

# 野村通貨選択日本株投信 (ブラジルリアルコース) 年2回決算型

## 運用報告書(全体版)

第19期（決算日2022年11月22日）

作成対象期間（2022年5月24日～2022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2028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・ファンドのブラジルリアルクラス受益証券（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、わが国の株式を実質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ないます。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（ブラジルリアルコース）年2回決算型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 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、コモディティ・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（ブラジルリアルコース）年2回決算型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行ないません。                                                  |
|        | 野村マネー マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 株式への投資は行ないません。                                                                              |
| 分配方針   | 毎決算時に、原則として、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                             |

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準<br>(分配落) | 価 額          |           | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|--------------|--------------|-----------|----------------|----------------|----------------------|--------------|
|                  |              | 税 分<br>金 達 配 | 期 騰 落 中 率 |                |                |                      |              |
|                  | 円            | 円            | %         | %              | %              | %                    | 百万円          |
| 15期(2020年11月24日) | 14,185       | 10           | 29.9      | 0.0            | —              | 98.7                 | 246          |
| 16期(2021年 5月24日) | 16,660       | 10           | 17.5      | 0.0            | —              | 98.8                 | 254          |
| 17期(2021年11月22日) | 17,817       | 10           | 7.0       | 0.0            | —              | 98.7                 | 156          |
| 18期(2022年 5月23日) | 21,191       | 10           | 19.0      | 0.0            | —              | 98.7                 | 155          |
| 19期(2022年11月22日) | 23,787       | 10           | 12.3      | 0.0            | —              | 98.7                 | 174          |

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。  
\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。  
\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。  
\* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

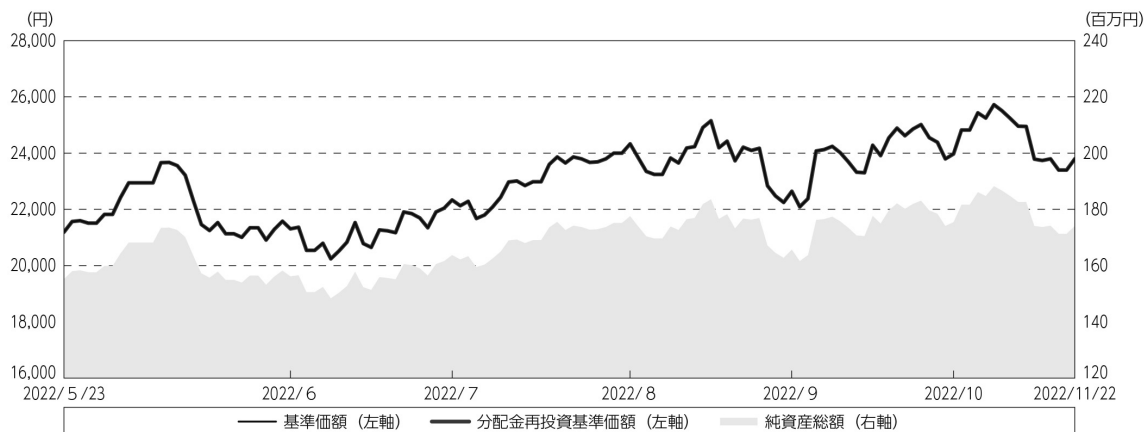
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日       | 基 準    | 価 額   |   | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 |
|-------------|--------|-------|---|----------------|----------------|----------------------|
|             |        | 騰 落 率 | 率 |                |                |                      |
| (期 首)       | 円      | %     |   | %              | %              | %                    |
| 2022年 5月23日 | 21,191 | —     |   | 0.0            | —              | 98.7                 |
| 5 月末        | 21,820 | 3.0   |   | 0.0            | —              | 98.8                 |
| 6 月末        | 21,311 | 0.6   |   | 0.0            | —              | 98.8                 |
| 7 月末        | 22,337 | 5.4   |   | 0.0            | —              | 98.8                 |
| 8 月末        | 24,333 | 14.8  |   | 0.0            | —              | 98.9                 |
| 9 月末        | 22,641 | 6.8   |   | 0.0            | —              | 98.9                 |
| 10月末        | 23,972 | 13.1  |   | 0.0            | —              | 99.0                 |
| (期 末)       |        |       |   |                |                |                      |
| 2022年11月22日 | 23,797 | 12.3  |   | 0.0            | —              | 98.7                 |

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。  
\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。  
\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：21,191円

期 末：23,787円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 12.3%（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（2022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

