271,872,000 | 0.21 |
| 288,000 | TOKYU CORP | 271,584,000 | 0.21 |
| 288,000 | TAKASHIMAYA CO LTD | 271,008,000 | 0.21 |
| 86,400 | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS | 270,950,400 | 0.21 |
| 288,000 | TAKARA HOLDINGS INC | 266,976,000 | 0.20 |
| 144,000 | YOKOHAMA RUBBER CO LTD | 266,544,000 | 0.20 |
| 288,000 | NICHIREI CORP | 263,808,000 | 0.20 |
| 288,000 | SCREEN HOLDINGS CO LTD | 256,320,000 | 0.19 |
| 288,000 | MINEBEA CO LTD | 252,864,000 | 0.19 |
| 432,000 | NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD | 248,832,000 | 0.19 |
| 288,000 | CHIYODA CORP | 237,600,000 | 0.18 |
| 288,000 | SHIZUOKA BANK LTD | 233,856,000 | 0.18 |
| 72,000 | SOMPO JAPAN NIPPONKOA HOLDINGS | 229,536,000 | 0.17 |
| 288,000 | UNY GROUP HOLDINGS CO LTD | 228,384,000 | 0.17 |
| 288,000 | OKUMA CORP | 226,656,000 | 0.17 |
| 288,000 | TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP | 220,032,000 | 0.17 |
| 288,000 | ASAHI KASEI CORPORATION | 219,139,200 | 0.17 |
| 144,000 | J.FRONT RETAILING CO LTD | 214,992,000 | 0.16 |
| 288,000 | TAISEI CORP | 214,272,000 | 0.16 |
| 288,000 | KAJIMA CORP | 203,328,000 | 0.15 |
| 144,000 | TOKYO TATEMONO CO LTD | 201,888,000 | 0.15 |
| 28,800 | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY | 200,131,200 | 0.15 |
| 288,000 | DAIWA SECURITIES GROUP INC | 199,382,400 | 0.15 |
| 288,000 | HOKUETSU KISHU PAPER CO LTD | 193,248,000 | 0.15 |
| 288,000 | CITIZEN HOLDINGS | 183,744,000 | 0.14 |
| 288,000 | DOWA HOLDINGS CO LTD | 180,576,000 | 0.14 |
| 288,000 | ASAHI GLASS CO LTD | 177,408,000 | 0.13 |
| 86,400 | DENA CO LTD | 167,529,600 | 0.13 |
| 144,000 | ISUZU MOTORS LTD | 167,328,000 | 0.13 |
| 288,000 | MARUBENI CORP | 164,160,000 | 0.12 |
| 288,000 | NIPPON SODA CO LTD | 163,296,000 | 0.12 |
| 288,000 | CHIBA BANK LTD | 161,568,000 | 0.12 |
| 288,000 | TOBU RAILWAY CO LTD | 161,568,000 | 0.12 |
| 288,000 | SAPPORO HOLDINGS LTD | 161,280,000 | 0.12 |
| 288,000 | NIPPON SUISAN KAISHA LTD | 157,536,000 | 0.12 |
| 288,000 | FUJIKURA LTD | 152,640,000 | 0.12 |
| 288,000 | HITACHI LTD | 151,660,800 | 0.12 |
| 288,000 | TOKYO GAS CO LTD | 151,113,600 | 0.11 |
| 288,000 | MITSUMI ELECTRIC CO LTD | 150,624,000 | 0.11 |
| 288,000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP | 150,192,000 | 0.11 |
| 288,000 | MEIDENSHA CORP | 147,744,000 | 0.11 |
| 288,000 | NIPPON EXPRESS | 147,456,000 | 0.11 |

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|-------------------------------------|-------------|----------|
| 288,000 | TOKYO DOME CORP | 146,880,000 | 0.11 |
| 288,000 | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD | 146,592,000 | 0.11 |
| 288,000 | NOMURA HOLDINGS INC | 144,835,200 | 0.11 |
| 288,000 | GS YUASA CORP | 138,528,000 | 0.11 |
| 288,000 | TOSOH CORP | 136,224,000 | 0.10 |
| 288,000 | EBARA CORP | 135,360,000 | 0.10 |
| 288,000 | SUMITOMO HEAVY IND | 133,920,000 | 0.10 |
| 288,000 | DENKA CO LTD | 133,344,000 | 0.10 |
| 288,000 | OJI HOLDINGS CORPORATION | 130,176,000 | 0.10 |
| 288,000 | SUMITOMO OSAKA CEMENT CO LTD | 127,296,000 | 0.10 |
| 288,000 | JX HOLDINGS INC | 124,934,400 | 0.09 |
| 288,000 | OSAKA GAS CO LTD | 124,531,200 | 0.09 |
| 288,000 | mitsubishi heavy ind ltd | 120,412,800 | 0.09 |
| 288,000 | FUJITSU LTD | 119,980,800 | 0.09 |
| 288,000 | AOZORA BANK LTD | 113,184,000 | 0.09 |
| 288,000 | TEIJIN LTD | 112,896,000 | 0.09 |
| 288,000 | FUJI ELECTRIC CO LTD | 112,032,000 | 0.09 |
| 288,000 | MITSUI CHEMICALS INC | 108,000,000 | 0.08 |
| 288,000 | FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC | 105,696,000 | 0.08 |
| 288,000 | NTN CORP | 103,392,000 | 0.08 |
| 288,000 | JAPAN STEEL WORKS LTD | 102,240,000 | 0.08 |
| 57,600 | MAZDA MOTOR CORP | 100,598,400 | 0.08 |
| 115,200 | INPEX CORP | 98,323,200 | 0.07 |
| 28,800 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | 98,265,600 | 0.07 |
| 288,000 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 94,924,800 | 0.07 |
| 288,000 | PACIFIC METAL CO LTD | 94,752,000 | 0.07 |
| 288,000 | KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES LTD | 93,600,000 | 0.07 |
| 288,000 | MITSUBISHI MATERIAL CORP | 91,584,000 | 0.07 |
| 288,000 | ANA HOLDINGS CO LTD | 91,324,800 | 0.07 |
| 288,000 | PIONEER CORP | 85,824,000 | 0.07 |
| 28,800 | TOHO CO LTD 9602 JP | 85,276,800 | 0.06 |
| 144,000 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 84,600,000 | 0.06 |
| 57,600 | SONY FINANCIAL HOLDING INC | 82,828,800 | 0.06 |
| 288,000 | TOHO ZINC CO LTD | 82,080,000 | 0.06 |
| 288,000 | NEC CORP | 81,504,000 | 0.06 |
| 288,000 | TOKAI CARBON CO LTD | 76,896,000 | 0.06 |
| 288,000 | TAIHEIYO CEMENT CORP | 74,592,000 | 0.06 |
| 28,800 | NTT DOCOMO | 73,512,000 | 0.06 |
| 288,000 | FURUKAWA ELECTRIC CO LTD | 69,984,000 | 0.05 |
| 288,000 | IHI CORPORATION | 68,544,000 | 0.05 |
| 288,000 | MITSUI O.S.K. LINES LTD | 65,952,000 | 0.05 |
| 288,000 | TOSHIBA CORP | 63,072,000 | 0.05 |
| 288,000 | KAWASAKI KISEN KAISHA LTD | 62,784,000 | 0.05 |
| 288,000 | NIPPON YUSEN KK | 62,496,000 | 0.05 |
| 28,800 | NIPPON STEEL & SUMITOMO METAL CORP | 62,265,600 | 0.05 |
| 57,600 | T&D HOLDINGS INC | 60,451,200 | 0.05 |
| 28,800 | MARUHA NICHIRO CORP | 60,451,200 | 0.05 |
| 57,600 | HASEKO CORP | 60,364,800 | 0.05 |
| 28,800 | NIPPON PAPER INDUSTRIES CO LTD | 57,686,400 | 0.04 |
| 288,000 | UBE INDUSTRIES LTD | 57,312,000 | 0.04 |
| 115,200 | YAHOO JAPAN CORP | 55,180,800 | 0.04 |

| 株数(株) | 銘柄 | 評価額 | 純資産比率(%) |
|---------|-----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| 288,000 | NIPPON LIGHT METAL HLDG CO LTD | 53,280,000 | 0.04 |
| 288,000 | MITSUI MINING & SMELTING CO LTD | 51,840,000 | 0.04 |
| 288,000 | TOKUYAMA CORP | 50,112,000 | 0.04 |
| 288,000 | TOYOBO COMPANY LIMITED | 48,672,000 | 0.04 |
| 288,000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC | 48,412,800 | 0.04 |
| 288,000 | MITSUI ENGINEERING & SHIPBUILDING | 48,384,000 | 0.04 |
| 288,000 | FURUKAWA CO | 47,808,000 | 0.04 |
| 288,000 | OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD | 45,792,000 | 0.03 |
| 28,800 | CHUBU ELEC POWER CO INC | 45,259,200 | 0.03 |
| 28,800 | JFE HOLDINGS INC | 43,660,800 | 0.03 |
| 288,000 | SHINSEI BANK LTD | 42,336,000 | 0.03 |
| 28,800 | DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD | 39,240,000 | 0.03 |
| 28,800 | NISSHIN STEEL CO LTD | 37,814,400 | 0.03 |
| 288,000 | SHARP CORP | 37,152,000 | 0.03 |
| 288,000 | SHOWA DENKO KK | 33,408,000 | 0.03 |
| 57,600 | HITACHI ZOSEN CORPORATION | 30,758,400 | 0.02 |
| 28,800 | KANSAI ELECTRIC POWER CO INC | 28,704,960 | 0.02 |
| 288,000 | KOBE STEEL LTD | 28,512,000 | 0.02 |
| 28,800 | mitsubishi MOTORS CORP | 24,278,400 | 0.02 |
| 288,000 | NIPPON SHEET GLASS CO LTD | 23,040,000 | 0.02 |
| 28,800 | SUMCO CORP | 20,390,400 | 0.02 |
| 28,800 | SKY PERFECT JSAT HOLDINGS INC | 18,864,000 | 0.01 |
| 28,800 | TOKYO ELEC POWER CO HLDGS INC | 17,827,200 | 0.01 |
| 288,000 | UNITIKA LTD | 15,552,000 | 0.01 |
| 28,800 | RESONA HOLDINGS INC | 11,566,080 | 0.01 |
| 28,800 | SOJITZ CORPORATION | 6,652,800 | 0.01 |
| | | <u>122,892,258,240</u> | <u>93.41</u> |
| | 日本計 | <u>122,892,258,240</u> | <u>93.41</u> |
| | 組入資産合計 | <u>122,892,258,240</u> | <u>93.41</u> |