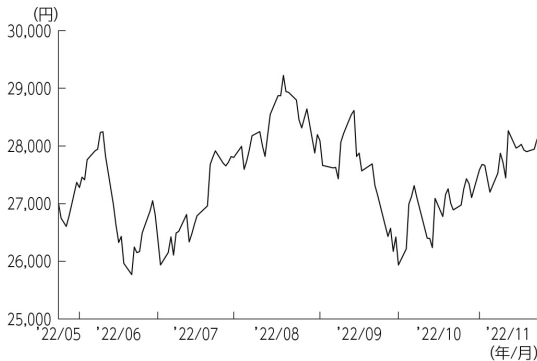
- ・ 実質的に投資している国内株式からのキャピタルゲイン（またはロス）（株価変動損益）
- ・ 実質的に投資している国内株式からのインカムゲイン（配当収益）
- ・ 実質的に投資している為替取引からのキャピタルゲイン（またはロス）（為替変動損益）
- ・ 実質的に投資している為替取引からのプレミアム（金利差益）またはディスカウント（金利差損）

## ○投資環境

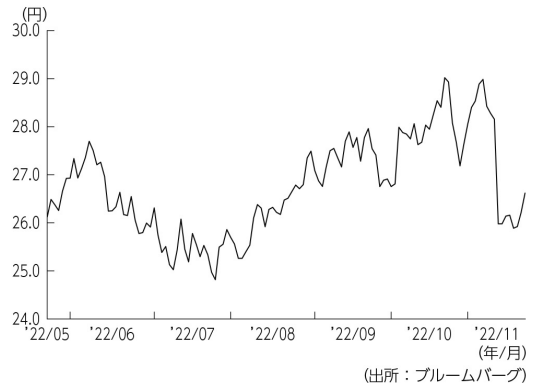
### <国内株式市場>

当作成期首からの国内株式市場は、日米金利差の拡大などを受けて円安米ドル高が進行したことなどから上昇しました。2022年6月中旬以降は、欧米諸国の金融引き締めによる世界景気低迷への懸念などから下落しましたが、7月以降は、円安米ドル高進行による輸出企業の収益改善期待や、FOMC（米連邦公開市場委員会）においてパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げペースの緩和を示唆したことで米国株式が大幅高となったことなどから概ね堅調に推移しました。8月下旬以降は、米国の金融引き締め局面の長期化観測が広がったことなどから下落しました。10月以降は、米長期金利上昇が一服したことで米国株式市場が堅調に推移したことや、一時1米ドル150円を超えた円安を背景に輸出関連企業の業績上方修正への期待が高まったこと、岸田政権の総合経済対策が発表されたことなどから上昇しました。

<日経平均株価の推移>



<円/ブラジルリアルレートの推移>



## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型]

【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 ブラジルリアルクラス】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 ブラジルリアルクラス】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 ブラジルリアルクラス]

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。

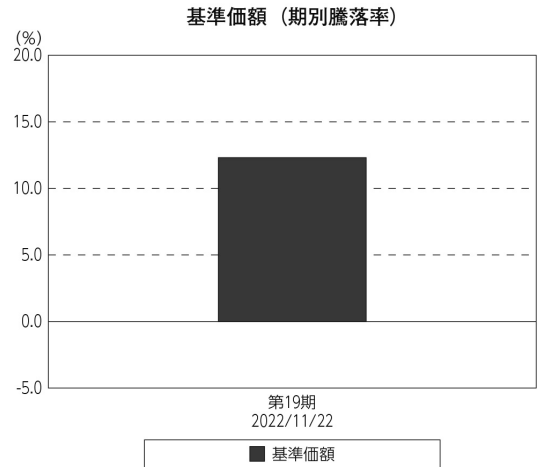
### [野村マネー マザーファンド]

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、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

収益分配金については、基準価額、利子・配当等収益、信託報酬などの諸経費を勘案して決定しました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1 万口当たり・税込み）

| 項 目                | 第19期<br>2022年5月24日～<br>2022年11月22日 |
|--------------------|------------------------------------|
|                    |                                    |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 10<br>0.042%                       |
| 当期の収益              | 10                                 |
| 当期の収益以外            | —                                  |
| 翌期繰越分配対象額          | 18,418                             |

（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（ブラジルリアルコース）年2回決算型】

【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 ブラジルリアルクラス】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 ブラジルリアルクラス】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 ブラジルリアルクラス】

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、ブラジルリアル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。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。

※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留意ください。

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なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行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

(2022年 5 月24日～2022年11月22日)

| 項 目                   | 当 期   |         | 項 目 の 概 要                                    |
|-----------------------|-------|---------|----------------------------------------------|
|                       | 金 額   | 比 率     |                                              |
| (a) 信 託 報 酬           | 円 74  | % 0.325 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                      |
| ( 投 信 会 社 )           | (13)  | (0.055) | 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 )           | (58)  | (0.254) | 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 )           | ( 4 ) | (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＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                 |
| ( 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                   | 74    | 0.327   |                                              |
| 期中の平均基準価額は、22,735円です。 |       |         |                                              |

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

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

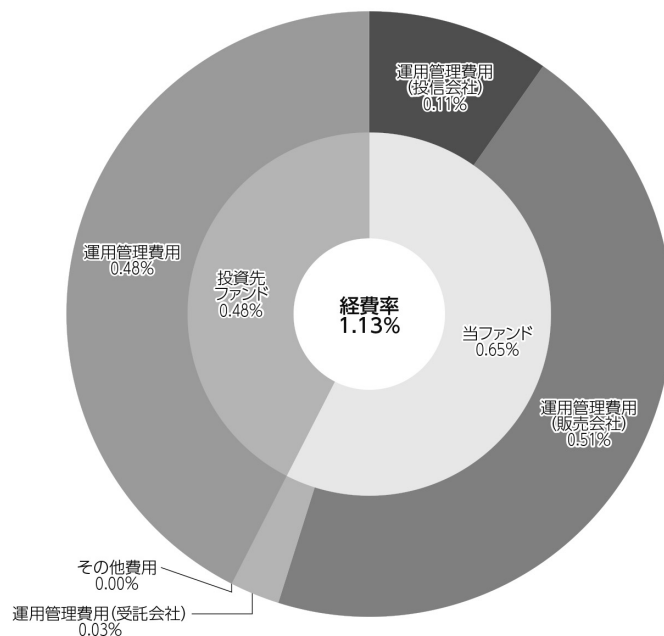
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

## （参考情報）

## ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.13%です。



(単位：%)

|                    |      |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②)          | 1.13 |
| ①当ファンドの費用の比率       | 0.65 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.48 |

(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

(2022年5月24日～2022年11月22日)

投資信託証券

| 銘柄 |                                         | 買付  |       | 売付  |       |
|----|-----------------------------------------|-----|-------|-----|-------|
|    |                                         | 口数  | 金額    | 口数  | 金額    |
| 国内 | ノムラ・マネージド・マスター・トラストー                    | 口   | 千円    | 口   | 千円    |
|    | ジャパン・ストック・バッシブ・インベストメント・ファンド ブラジルリアルクラス | 250 | 3,479 | 161 | 2,338 |

\*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

(2022年5月24日～2022年11月22日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2022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                                                             | 期首(前期末) | 当 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<br>ジャパン・ストック・バッシブ・インベストメント・ファンド ブラジルリアルクラス | 口       | 口       | 千円       | %     |
|                                                                 | 11, 723 | 11, 812 | 171, 923 | 98. 7 |
| 合 計                                                             | 11, 723 | 11, 812 | 171, 923 | 98. 7 |

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。  
\*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

| 銘柄            |  | 期首(前期末) | 当期末 |     |
|---------------|--|---------|-----|-----|
|               |  | 口数      | 口数  | 評価額 |
| 野村マネー マザーファンド |  | 千口      | 千口  | 千円  |
|               |  | 100     | 100 | 102 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年11月22日現在)

| 項 目           | 当 期 末   |       |
|---------------|---------|-------|
|               | 評 価 額   | 比 率   |
|               | 千円      | %     |
| 投資信託受益証券      | 171,923 | 98.3  |
| 野村マネー マザーファンド | 102     | 0.1   |
| コール・ローン等、その他  | 2,811   | 1.6   |
| 投資信託財産総額      | 174,836 | 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 (2022年11月22日現在)

| 項 目                | 当 期 末       |
|--------------------|-------------|
|                    | 円           |
| (A) 資産             | 174,836,217 |
| コール・ローン等           | 2,809,613   |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 171,923,660 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 102,944     |
| (B) 負債             | 711,423     |
| 未払金                | 87,330      |
| 未払収益分配金            | 73,202      |
| 未払信託報酬             | 548,166     |
| 未払利息               | 4           |
| その他未払費用            | 2,721       |
| (C) 純資産総額(A－B)     | 174,124,794 |
| 元本                 | 73,202,907  |
| 次期繰越損益金            | 100,921,887 |
| (D) 受益権総口数         | 73,202,907口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)    | 23,787円     |

(注) 期首元本額は73,277,162円、期中追加設定元本額は499,098円、期中一部解約元本額は573,353円、1口当たり純資産額は2,3787円です。

○損益の状況 (2022年5月24日～2022年11月22日)

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | 2,113,476      |
| 受取配当金            | 2,113,719      |
| 支払利息             | △ 243          |
| (B) 有価証券売買損益     | 17,418,052     |
| 売買益              | 17,565,864     |
| 売買損              | △ 147,812      |
| (C) 信託報酬等        | △ 550,887      |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 18,980,641     |
| (E) 前期繰越損益金      | 40,782,819     |
| (F) 追加信託差損益金     | 41,231,629     |
| (配当等相当額)         | ( 75,138,044)  |
| (売買損益相当額)        | (△ 33,906,415) |
| (G) 計(D＋E＋F)     | 100,995,089    |
| (H) 収益分配金        | △ 73,202       |
| 次期繰越損益金(G＋H)     | 100,921,887    |
| 追加信託差損益金         | 41,231,629     |
| (配当等相当額)         | ( 75,138,044)  |
| (売買損益相当額)        | (△ 33,906,415) |
| 分配準備積立金          | 59,690,258     |