外国為替先渡し契約

2016年3月31日現在

| | 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--|--------|---------------|--------|----------------|----------------|---------------|
| | JPY | 3,700,000 | USD | 32,501 | April 08, 2016 | 46,312 |
| | JPY | 8,350,000 | USD | 73,348 | April 08, 2016 | 104,516 |
| | JPY | 50,000 | TRY | 1,296 | April 08, 2016 | (1,285) |
| | JPY | 250,000 | TRY | 6,478 | April 08, 2016 | (6,423) |
| | JPY | 2,800,000 | MXN | 440,978 | April 08, 2016 | (68,075) |
| | JPY | 200,000 | MXN | 31,498 | April 08, 2016 | (4,862) |
| | JPY | 5,300,000 | AUD | 63,782 | April 08, 2016 | (176,710) |
| | AUD | 24,178,537 | JPY | 2,022,450,020 | April 08, 2016 | 53,652,881 |
| | EUR | 373,100 | JPY | 46,433,122 | April 08, 2016 | 1,157,566 |
| | TRY | 9,010,531 | JPY | 347,514,557 | April 08, 2016 | 9,163,527 |
| | USD | 438,848,160 | JPY | 49,893,612,816 | April 08, 2016 | (559,978,776) |
| | MXN | 1,160,359,169 | JPY | 7,378,480,282 | April 08, 2016 | 168,367,863 |
| | JPY | 99,350,000 | USD | 874,754 | April 08, 2016 | 1,013,475 |
| | JPY | 86,750,000 | USD | 763,814 | April 08, 2016 | 884,942 |
| | JPY | 150,000 | TRY | 3,888 | April 08, 2016 | (3,910) |
| | JPY | 50,000 | TRY | 1,296 | April 08, 2016 | (1,304) |
| | JPY | 4,650,000 | MXN | 736,316 | April 08, 2016 | (138,915) |
| | JPY | 1,800,000 | MXN | 285,025 | April 08, 2016 | (53,774) |
| | JPY | 900,000 | AUD | 10,763 | April 08, 2016 | (24,160) |
| | JPY | 600,000 | AUD | 7,175 | April 08, 2016 | (16,107) |
| | JPY | 11,200,000 | USD | 98,837 | April 08, 2016 | 89,140 |
| | JPY | 72,500,000 | USD | 639,792 | April 08, 2016 | 577,020 |
| | JPY | 1,150,000 | TRY | 29,979 | April 08, 2016 | (36,716) |
| | JPY | 50,000 | TRY | 1,303 | April 08, 2016 | (1,597) |
| | JPY | 4,350,000 | MXN | 687,913 | April 08, 2016 | (124,111) |
| | JPY | 750,000 | MXN | 118,606 | April 08, 2016 | (21,398) |
| | JPY | 50,000 | EUR | 402 | April 08, 2016 | (1,320) |
| | JPY | 2,350,000 | AUD | 28,063 | April 08, 2016 | (59,665) |
| | JPY | 650,000 | AUD | 7,762 | April 08, 2016 | (16,503) |
| | JPY | 11,854,125 | USD | 104,994 | April 08, 2016 | 51,083 |
| | JPY | 26,013,265 | USD | 230,404 | April 08, 2016 | 112,098 |
| | JPY | 7,765 | EUR | 62 | April 08, 2016 | (188) |
| | JPY | 24,175 | EUR | 194 | April 08, 2016 | (585) |
| | JPY | 1,240,775 | TRY | 32,420 | April 08, 2016 | (42,558) |
| | JPY | 615,175 | TRY | 16,074 | April 08, 2016 | (21,100) |
| | JPY | 1,738,220 | AUD | 20,758 | April 08, 2016 | (44,211) |
| | JPY | 2,006,610 | AUD | 23,964 | April 08, 2016 | (51,038) |
| | JPY | 14,814,120 | MXN | 2,349,708 | April 08, 2016 | (468,120) |
| | JPY | 8,246,445 | MXN | 1,307,991 | April 08, 2016 | (260,584) |
| | JPY | 47,250,000 | USD | 418,502 | April 08, 2016 | 203,614 |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|----------------|--------|---------------|----------------|--------------|
| JPY | 52,750,000 | USD | 467,216 | April 08, 2016 | 227,315 |
| JPY | 8,400,000 | MXN | 1,332,347 | April 08, 2016 | (265,436) |
| JPY | 5,750,000 | MXN | 912,023 | April 08, 2016 | (181,698) |
| JPY | 100,000 | AUD | 1,194 | April 08, 2016 | (2,543) |
| JPY | 100,000 | AUD | 1,194 | April 08, 2016 | (2,543) |
| JPY | 5,700,000 | USD | 50,702 | April 08, 2016 | 329 |
| JPY | 27,300,000 | USD | 242,834 | April 08, 2016 | 1,573 |
| TRY | 1,304 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 1,632 |
| TRY | 1,304 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 1,632 |
| JPY | 1,200,000 | MXN | 191,245 | April 08, 2016 | (43,838) |
| JPY | 400,000 | MXN | 63,748 | April 08, 2016 | (14,613) |
| EUR | 405 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 1,637 |
| JPY | 13,250,000 | USD | 116,920 | April 08, 2016 | 106,349 |
| JPY | 26,000,000 | USD | 229,427 | April 08, 2016 | 208,684 |
| TRY | 12,845 | JPY | 500,000 | April 08, 2016 | 8,451 |
| JPY | 100,000 | TRY | 2,569 | April 08, 2016 | (1,690) |
| MXN | 931,105 | JPY | 5,950,000 | April 08, 2016 | 105,803 |
| JPY | 2,250,000 | MXN | 352,098 | April 08, 2016 | (40,010) |
| AUD | 11,794 | JPY | 1,000,000 | April 08, 2016 | 12,693 |
| JPY | 400,000 | AUD | 4,718 | April 08, 2016 | (5,078) |
| INR | 2,123,000,000 | JPY | 3,564,374,759 | April 27, 2016 | 19,021,845 |
| CNY | 26,300,000 | JPY | 457,432,612 | April 27, 2016 | (1,050,101) |
| IDR | 82,700,000,000 | JPY | 713,750,620 | April 27, 2016 | (16,650,857) |
| CNY | 2,000,000 | JPY | 34,860,300 | April 27, 2016 | (154,406) |
| RUB | 493,662,669 | JPY | 790,186,088 | April 20, 2016 | 22,811,911 |
| JPY | 54,950,000 | USD | 483,197 | April 08, 2016 | 630,789 |
| JPY | 10,600,000 | USD | 93,210 | April 08, 2016 | 121,681 |
| RUB | 61,989 | JPY | 100,000 | April 20, 2016 | 2,087 |
| JPY | 500,000 | RUB | 309,943 | April 20, 2016 | (10,436) |
| JPY | 10,000,000 | MXN | 1,559,519 | April 08, 2016 | (142,942) |
| JPY | 750,000 | MXN | 116,964 | April 08, 2016 | (10,721) |
| AUD | 1,172 | JPY | 100,000 | April 08, 2016 | 624 |
| JPY | 450,000 | AUD | 5,273 | April 08, 2016 | (2,808) |
| USD | 22,626,824 | JPY | 2,572,135,203 | April 08, 2016 | (28,514,017) |
| AUD | 1,181,354 | JPY | 100,896,505 | April 08, 2016 | 541,047 |
| RUB | 21,876,405 | JPY | 35,228,909 | April 20, 2016 | 798,675 |
| EUR | 14,013 | JPY | 1,772,337 | April 08, 2016 | 15,099 |
| MXN | 57,778,410 | JPY | 369,749,471 | April 08, 2016 | 6,034,942 |
| TRY | 452,104 | JPY | 17,724,878 | April 08, 2016 | 171,483 |
| JPY | 26,700,000 | USD | 235,166 | April 08, 2016 | 263,542 |
| JPY | 37,150,000 | USD | 327,207 | April 08, 2016 | 366,689 |
| JPY | 50,000 | TRY | 1,280 | April 08, 2016 | (655) |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|---------------|--------|----------------|----------------|---------------|
| JPY | 100,000 | RUB | 62,512 | April 20, 2016 | (2,949) |
| JPY | 200,000 | RUB | 125,023 | April 20, 2016 | (5,897) |
| JPY | 11,800,000 | MXN | 1,847,982 | April 08, 2016 | (219,074) |
| JPY | 10,900,000 | MXN | 1,707,035 | April 08, 2016 | (202,365) |
| JPY | 150,000 | AUD | 1,752 | April 08, 2016 | (466) |
| JPY | 300,000 | AUD | 3,505 | April 08, 2016 | (931) |
| INR | 160,000,000 | JPY | 266,894,880 | April 27, 2016 | 3,167,982 |
| JPY | 20,750,000 | USD | 183,669 | April 08, 2016 | 102,583 |
| JPY | 41,750,000 | USD | 369,552 | April 08, 2016 | 206,403 |
| JPY | 20,750,000 | USD | 183,723 | April 20, 2016 | 103,107 |
| JPY | 41,750,000 | USD | 369,660 | April 20, 2016 | 207,457 |
| JPY | 50,000 | TRY | 1,286 | April 08, 2016 | (892) |
| JPY | 50,000 | TRY | 1,290 | April 20, 2016 | (876) |
| JPY | 6,250,000 | MXN | 990,699 | April 08, 2016 | (193,396) |
| JPY | 900,000 | MXN | 142,661 | April 08, 2016 | (27,849) |
| JPY | 6,250,000 | MXN | 991,974 | April 20, 2016 | (192,287) |
| JPY | 900,000 | MXN | 142,844 | April 20, 2016 | (27,689) |
| JPY | 50,000 | EUR | 399 | April 08, 2016 | (851) |
| JPY | 50,000 | EUR | 399 | April 20, 2016 | (850) |
| JPY | 100,000 | AUD | 1,186 | April 08, 2016 | (1,804) |
| JPY | 100,000 | AUD | 1,186 | April 08, 2016 | (1,804) |
| JPY | 100,000 | AUD | 1,187 | April 20, 2016 | (1,793) |
| JPY | 100,000 | AUD | 1,187 | April 20, 2016 | (1,793) |
| AUD | 24,953,359 | JPY | 2,110,684,831 | April 20, 2016 | 30,084,296 |
| EUR | 179,567 | JPY | 22,615,831 | April 20, 2016 | 289,496 |
| TRY | 9,311,953 | JPY | 360,100,671 | April 20, 2016 | 7,105,413 |
| USD | 452,623,380 | JPY | 51,358,088,649 | April 20, 2016 | (492,049,968) |
| MXN | 1,174,530,556 | JPY | 7,404,910,105 | April 20, 2016 | 222,974,058 |
| JPY | 56,450,000 | USD | 497,375 | April 08, 2016 | 537,049 |
| JPY | 104,550,000 | USD | 921,178 | April 08, 2016 | 994,661 |
| JPY | 56,450,000 | USD | 497,559 | April 20, 2016 | 534,061 |
| JPY | 104,550,000 | USD | 921,520 | April 20, 2016 | 989,125 |
| JPY | 150,000 | TRY | 3,864 | April 08, 2016 | (2,956) |
| JPY | 150,000 | TRY | 3,876 | April 20, 2016 | (2,860) |
| JPY | 100,000 | RUB | 63,115 | April 20, 2016 | (3,943) |
| JPY | 600,000 | RUB | 378,692 | April 20, 2016 | (23,657) |
| JPY | 2,850,000 | MXN | 450,245 | April 08, 2016 | (78,342) |
| JPY | 3,350,000 | MXN | 529,235 | April 08, 2016 | (92,086) |
| JPY | 2,850,000 | MXN | 450,843 | April 20, 2016 | (77,961) |
| JPY | 3,350,000 | MXN | 529,938 | April 20, 2016 | (91,638) |