\*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まず。

\*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（2022年 5 月24日～2022年11月22日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                          |
|------------------------------|------------------------------|
|                              | 2022年 5 月24日～<br>2022年11月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 2,054,093円                   |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 16,926,548円                  |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 75,138,044円                  |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 40,782,819円                  |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 134,901,504円                 |
| f. 分配対象収益(1 万口当たり)           | 18,428円                      |
| g. 分配金                       | 73,202円                      |
| h. 分配金(1 万口当たり)              | 10円                          |

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。  
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。  
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

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)

2022年3月31日決算  
(計算期間：2021年4月1日～2022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ないます。 |
| 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  
2022年3月31日に終了する計測期間  
(円)

**収益**

|                 |                    |
|-----------------|--------------------|
| 受取配当金等(源泉徴収税除後) | 394,633,863        |
| 収益合計            | <u>394,633,863</u> |

**費用**

|          |                    |
|----------|--------------------|
| 投資顧問報酬   | 98,756,520         |
| 事務管理代行報酬 | 21,935,745         |
| 保管費用     | 8,262,815          |
| 当座借越利息   | 7,889,311          |
| 取引銀行報酬   | 3,023,422          |
| 銀行手数料    | 800,000            |
| 受託報酬     | 5,486,618          |
| 法務報酬     | 153,853            |
| 立替費用     | 2,741,660          |
| 専門家報酬    | 2,198,848          |
| 雑費用      | 10,370             |
| 費用合計     | <u>151,259,162</u> |

**純投資損益**

243,374,701

|                       |               |
|-----------------------|---------------|
| 投資有価証券売買に係る損益         | 663,357,547   |
| 先物契約に係る損益             | (275,759,820) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | 2,102,490,401 |

**当期実現純損益**

2,490,088,128

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| 投資有価証券評価差損益       | (1,909,263,007) |
| 先物契約に係る評価差損益      | 241,307,640     |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損益 | 717,566,189     |

**当期評価差損益**

(950,389,178)

**運用の結果による純資産の増減額**1,783,073,651

|                          | 1口当たり純資産価格 | 発行済受益証券数 | 純資産            |
|--------------------------|------------|----------|----------------|
| AUD Class Units (in JPY) | 19,635     | 47,913   | 940,750,713    |
| BRL Class Units (in JPY) | 13,200     | 93,261   | 1,231,074,931  |
| CNY Class Units (in JPY) | 25,862     | 4,255    | 110,041,429    |
| EUR Class Units (in JPY) | 19,367     | 527      | 10,206,199     |
| IDR Class Units (in JPY) | 24,975     | 5,852    | 146,150,838    |
| INR Class Units (in JPY) | 21,705     | 28,380   | 615,988,243    |
| MXN Class Units (in JPY) | 19,185     | 170,053  | 3,262,529,705  |
| TRY Class Units (in JPY) | 5,832      | 54,573   | 318,290,061    |
| USD Class Units (in JPY) | 26,065     | 817,121  | 21,298,470,565 |

組入資産明細  
2022年3月31日現在  
(円)

| 数量         | 銘柄                           | 評価額           | 純資産比率(%) |
|------------|------------------------------|---------------|----------|
| <b>日本</b>  |                              |               |          |
| <b>普通株</b> |                              |               |          |
| 30,000     | TOKYO ELECTRON LTD           | 1,897,500,000 | 6.78     |
| 30,000     | FAST RETAILING               | 1,889,700,000 | 6.76     |
| 180,000    | SOFTBANK GROUP               | 1,000,620,000 | 3.58     |
| 180,000    | KDDI CORP                    | 720,900,000   | 2.58     |
| 30,000     | DAIKIN INDUSTRIES LTD        | 672,300,000   | 2.40     |
| 30,000     | FANUC CORPORATION            | 649,350,000   | 2.32     |
| 60,000     | ADVANTEST CORP               | 580,200,000   | 2.07     |
| 30,000     | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD    | 563,700,000   | 2.01     |
| 90,000     | RECRUIT HOLDINGS CO LTD      | 487,260,000   | 1.74     |
| 120,000    | TERUMO CORP                  | 446,880,000   | 1.60     |
| 60,000     | KYOCERA CORP                 | 412,920,000   | 1.47     |
| 90,000     | TDK CORP                     | 401,400,000   | 1.43     |
| 30,000     | SONY CORP                    | 381,900,000   | 1.36     |
| 90,000     | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | 368,730,000   | 1.32     |
| 150,000    | NTT DATA CORP                | 362,700,000   | 1.29     |
| 150,000    | TOYOTA MOTOR CORP            | 333,375,000   | 1.19     |
| 72,000     | M3 INC                       | 321,768,000   | 1.15     |
| 150,000    | ASTELLAS PHARMA INC          | 286,650,000   | 1.02     |
| 120,000    | OLYMPUS CORP                 | 280,680,000   | 1.00     |
| 30,000     | BANDAI NAMCO HOLDINGS INC    | 278,760,000   | 0.99     |
| 30,000     | SECOM CO LTD                 | 266,040,000   | 0.95     |
| 30,000     | NITTO DENKO CORP             | 264,600,000   | 0.94     |
| 30,000     | OMRON CORP                   | 246,420,000   | 0.88     |
| 30,000     | KIKKOMAN CORP                | 243,900,000   | 0.87     |
| 90,000     | DAIICHI SANKYO CO LTD        | 241,200,000   | 0.86     |
| 30,000     | DENSO CORP                   | 235,800,000   | 0.84     |
| 30,000     | KONAMI HOLDINGS CORP         | 232,500,000   | 0.83     |
| 30,000     | SHIONOGI & CO LTD            | 225,900,000   | 0.81     |
| 30,000     | FUJIFILM HOLDINGS CORP       | 225,060,000   | 0.80     |
| 30,000     | NISSAN CHEMICAL              | 216,900,000   | 0.77     |
| 30,000     | TREND MICRO INC              | 214,800,000   | 0.77     |
| 60,000     | HONDA MOTOR CO LTD           | 209,220,000   | 0.75     |
| 24,000     | MURATA MANUFACTURING CO LTD  | 194,808,000   | 0.70     |
| 30,000     | SHISEIDO CO LTD              | 186,540,000   | 0.67     |
| 3,000      | NINTENDO CO LTD              | 185,010,000   | 0.66     |
| 60,000     | NEXON CO LTD                 | 175,920,000   | 0.63     |
| 30,000     | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD    | 174,390,000   | 0.62     |
| 3,000      | KEYENCE CORP                 | 171,750,000   | 0.61     |
| 30,000     | EISAI CO LTD                 | 170,100,000   | 0.61     |
| 30,000     | TAIYO YUDEN CO LTD           | 166,500,000   | 0.59     |
| 30,000     | YAMAHA CORP                  | 160,500,000   | 0.57     |
| 30,000     | TOYOTA TSUSHO CORP           | 151,800,000   | 0.54     |
| 30,000     | KAO CORP                     | 150,750,000   | 0.54     |
| 30,000     | DENTSU GROUP INC             | 150,600,000   | 0.54     |
| 30,000     | YASKAWA ELECTRIC CORPORATION | 144,450,000   | 0.52     |
| 30,000     | BRIDGESTONE CORP             | 142,740,000   | 0.51     |
| 30,000     | MITSUBISHI CORP              | 138,030,000   | 0.49     |
| 45,000     | CANON INC                    | 134,685,000   | 0.48     |
| 30,000     | ASAHI GROUP HOLDINGS         | 133,830,000   | 0.48     |
| 30,000     | OTSUKA HOLDINGS CO LTD       | 126,960,000   | 0.45     |
| 30,000     | SUZUKI MOTOR CORP            | 126,390,000   | 0.45     |