| JPY | 150,000 | AUD | 1,774 | April 08, 2016 | (2,334) |
| JPY | 1,450,000 | AUD | 17,150 | April 08, 2016 | (22,565) |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|------------|--------|---------------|----------------|------------|
| JPY | 150,000 | AUD | 1,775 | April 20, 2016 | (2,279) |
| JPY | 1,450,000 | AUD | 17,158 | April 20, 2016 | (22,031) |
| JPY | 45,700,000 | USD | 411,127 | April 08, 2016 | (517,278) |
| JPY | 33,300,000 | USD | 299,574 | April 08, 2016 | (376,922) |
| JPY | 45,700,000 | USD | 411,253 | April 20, 2016 | (516,824) |
| JPY | 33,300,000 | USD | 299,666 | April 20, 2016 | (376,592) |
| TRY | 1,290 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 1,081 |
| TRY | 1,296 | JPY | 50,000 | April 20, 2016 | 1,092 |
| RUB | 9,478,608 | JPY | 15,300,000 | April 20, 2016 | 310,031 |
| RUB | 61,952 | JPY | 100,000 | April 20, 2016 | 2,026 |
| MXN | 94,488 | JPY | 600,000 | April 08, 2016 | 14,541 |
| JPY | 1,100,000 | MXN | 173,228 | April 08, 2016 | (26,658) |
| MXN | 94,609 | JPY | 600,000 | April 20, 2016 | 14,429 |
| JPY | 1,100,000 | MXN | 173,450 | April 20, 2016 | (26,453) |
| AUD | 1,767 | JPY | 150,000 | April 08, 2016 | 1,709 |
| AUD | 3,534 | JPY | 300,000 | April 08, 2016 | 3,419 |
| AUD | 1,769 | JPY | 150,000 | April 20, 2016 | 1,722 |
| AUD | 3,537 | JPY | 300,000 | April 20, 2016 | 3,445 |
| BRL | 27,529,247 | JPY | 836,817,265 | May 06, 2016 | 15,983,532 |
| JPY | 48,550,000 | USD | 436,686 | April 08, 2016 | (540,528) |
| JPY | 76,600,000 | USD | 688,983 | April 08, 2016 | (852,822) |
| JPY | 48,550,000 | USD | 436,814 | April 20, 2016 | (539,338) |
| JPY | 76,600,000 | USD | 689,185 | April 20, 2016 | (850,942) |
| TRY | 1,293 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 1,173 |
| TRY | 1,298 | JPY | 50,000 | April 20, 2016 | 1,179 |
| RUB | 62,147 | JPY | 100,000 | April 20, 2016 | 2,347 |
| JPY | 100,000 | RUB | 62,147 | April 20, 2016 | (2,347) |
| MXN | 15,655 | JPY | 100,000 | April 08, 2016 | 1,820 |
| JPY | 6,050,000 | MXN | 947,141 | April 08, 2016 | (110,103) |
| MXN | 15,676 | JPY | 100,000 | April 20, 2016 | 1,804 |
| JPY | 6,050,000 | MXN | 948,374 | April 20, 2016 | (109,127) |
| AUD | 590 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 686 |
| JPY | 3,650,000 | AUD | 43,091 | April 08, 2016 | (50,068) |
| AUD | 591 | JPY | 50,000 | April 20, 2016 | 693 |
| JPY | 3,650,000 | AUD | 43,135 | April 20, 2016 | (50,584) |
| BRL | 39,565 | JPY | 1,200,000 | May 06, 2016 | 25,657 |
| BRL | 13,188 | JPY | 400,000 | May 06, 2016 | 8,552 |
| BRL | 49,823,395 | JPY | 1,509,371,338 | May 06, 2016 | 34,057,373 |
| BRL | 27,541,889 | JPY | 839,886,319 | May 06, 2016 | 13,306,089 |
| EUR | 400 | JPY | 50,000 | April 08, 2016 | 1,014 |
| EUR | 800 | JPY | 100,000 | April 08, 2016 | 2,029 |
| EUR | 400 | JPY | 50,000 | April 20, 2016 | 1,012 |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|-------------|--------|---------------|----------------|-----------|
| EUR | 800 | JPY | 100,000 | April 20, 2016 | 2,024 |
| AUD | 30,093 | JPY | 2,550,000 | April 08, 2016 | 33,947 |
| AUD | 62,546 | JPY | 5,300,000 | April 08, 2016 | 70,557 |
| AUD | 30,118 | JPY | 2,550,000 | April 20, 2016 | 33,871 |
| AUD | 62,599 | JPY | 5,300,000 | April 20, 2016 | 70,398 |
| USD | 726,935 | JPY | 81,150,000 | April 08, 2016 | 569,203 |
| USD | 997,016 | JPY | 111,300,000 | April 08, 2016 | 780,681 |
| USD | 727,143 | JPY | 81,150,000 | April 20, 2016 | 566,688 |
| USD | 997,301 | JPY | 111,300,000 | April 20, 2016 | 777,231 |
| TRY | 33,641 | JPY | 1,300,000 | April 08, 2016 | 31,672 |
| TRY | 14,233 | JPY | 550,000 | April 08, 2016 | 13,399 |
| TRY | 33,763 | JPY | 1,300,000 | April 20, 2016 | 31,412 |
| TRY | 14,284 | JPY | 550,000 | April 20, 2016 | 13,290 |
| RUB | 5,498,991 | JPY | 9,000,000 | April 20, 2016 | 56,120 |
| RUB | 1,160,898 | JPY | 1,900,000 | April 20, 2016 | 11,848 |
| MXN | 3,455,777 | JPY | 22,150,000 | April 08, 2016 | 325,993 |
| MXN | 2,558,679 | JPY | 16,400,000 | April 08, 2016 | 241,367 |
| MXN | 3,460,047 | JPY | 22,150,000 | April 20, 2016 | 320,964 |
| MXN | 2,561,840 | JPY | 16,400,000 | April 20, 2016 | 237,644 |
| BRL | 750,621 | JPY | 22,800,000 | May 06, 2016 | 452,741 |
| BRL | 207,409 | JPY | 6,300,000 | May 06, 2016 | 125,099 |
| BRL | 33,105,161 | JPY | 1,017,583,785 | May 06, 2016 | 7,947,618 |
| JPY | 6,100,000 | AUD | 71,578 | April 20, 2016 | (40,753) |
| JPY | 5,050,000 | AUD | 59,257 | April 20, 2016 | (33,738) |
| JPY | 180,600,000 | USD | 1,603,911 | April 08, 2016 | 294,413 |
| JPY | 236,500,000 | USD | 2,100,360 | April 08, 2016 | 385,541 |
| JPY | 180,600,000 | USD | 1,604,382 | April 20, 2016 | 298,816 |
| JPY | 236,500,000 | USD | 2,100,976 | April 20, 2016 | 391,307 |
| JPY | 1,800,000 | TRY | 46,135 | April 08, 2016 | (26,253) |
| JPY | 550,000 | TRY | 14,097 | April 08, 2016 | (8,022) |
| JPY | 1,800,000 | TRY | 46,307 | April 20, 2016 | (26,077) |
| JPY | 550,000 | TRY | 14,149 | April 20, 2016 | (7,968) |
| JPY | 1,500,000 | RUB | 909,733 | April 20, 2016 | 1,788 |
| JPY | 1,900,000 | RUB | 1,152,329 | April 20, 2016 | 2,265 |
| JPY | 43,200,000 | MXN | 6,673,791 | April 08, 2016 | (205,598) |
| JPY | 22,750,000 | MXN | 3,514,554 | April 08, 2016 | (108,272) |
| JPY | 43,200,000 | MXN | 6,682,909 | April 20, 2016 | (201,557) |
| JPY | 22,750,000 | MXN | 3,519,356 | April 20, 2016 | (106,144) |
| JPY | 50,000 | EUR | 397 | April 08, 2016 | (604) |
| JPY | 100,000 | EUR | 793 | April 08, 2016 | (1,207) |
| JPY | 50,000 | EUR | 397 | April 20, 2016 | (603) |
| JPY | 100,000 | EUR | 793 | April 20, 2016 | (1,204) |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|-------------|--------|-------------|----------------|------------|
| JPY | 6,100,000 | AUD | 71,518 | April 08, 2016 | (40,912) |
| JPY | 5,050,000 | AUD | 59,207 | April 08, 2016 | (33,870) |
| BRL | 1,745,779 | JPY | 53,800,000 | May 06, 2016 | 280,740 |
| JPY | 31,700,000 | BRL | 1,028,647 | May 06, 2016 | (165,417) |
| BRL | 26,279,812 | JPY | 789,498,895 | May 06, 2016 | 24,596,902 |
| JPY | 50,000 | TRY | 1,289 | April 20, 2016 | (818) |
| JPY | 200,000 | RUB | 124,089 | April 20, 2016 | (4,359) |
| JPY | 100,000 | RUB | 62,045 | April 20, 2016 | (2,180) |
| JPY | 2,200,000 | MXN | 345,690 | April 08, 2016 | (48,329) |
| JPY | 3,750,000 | MXN | 589,244 | April 08, 2016 | (82,379) |
| JPY | 2,200,000 | MXN | 346,160 | April 20, 2016 | (48,103) |
| JPY | 3,750,000 | MXN | 590,045 | April 20, 2016 | (81,993) |
| AUD | 166,910 | JPY | 14,100,000 | April 08, 2016 | 231,852 |
| JPY | 200,000 | AUD | 2,368 | April 08, 2016 | (3,288) |
| JPY | 62,800,000 | USD | 557,451 | April 08, 2016 | 133,539 |
| JPY | 70,950,000 | USD | 629,795 | April 08, 2016 | 150,870 |
| JPY | 62,800,000 | USD | 557,614 | April 20, 2016 | 135,079 |
| JPY | 70,950,000 | USD | 629,979 | April 20, 2016 | 152,609 |
| JPY | 50,000 | TRY | 1,284 | April 08, 2016 | (826) |
| AUD | 167,053 | JPY | 14,100,000 | April 20, 2016 | 231,599 |
| JPY | 200,000 | AUD | 2,370 | April 20, 2016 | (3,285) |
| JPY | 900,000 | BRL | 29,936 | May 06, 2016 | (27,346) |
| JPY | 300,000 | BRL | 9,979 | May 06, 2016 | (9,115) |
| BRL | 32,385 | JPY | 1,000,000 | May 06, 2016 | 3,219 |
| BRL | 6,477 | JPY | 200,000 | May 06, 2016 | 644 |
| JPY | 88,200,000 | USD | 777,210 | April 08, 2016 | 829,028 |
| JPY | 139,300,000 | USD | 1,227,498 | April 08, 2016 | 1,309,337 |
| JPY | 88,200,000 | USD | 777,424 | April 20, 2016 | 832,669 |
| JPY | 139,300,000 | USD | 1,227,837 | April 20, 2016 | 1,315,089 |
| JPY | 500,000 | TRY | 12,664 | April 08, 2016 | (1,286) |
| JPY | 500,000 | TRY | 12,711 | April 20, 2016 | (1,250) |
| RUB | 121,692 | JPY | 200,000 | April 20, 2016 | 410 |
| JPY | 450,000 | MXN | 69,353 | April 08, 2016 | (1,064) |
| JPY | 3,300,000 | MXN | 508,588 | April 08, 2016 | (7,801) |
| JPY | 450,000 | MXN | 69,447 | April 20, 2016 | (1,020) |
| JPY | 3,300,000 | MXN | 509,280 | April 20, 2016 | (7,476) |
| AUD | 4,097 | JPY | 350,000 | April 08, 2016 | 1,754 |
| AUD | 1,756 | JPY | 150,000 | April 08, 2016 | 752 |
| AUD | 4,100 | JPY | 350,000 | April 20, 2016 | 1,742 |
| AUD | 1,757 | JPY | 150,000 | April 20, 2016 | 746 |
| JPY | 7,000,000 | BRL | 228,424 | May 06, 2016 | (76,124) |
| JPY | 2,350,000 | USD | 20,944 | April 08, 2016 | (4,459) |

| 通貨(買い) | | 通貨(売り) | | 満期 | 未実現損益(円) |
|--------|------------|--------|---------|----------------|----------------------|
| JPY | 35,300,000 | USD | 314,608 | April 08, 2016 | (66,980) |
| JPY | 2,350,000 | USD | 20,950 | April 20, 2016 | (4,411) |
| JPY | 35,300,000 | USD | 314,701 | April 20, 2016 | (66,248) |
| TRY | 2,535 | JPY | 100,000 | April 08, 2016 | 350 |
| JPY | 2,600,000 | TRY | 65,912 | April 08, 2016 | (9,095) |
| TRY | 2,544 | JPY | 100,000 | April 20, 2016 | 337 |
| JPY | 2,600,000 | TRY | 66,156 | April 20, 2016 | (8,766) |
| RUB | 121,080 | JPY | 200,000 | April 20, 2016 | (597) |
| JPY | 1,550,000 | MXN | 239,130 | April 08, 2016 | (5,276) |
| JPY | 1,550,000 | MXN | 239,459 | April 20, 2016 | (5,144) |
| AUD | 5,816 | JPY | 500,000 | April 08, 2016 | (616) |
| AUD | 5,821 | JPY | 500,000 | April 20, 2016 | (611) |
| | | | | | (446,387,744) |

先物取引契約

2016年3月31日現在

| 通貨 | 契約数 | 銘柄 | 満期 | 評価額(円) | 未実現損益(円) |
|----------------|-----|--------------------|-----------|--------------------|-------------|
| 買建ポジション | | | | | |
| JPY | 530 | FUT NIKKEI 225 OSE | June 2016 | 8,882,800,000 | 126,670,000 |
| | | | | 8,882,800,000 | 126,670,000 |
| | | | | 126,670,000 | |

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年8月19日）

作成対象期間（2015年8月20日～2016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 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純総資産額 |
|-----------------|--------|-----|-----|-------|--------|--------|
| | | 期騰 | 落中率 | | | |
| | 円 | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 14期(2016年8月19日) | 10,211 | | 0.0 | 68.6 | — | 19,722 |