| 数量     | 銘柄                             | 評価額         | 純資産比率(%) |
|--------|--------------------------------|-------------|----------|
| 30,000 | ITOCHU CORP                    | 124,320,000 | 0.44     |
| 60,000 | SEIKO EPSON CORP               | 110,460,000 | 0.39     |
| 15,000 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC      | 106,920,000 | 0.38     |
| 30,000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD   | 104,940,000 | 0.37     |
| 30,000 | AJINOMOTO CO INC               | 104,250,000 | 0.37     |
| 30,000 | SUMITOMO REALTY & DEV CO LTD   | 101,670,000 | 0.36     |
| 30,000 | mitsui & co LTD                | 99,840,000  | 0.36     |
| 30,000 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD    | 96,030,000  | 0.34     |
| 30,000 | HITACHI CONST MACH CO LTD      | 95,850,000  | 0.34     |
| 15,000 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD   | 92,445,000  | 0.33     |
| 30,000 | KOMATSU LTD                    | 88,290,000  | 0.32     |
| 30,000 | KYOWA KIRIN CO LTD             | 85,440,000  | 0.30     |
| 30,000 | YAMAHA MOTOR CO LTD            | 82,680,000  | 0.30     |
| 30,000 | MINEBEA MITSUMI                | 80,820,000  | 0.29     |
| 30,000 | COMSYS HOLDINGS CORP           | 80,040,000  | 0.29     |
| 30,000 | mitsui FUDOSAN CO LTD          | 78,600,000  | 0.28     |
| 30,000 | AEON CO LTD                    | 78,285,000  | 0.28     |
| 6,000  | SCREEN HOLDINGS CO LTD         | 74,160,000  | 0.26     |
| 15,000 | TOTO LTD                       | 74,100,000  | 0.26     |
| 30,000 | SEKISUI HOUSE LTD              | 71,130,000  | 0.25     |
| 30,000 | KUBOTA CORP                    | 69,090,000  | 0.25     |
| 30,000 | YAMATO HOLDINGS CO LTD         | 68,790,000  | 0.25     |
| 30,000 | JAPAN EXCHANGE GROUP INC       | 68,580,000  | 0.24     |
| 30,000 | MARUI GROUP CO LTD             | 67,500,000  | 0.24     |
| 30,000 | SUMITOMO CORP                  | 63,570,000  | 0.23     |
| 30,000 | YOKOGAWA ELECTRIC CORP         | 62,970,000  | 0.22     |
| 30,000 | JAPAN TOBACCO INC              | 62,625,000  | 0.22     |
| 15,000 | NH FOODS LTD                   | 62,250,000  | 0.22     |
| 30,000 | SUBARU CORP                    | 58,440,000  | 0.21     |
| 3,000  | FUJITSU LTD                    | 55,245,000  | 0.20     |
| 30,000 | KIRIN HOLDINGS CO LTD          | 54,870,000  | 0.20     |
| 30,000 | mitsubishi ESTATE CO LTD       | 54,570,000  | 0.19     |
| 30,000 | NGK INSULATORS LTD             | 52,590,000  | 0.19     |
| 15,000 | KEISEI ELECTRIC RAILWAY CO LTD | 51,225,000  | 0.18     |
| 30,000 | NISSHIN SEIFUN GROUP INC       | 51,180,000  | 0.18     |
| 3,000  | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO       | 47,895,000  | 0.17     |
| 15,000 | mitsubishi LOGISTICS CORP      | 45,600,000  | 0.16     |
| 30,000 | JGC HOLDINGS COR               | 43,920,000  | 0.16     |
| 30,000 | SUMITOMO ELECTRIC IND LTD      | 43,860,000  | 0.16     |
| 15,000 | DAI NIPPON PRINTING CO LTD     | 43,170,000  | 0.15     |
| 30,000 | SOFTBANK CORP                  | 42,840,000  | 0.15     |
| 30,000 | MARUBENI CORP                  | 42,780,000  | 0.15     |
| 12,000 | NIPPON TELG & TEL CORP         | 42,540,000  | 0.15     |
| 30,000 | mitsubishi ELECTRIC CORP       | 42,300,000  | 0.15     |
| 30,000 | CASIO COMPUTER CO LTD          | 42,240,000  | 0.15     |
| 6,000  | EBARA CORP                     | 41,040,000  | 0.15     |
| 12,000 | IDEMITSU KOSAN CO LTD          | 40,500,000  | 0.14     |
| 6,000  | MEIJI HOLDINGS CO LTD          | 39,660,000  | 0.14     |
| 30,000 | NIKON CORP                     | 39,420,000  | 0.14     |
| 30,000 | CREDIT SAISON CO LTD           | 39,090,000  | 0.14     |
| 6,000  | HITACHI LTD                    | 36,990,000  | 0.13     |
| 6,000  | FUJI ELECTRIC CO LTD           | 36,960,000  | 0.13     |
| 24,000 | CYBERAGENT INC                 | 36,624,000  | 0.13     |
| 30,000 | ALPS ALPINE CO LTD             | 36,330,000  | 0.13     |
| 30,000 | SUMITOMO PHARMA                | 36,240,000  | 0.13     |
| 9,000  | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS | 35,802,000  | 0.13     |
| 30,000 | PANASONIC HOLDIN               | 35,655,000  | 0.13     |
| 15,000 | NICHIREI CORP                  | 35,535,000  | 0.13     |
| 30,000 | TOKAI CARBON CO LTD            | 34,530,000  | 0.12     |
| 30,000 | SHARP CORP                     | 34,470,000  | 0.12     |
| 6,000  | DOWA HOLDINGS CO LTD           | 33,660,000  | 0.12     |

| 数量     | 銘柄                             | 評価額        | 純資産比率(%) |
|--------|--------------------------------|------------|----------|
| 30,000 | TAKARA HOLDINGS INC            | 33,030,000 | 0.12     |
| 30,000 | AMADA CO LTD                   | 32,520,000 | 0.12     |
| 15,000 | TOPPAN INC                     | 32,490,000 | 0.12     |
| 6,000  | SOMPO HOLDINGS INC             | 32,286,000 | 0.12     |
| 3,000  | NIPPON YUSEN KK                | 32,280,000 | 0.12     |
| 30,000 | ASAHI KASEI CORPORATION        | 31,875,000 | 0.11     |
| 30,000 | RICOH CO LTD                   | 31,860,000 | 0.11     |
| 30,000 | KURARAY CO LTD                 | 31,710,000 | 0.11     |
| 9,000  | mitsui O.S.K. LINES LTD        | 30,780,000 | 0.11     |
| 6,000  | OKUMA CORP                     | 30,600,000 | 0.11     |
| 15,000 | ODAKYU ELECTRIC RAILWAY CO LTD | 30,555,000 | 0.11     |
| 6,000  | AGC INC                        | 29,430,000 | 0.11     |
| 30,000 | RAKUTEN GROUP IN               | 29,010,000 | 0.10     |
| 30,000 | isetan MITSUKOSHI HOLDINGS LTD | 29,010,000 | 0.10     |
| 30,000 | JTEKT CORP                     | 28,920,000 | 0.10     |
| 6,000  | KEIO CORP                      | 28,710,000 | 0.10     |
| 15,000 | TOKYO TATEMONO CO LTD          | 27,510,000 | 0.10     |
| 15,000 | TOSOH CORP                     | 27,210,000 | 0.10     |
| 30,000 | OBAYASHI CORP                  | 27,000,000 | 0.10     |
| 30,000 | JAPAN POST HOLDINGS CO LTD     | 26,952,000 | 0.10     |
| 30,000 | SHIZUOKA BANK LTD              | 25,890,000 | 0.09     |
| 15,000 | YOKOHAMA RUBBER CO LTD         | 25,380,000 | 0.09     |
| 3,000  | NIPPON EXPRESS H               | 25,260,000 | 0.09     |
| 9,000  | NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD   | 24,444,000 | 0.09     |
| 30,000 | MATSUI SECURITIES CO LTD       | 24,210,000 | 0.09     |
| 3,000  | KAWASAKI KISEN KAISHA LTD      | 24,060,000 | 0.09     |
| 15,000 | TOKYU CORP                     | 23,880,000 | 0.09     |
| 15,000 | ISUZU MOTORS LTD               | 23,820,000 | 0.09     |
| 6,000  | JAPAN STEEL WORKS LTD          | 22,920,000 | 0.08     |
| 30,000 | mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP | 22,809,000 | 0.08     |
| 15,000 | KAJIMA CORP                    | 22,365,000 | 0.08     |
| 30,000 | NSK LIMITED                    | 22,080,000 | 0.08     |
| 30,000 | SHIMIZU CORP                   | 22,050,000 | 0.08     |
| 30,000 | CHIBA BANK LTD                 | 21,750,000 | 0.08     |
| 30,000 | HINO MOTORS LTD                | 21,600,000 | 0.08     |
| 3,000  | EAST JAPAN RAILWAY CO          | 21,330,000 | 0.08     |
| 6,000  | TAISEI CORP                    | 21,210,000 | 0.08     |
| 30,000 | DAIWA SECURITIES GROUP INC     | 20,781,000 | 0.07     |
| 6,000  | DENKA CO LTD                   | 20,400,000 | 0.07     |
| 30,000 | TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP    | 20,220,000 | 0.07     |
| 30,000 | TORAY INDUSTRIES INC           | 19,164,000 | 0.07     |
| 30,000 | FUJIKURA LTD                   | 18,750,000 | 0.07     |
| 6,000  | MITSUI CHEMICALS INC           | 18,540,000 | 0.07     |
| 30,000 | OJI HOLDINGS CORPORATION       | 18,210,000 | 0.06     |
| 6,000  | TOBU RAILWAY CO LTD            | 17,874,000 | 0.06     |
| 15,000 | TAKASHIMAYA CO LTD             | 17,430,000 | 0.06     |
| 12,000 | INPEX CORP                     | 17,280,000 | 0.06     |
| 6,000  | SUMITOMO HEAVY IND             | 16,908,000 | 0.06     |
| 30,000 | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD       | 16,860,000 | 0.06     |
| 9,000  | DENA CO LTD                    | 16,740,000 | 0.06     |
| 30,000 | NIPPON SUISAN KAISHA LTD       | 16,440,000 | 0.06     |
| 30,000 | NISSAN MOTOR CO LTD            | 16,434,000 | 0.06     |
| 30,000 | CITIZEN WATCH CO LTD           | 15,630,000 | 0.06     |
| 30,000 | KONICA MINOLTA INC             | 15,480,000 | 0.06     |
| 30,000 | NOMURA HOLDINGS INC            | 15,456,000 | 0.06     |
| 3,000  | NEC CORP                       | 15,450,000 | 0.06     |
| 3,000  | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY     | 15,273,000 | 0.05     |
| 15,000 | J.FRONT RETAILING CO LTD       | 14,955,000 | 0.05     |
| 6,000  | FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC    | 14,244,000 | 0.05     |
| 6,000  | GS YUASA CORP                  | 14,046,000 | 0.05     |
| 3,000  | TOHO CO LTD 9602 JP            | 13,905,000 | 0.05     |