*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

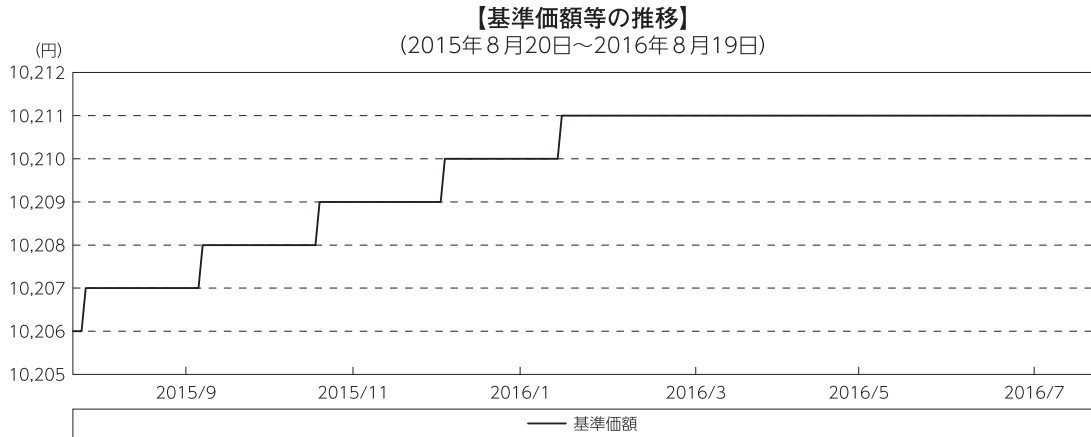
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 債券率 |
|--------------------|-------------|-----|----------|-------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落率 | | | |
| (期首) 2015年8月19日 | 円 10,206 | | % — | | % 44.7 | % — |
| 8月末 | 10,207 | | 0.0 | | 48.6 | — |
| 9月末 | 10,207 | | 0.0 | | 43.6 | — |
| 10月末 | 10,208 | | 0.0 | | 44.4 | — |
| 11月末 | 10,209 | | 0.0 | | 48.8 | — |
| 12月末 | 10,209 | | 0.0 | | 48.5 | — |
| 2016年1月末 | 10,210 | | 0.0 | | 51.8 | — |
| 2月末 | 10,211 | | 0.0 | | 49.1 | — |
| 3月末 | 10,211 | | 0.0 | | 40.8 | — |
| 4月末 | 10,211 | | 0.0 | | 39.9 | — |
| 5月末 | 10,211 | | 0.0 | | 62.4 | — |
| 6月末 | 10,211 | | 0.0 | | 58.0 | — |
| 7月末 | 10,211 | | 0.0 | | 65.1 | — |
| (期末) 2016年8月19日 | 円 10,211 | | % 0.0 | | % 68.6 | % — |

*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等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

国内経済は、足許の企業収益に弱さがみられるものの、企業収益の水準としては依然として高水準にある事や雇用環境の改善などを受け、基調としては緩やかな回復を続けました。しかしながら、新興国を中心とした海外経済には弱さが見られ、また個人消費の不振が長引く中で物価見通しについても低下するなど、国内経済の下押しリスクがより認識されるようになりました。

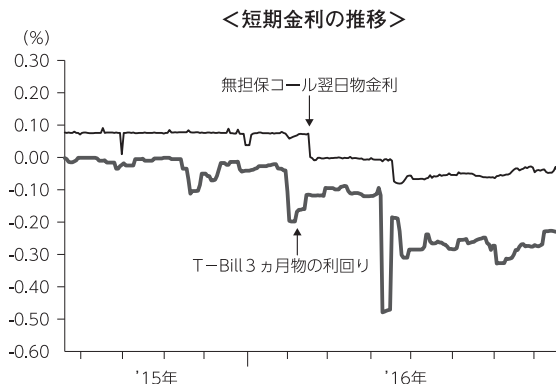
このような中、日本銀行は「量的・質的金融緩和」を継続し、2016年1月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定するなど、一層の金融緩和を図りました。

・無担保コール翌日物金利の推移

2016年2月半ば頃まで概ね0.07%台で推移しました。日本銀行当座預金の一部へのマイナス金利の適用が開始された2月16日以降は、概ねゼロ%近傍のマイナス圏で推移しました。無担保コール取引による資金の運用ニーズが高まった4月18日以降、そのマイナス幅は深まりました。

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

日本銀行による買入や海外からの資金流入に伴う需給ひっ迫などにより、期を通じて利回りはマイナス圏で推移しました。日本銀行がマイナス金利導入を決定した2016年1月末以降、利回りは低下し、4月以降についてはマイナス幅が一段と深まりました。



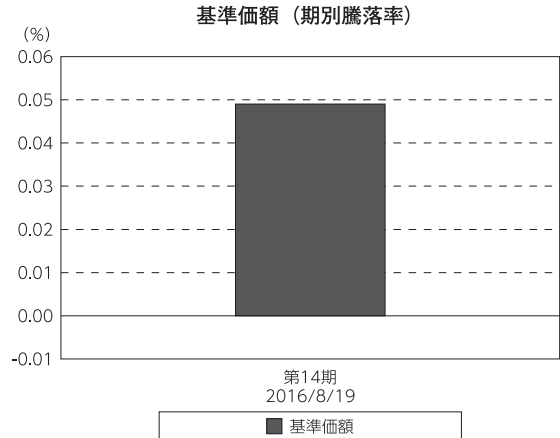
○当ファンドのポートフォリオ

- (1) 残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー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、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図るという方針のもと、運用してまいりました。
- (2) 今期の運用につきましては、残存期間の短い高格付けの公社債等によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローン等により運用してまいりました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、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、あわせて債券現先取引やコール・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してまいります。

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

(2015年8月20日～2016年8月19日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|---------------|-----------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 円 0 (0) | % 0.001 (0.001) | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 0 | 0.001 | |
| 期中の平均基準価額は、10,209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

(2015年8月20日～2016年8月19日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|----------------|------------|---------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 42,008,214 | 38,608,278 (4,580,000) |
| | 地方債証券 | 8,739,283 | — (7,094,300) |
| 内 | 特殊債券 | 18,846,302 | — (15,866,000) |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 3,709,487 | — (3,400,000) |

*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 |
|--------|-------------|-----------|------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | コマーシャル・ペーパー | 5,898,732 | — (7,200,000) |

*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

(2015年8月20日～2016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 | 34,695 | 4,630 | 13.3 | — | — | — |
| 預金 | 231,734 | 231,734 | 100.0 | 231,734 | 231,734 | 100.0 |

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016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 | 2,898,010 | 2,904,779 | 14.7 | — | — | — | 14.7 |
| | (2,898,010) | (2,904,779) | (14.7) | (—) | (—) | (—) | (14.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 5,325,000 | 5,333,466 | 27.0 | — | — | — | 27.0 |
| | (5,325,000) | (5,333,466) | (27.0) | (—) | (—) | (—) | (27.0) |
| 金融債券 | 3,780,000 | 3,783,502 | 19.2 | — | — | — | 19.2 |
| | (3,780,000) | (3,783,502) | (19.2) | (—) | (—) | (—) | (19.2) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1,500,000 | 1,501,704 | 7.6 | — | — | — | 7.6 |
| | (1,500,000) | (1,501,704) | (7.6) | (—) | (—) | (—) | (7.6) |
| 合 計 | 13,503,010 | 13,523,452 | 68.6 | — | — | — | 68.6 |
| | (13,503,010) | (13,523,452) | (68.6) | (—) | (—) | (—) | (68.6) |

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当 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 | |
| 東京都 公募第637回 | 1.81 | 200,000 | 200,273 | 2016/9/20 |
| 東京都 公募第638回 | 1.9 | 600,000 | 600,929 | 2016/9/20 |
| 北海道 公募平成18年度第7回 | 2.0 | 1,500 | 1,505 | 2016/10/31 |
| 北海道 公募平成18年度第10回 | 1.9 | 200,000 | 201,375 | 2016/12/28 |
| 北海道 公募(5年)平成23年度第12回 | 0.38 | 5,000 | 5,007 | 2017/1/31 |
| 北海道 公募(5年)平成23年度第14回 | 0.35 | 200,000 | 200,477 | 2017/3/23 |
| 神奈川県 公募第143回 | 1.77 | 100,000 | 100,596 | 2016/12/20 |
| 神奈川県 公募(5年)第49回 | 0.37 | 101,700 | 101,728 | 2016/9/20 |
| 大阪府 公募第294回 | 2.0 | 12,000 | 12,024 | 2016/9/28 |
| 大阪府 公募第295回 | 1.9 | 1,000 | 1,003 | 2016/10/28 |
| 大阪府 公募(5年)第77回 | 0.42 | 100,000 | 100,071 | 2016/10/28 |
| 兵庫県 公募平成18年度第8回 | 2.1 | 200,000 | 200,060 | 2016/8/24 |
| 埼玉県 公募(5年)平成23年度第5回 | 0.41 | 200,000 | 200,098 | 2016/9/29 |
| 福岡県 公募平成18年度第3回 | 1.9 | 1,000 | 1,003 | 2016/10/31 |
| 千葉県 公募平成18年度第4回 | 1.8 | 8,600 | 8,626 | 2016/10/25 |
| 群馬県 公募第3回 | 1.9 | 9,000 | 9,042 | 2016/11/25 |
| 大分県 公募平成18年度第1回 | 1.8 | 198,000 | 198,709 | 2016/10/31 |
| 共同発行市場地方債 公募第41回 | 2.0 | 6,000 | 6,001 | 2016/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第43回 | 1.8 | 4,000 | 4,012 | 2016/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第44回 | 1.8 | 100,000 | 100,476 | 2016/11/25 |
| 島根県 公募平成23年度第1回 | 0.38 | 2,500 | 2,502 | 2016/11/25 |
| 熊本県 公募平成18年度第2回 | 1.8 | 7,500 | 7,524 | 2016/10/27 |
| 名古屋市 公募第456回 | 1.82 | 16,000 | 16,024 | 2016/9/20 |
| 京都市 公募平成23年度第3回 | 0.364 | 4,000 | 4,001 | 2016/9/29 |
| 横浜市 公募平成18年度第3回 | 1.87 | 200,000 | 201,260 | 2016/12/20 |
| 札幌市 公募(5年)平成23年度第5回 | 0.4 | 12,900 | 12,903 | 2016/9/20 |
| 川崎市 公募(5年)第29回 | 0.36 | 12,200 | 12,203 | 2016/9/20 |
| 川崎市 公募(5年)第31回 | 0.27 | 2,000 | 2,002 | 2017/3/17 |
| 北九州市 公募(5年)平成23年度第1回 | 0.36 | 7,000 | 7,002 | 2016/9/28 |
| 福岡市 公募平成23年度第3回 | 0.39 | 300,000 | 300,041 | 2016/8/26 |
| 広島市 公募平成18年度第1回 | 1.82 | 6,000 | 6,037 | 2016/12/26 |
| 仙台市 公募平成23年度第1回 | 0.36 | 59,410 | 59,484 | 2017/1/27 |
| さいたま市 公募第4回 | 1.8 | 5,000 | 5,030 | 2016/12/26 |
| 鹿児島県 公募平成18年度第1回 | 1.9 | 7,200 | 7,226 | 2016/10/31 |
| 鹿児島県 公募(5年)平成23年度第1回 | 0.37 | 8,500 | 8,505 | 2016/10/31 |
| 小 計 | | 2,898,010 | 2,904,779 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | |
| 政保 地方公共団体金融機構債券(4年)第2回 | 0.13 | 200,000 | 200,017 | 2016/8/30 |
| 日本政策投資銀行債券 政府保証第13回 | 2.0 | 290,000 | 290,093 | 2016/8/25 |
| 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 | 100,067 | 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19回 | 1.8 | 700,000 | 701,332 | 2016/9/29 |
| 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 | 125,645 | 2016/11/30 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第19回 | 0.445 | 300,000 | 300,482 | 2016/12/20 |
| 日本政策投資銀行債券 財投機関債第27回 | 1.98 | 100,000 | 100,172 | 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 | 100,177 | 2016/9/20 |
| 地方公共団体金融機構債券(5年)第9回 | 0.34 | 100,000 | 100,251 | 2017/4/28 |

| 銘 | 柄 | 当 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 | 200,179 | 2017/3/28 |
| 公営企業債券 第24回財投機関債 | | 1.94 | 100,000 | 100,650 | 2016/12/20 |
| 首都高速道路 第8回 | | 0.439 | 140,000 | 140,048 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 第20回財投機関債 | | 0.471 | 900,000 | 900,378 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 第43回財投機関債 | | 0.101 | 200,000 | 200,076 | 2016/11/18 |
| 関西国際空港社債 財投機関債第31回 | | 0.504 | 70,000 | 70,030 | 2016/9/20 |
| 中部国際空港社債 財投機関債第2回 | | 0.489 | 1,300,000 | 1,303,478 | 2017/2/24 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第38回 | | 0.1 | 300,000 | 300,206 | 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 | 100,176 | 2016/9/20 |
| 小 計 | | | 5,325,000 | 5,333,466 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 利付第736回い号 | | 0.45 | 300,000 | 300,133 | 2016/9/27 |
| 商工債券 利付第737回い号 | | 0.45 | 200,000 | 200,156 | 2016/10/27 |
| 商工債券 利付第738回い号 | | 0.45 | 200,000 | 200,239 | 2016/11/25 |
| 農林債券 利付第735回い号 | | 0.45 | 150,000 | 150,012 | 2016/8/26 |
| 農林債券 利付第736回い号 | | 0.5 | 750,000 | 750,407 | 2016/9/27 |
| 農林債券 利付第737回い号 | | 0.5 | 80,000 | 80,063 | 2016/10/27 |
| 農林債券 利付第739回い号 | | 0.5 | 500,000 | 500,885 | 2016/12/27 |
| 農林債券 利付第742回い号 | | 0.45 | 200,000 | 200,540 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第261回 | | 0.45 | 500,000 | 500,073 | 2016/8/26 |
| しんきん中金債券 利付第262回 | | 0.45 | 100,000 | 100,045 | 2016/9/27 |
| しんきん中金債券 利付第263回 | | 0.5 | 100,000 | 100,093 | 2016/10/27 |
| しんきん中金債券 利付第266回 | | 0.45 | 300,000 | 300,618 | 2017/1/27 |
| 商工債券 利付(3年)第164回 | | 0.2 | 200,000 | 200,036 | 2016/9/27 |
| 商工債券 利付(3年)第166回 | | 0.2 | 100,000 | 100,052 | 2016/11/25 |
| 商工債券 利付(3年)第171回 | | 0.2 | 100,000 | 100,142 | 2017/4/27 |
| 小 計 | | | 3,780,000 | 3,783,502 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| アサヒグループホールディングス 第1回特定社債間限定同順位特約付 | | 0.52 | 200,000 | 200,181 | 2016/10/21 |
| 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 | 500,431 | 2016/10/20 |
| 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 | 100,078 | 2016/10/20 |
| 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 | 100,041 | 2016/10/31 |
| 三井住友銀行 第55回社債間限定同順位特約付 | | 0.47 | 100,000 | 100,083 | 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 | 100,166 | 2016/9/20 |
| 三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付 | | 0.66 | 400,000 | 400,720 | 2016/12/14 |
| 小 計 | | | 1,500,000 | 1,501,704 | |
| 合 計 | | | 13,503,010 | 13,523,452 | |

* 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 1,199,980 | % 6.1 |

* 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

(2016年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 13,523,452 | 65.9 |
| その他有価証券 | 1,199,980 | 5.8 |
| コール・ローン等、その他 | 5,800,725 | 28.3 |
| 投資信託財産総額 | 20,524,157 | 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 (2016年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 20,524,157,958 |
| コール・ローン等 | 5,763,236,241 |
| 公社債(評価額) | 13,523,452,183 |
| その他有価証券 | 1,199,980,051 |
| 未収利息 | 16,503,055 |
| 前払費用 | 20,986,428 |
| (B) 負債 | 801,532,052 |
| 未払金 | 801,524,000 |
| 未払利息 | 8,052 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 19,722,625,906 |
| 元本 | 19,315,765,955 |
| 次期繰越損益金 | 406,859,951 |
| (D) 受益権総口数 | 19,315,765,955口 |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 10,211円 |

(注) 期首元本額は21,588,342,274円、期中追加設定元本額は3,803,787,310円、期中一部解約元本額は6,076,363,629円、1口当たり純資産額は1,0211円です。

○損益の状況 (2015年8月20日～2016年8月19日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 92,619,318 |
| 受取利息 | 92,152,370 |
| その他収益金 | 1,948,259 |
| 支払利息 | △ 1,481,311 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 83,175,377 |
| 売買益 | 14,438 |
| 売買損 | △ 83,189,815 |
| (C) 保管費用等 | △ 214,563 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 9,229,378 |
| (E) 前期繰越損益金 | 445,681,696 |
| (F) 追加信託差損益金 | 79,665,282 |
| (G) 解約差損益金 | △127,716,405 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 406,859,951 |
| 次期繰越損益金(H) | 406,859,951 |

*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 |
|---|---------------|
| | 円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッドF30(非課税適格機関投資家専用) | 5,423,785,404 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッドF50(適格機関投資家販売制限付) | 4,206,288,588 |
| 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) | 4,181,906,577 |
| 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) | 2,296,160,091 |
| 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) | 1,186,053,936 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 379,067,282 |
| ネクストコア | 343,183,624 |
| 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 | 317,657,897 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---------------------------------------|-------------|
| | 円 |
| 野村世界高金利通貨投信 | 151,953,753 |
| バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06 | 146,986,772 |
| 野村ドイチェン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 | 113,781,191 |
| バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09 | 98,039,216 |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド) | 84,639,967 |
| 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 | 49,578,893 |
| 野村高金利国際機関債投信(毎月分配型) | 49,354,623 |
| 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 | 47,082,117 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 野村ビクテ・ジェネリック&グノム マネープール・ファンド | 33,758,750 |
| 野村新中国株投資 マネープール・ファンド | 17,198,352 |
| 野村世界業種別投資シリアルズ(マネープール・ファンド) | 10,016,716 |
| 米国変動好金利ファンド Aコース | 8,829,589 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型 | 8,788,959 |
| 野村グローバルCB投信(マネープールファンド)年2回決算型 | 6,157,226 |
| 野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド | 5,393,879 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 4,553,821 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型 | 4,315,818 |
| コインの未来(毎月分配型) | 3,965,894 |
| 野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド | 3,607,923 |
| 野村・グリーン・テクノロジー マネープール・ファンド | 1,511,406 |
| コインの未来(年2回分配型) | 991,474 |
| 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 | 984,834 |
| 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 | 984,834 |
| 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 | 984,834 |
| 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 | 984,834 |
| 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 | 984,834 |
| 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 | 984,834 |
| 野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)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信(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信(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信(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信(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信(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信(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 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース | 983,381 |
| 野村テンブルトン・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 |
| ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨債(債券 Aコース)) | 982,995 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(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D(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 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|-------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 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・イールド債券投信(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信(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信 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,608 |
| 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 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカドルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(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(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・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカドルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村PMICO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(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信(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信(円コース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(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信(中国元コース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村アジアCB投信(毎月分配型) | 982,608 |
| 野村PMICO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 | 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信(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信(中国元コース)毎月分配型 | 982,607 |
| 野村PMICO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,607 |
| 野村PMICO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 | 982,607 |
| 第12回 野村短期公社債ファンド | 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信(米ドルコース)毎月分配型 | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 981,451 |
| 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 | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型 | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型 | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 981,451 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 981,451 |
| 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 | 981,451 |
| 野村エマージング債券プレミアム毎月分配型 | 981,451 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 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 |
| 米国変動好金利ファンド Bコース | 981,066 |
| 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 |
| ノムラ THE ASIA Bコース | 979,912 |
| 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信(トルコリラコース) 毎月分配型 | 588,871 |
| 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信(インドネシアピアコース) 毎月分配型 | 294,436 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアピアコース) 年2回決算型 | 294,436 |
| 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 | 196,925 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型 | 196,291 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアピアコース) 年2回決算型 | 196,291 |
| 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 | 98,262 |
| 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 | 98,261 |
| 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 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(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信(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信(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信(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信(インドネシアピアコース) 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信(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信(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信(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信(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信(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 |
| 野村テンブルトン・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信(通貨セレクトコース) 年2回決算型 | 98,261 |
| 第1回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第2回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第3回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第4回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第5回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第6回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第7回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第8回 野村短期公社債ファンド | 98,261 |
| 第11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 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|-------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 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PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース | 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 |
| 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) | 98,260 |
| 第9回 野村短期公社債ファンド | 98,260 |
| 第10回 野村短期公社債ファンド | 98,260 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型 | 98,146 |
| ノムラ THE EUROPE Aコース | 98,117 |
| ノムラ THE EUROPE Bコース | 98,117 |
| 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 |
| ノムラ THE ASIA Aコース | 97,992 |
| 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(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(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 |
| 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PIMCO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PIMCO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) 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 |
| 野村新興国高配当株トリプルウィング ブラジリアル毎月分配型 | 9,803 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース) | 9,803 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース) | 9,803 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース) | 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 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 年2回決算型 | 4,908 |
| 野村高金利国際機関債投信(年2回決算型) | 1,967 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 毎月分配型 | 1,963 |

○お知らせ

該当事項はございません。

＜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11月22日現在)

| ファンド名 年 月 | 「米ドルコース」 「ユーロコース」 「豪ドルコース」 「トルコリラコース」 「メキシコペソコース」 | 「ブラジルリアル コース」 | 「中国元コース」 | 「インドネシア ルピアコース」 | 「インドルピー コース」 | 「ロシアルーブル コース」 |
|--------------|---|---|----------|--------------------|-----------------|------------------|
| 2016年11月 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 |
| 12月 | 26、27 | 26、27、30 | 26、27 | 12、26、27 | 12、26、27 | 26、27 |
| 2017年1月 | 16 | 「ブラジルリアルコース」「中国元コース」「インドネシアルピアコース」「インドルピーコース」は、一部の銀行・取引所の休業日の情報を入手出来ていないため、2017年1月以降の申込不可日は掲載しておりません。 | | | | 4、5、6、16 |
| 2月 | 20 | | | | | 20、23、24 |
| 3月 | － | | | | | 8 |
| 4月 | 14、17 | | | | | 14、17 |
| 5月 | 1、25、29 | | | | | 1、8、9、25、29 |
| 6月 | 5、23 | | | | | 5、12、23 |
| 7月 | 4 | | | | | 4 |
| 8月 | 15、28 | | | | | 15、28 |
| 9月 | 4 | | | | | 4 |
| 10月 | － | | | | | － |
| 11月 | 1 | | | | | 1、6 |
| 12月 | 25、26 | | | | | 25、26 |

※2017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注意ください。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。