| 数量     | 銘柄                                  | 評価額            | 純資産比率(%) |
|--------|-------------------------------------|----------------|----------|
| 6,000  | SAPPORO HOLDINGS LTD                | 13,842,000     | 0.05     |
| 30,000 | CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD       | 13,740,000     | 0.05     |
| 30,000 | ENEOS HOLDINGS INC                  | 13,740,000     | 0.05     |
| 6,000  | TOKYO GAS CO LTD                    | 13,392,000     | 0.05     |
| 6,000  | OSAKA GAS CO LTD                    | 12,552,000     | 0.04     |
| 3,000  | PACIFIC METAL CO LTD                | 12,390,000     | 0.04     |
| 15,000 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS        | 12,256,500     | 0.04     |
| 3,000  | MITSUBISHI HEAVY IND LTD            | 12,060,000     | 0.04     |
| 3,000  | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC  | 12,003,000     | 0.04     |
| 3,000  | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | 11,721,000     | 0.04     |
| 6,000  | TOKUYAMA CORP                       | 10,308,000     | 0.04     |
| 3,000  | SUMITOMO OSAKA CEMENT CO LTD        | 10,080,000     | 0.04     |
| 3,000  | mitsui mining & smelting co ltd     | 10,065,000     | 0.04     |
| 6,000  | T&D HOLDINGS INC                    | 10,026,000     | 0.04     |
| 3,000  | IHI CORPORATION                     | 8,850,000      | 0.03     |
| 3,000  | TOHO ZINC CO LTD                    | 8,838,000      | 0.03     |
| 6,000  | HASEKO CORP                         | 8,442,000      | 0.03     |
| 6,000  | TEIJIN LTD                          | 8,178,000      | 0.03     |
| 3,000  | AOZORA BANK LTD                     | 7,767,000      | 0.03     |
| 3,000  | ANA HOLDINGS CO LTD                 | 7,698,000      | 0.03     |
| 3,000  | DIC CORP                            | 7,521,000      | 0.03     |
| 3,000  | DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC          | 7,497,000      | 0.03     |
| 3,000  | SHOWA DENKO KK                      | 7,290,000      | 0.03     |
| 3,000  | MARUHA NICHIRO CORP                 | 7,191,000      | 0.03     |
| 3,000  | SHINSEI BANK LTD                    | 6,711,000      | 0.02     |
| 3,000  | KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES LTD       | 6,678,000      | 0.02     |
| 3,000  | FURUKAWA ELECTRIC CO LTD            | 6,528,000      | 0.02     |
| 3,000  | NIPPON STEEL COR                    | 6,513,000      | 0.02     |
| 12,000 | Z HOLDINGS CORP                     | 6,436,800      | 0.02     |
| 3,000  | MITSUBISHI MATERIAL CORP            | 6,429,000      | 0.02     |
| 30,000 | NTN CORP                            | 6,420,000      | 0.02     |
| 3,000  | SUMCO CORP                          | 6,081,000      | 0.02     |
| 3,000  | TAIHEIYO CEMENT CORP                | 6,057,000      | 0.02     |
| 3,000  | SOJITZ CORPORATION                  | 6,051,000      | 0.02     |
| 3,000  | UBE CORP                            | 5,991,000      | 0.02     |
| 6,000  | MAZDA MOTOR CORP                    | 5,454,000      | 0.02     |
| 3,000  | JFE HOLDINGS INC                    | 5,169,000      | 0.02     |
| 3,000  | NIPPON LIGHT METAL HLDG CO LTD      | 5,139,000      | 0.02     |
| 3,000  | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC          | 4,701,000      | 0.02     |
| 6,000  | HITACHI ZOSEN CORPORATION           | 4,476,000      | 0.02     |
| 3,000  | CHUBU ELEC POWER CO INC             | 3,789,000      | 0.01     |
| 3,000  | KANSAI ELECTRIC POWER CO INC        | 3,447,000      | 0.01     |
| 3,000  | TOYOCO COMPANY LIMITED              | 3,279,000      | 0.01     |
| 3,000  | NIPPON PAPER INDUSTRIES CO LTD      | 3,117,000      | 0.01     |
| 3,000  | OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD        | 2,538,000      | 0.01     |
| 3,000  | KOBE STEEL LTD                      | 1,773,000      | 0.01     |
| 3,000  | RESONA HOLDINGS INC                 | 1,572,300      | 0.01     |
| 3,000  | NIPPON SHEET GLASS CO LTD           | 1,284,000      | 0.00     |
| 3,000  | TOKYO ELEC POWER CO HLDGS INC       | 1,209,000      | 0.00     |
| 3,000  | mitsui e and s holdings             | 1,098,000      | 0.00     |
| 3,000  | MITSUBISHI MOTORS CORP              | 993,000        | 0.00     |
| 3,000  | UNITIKA LTD                         | 873,000        | 0.00     |
| 日本計    |                                     | 23,681,322,600 | 84.53    |
| 組入資産合計 |                                     | 23,681,322,600 | 84.53    |

## 外国為替先渡し契約

2022年3月31日現在

| 通貨(買い) |             | 通貨(売り) |               | 満期日            | 未実現損益(円)    |
|--------|-------------|--------|---------------|----------------|-------------|
| USD    | 3,352,811   | JPY    | 396,641,280   | April 08, 2022 | 11,146,169  |
| USD    | 3,353,576   | JPY    | 396,641,280   | April 20, 2022 | 11,141,089  |
| MXN    | 11,007,808  | JPY    | 62,298,996    | April 20, 2022 | 4,975,035   |
| MXN    | 10,980,985  | JPY    | 62,298,996    | April 08, 2022 | 4,968,793   |
| USD    | 4,198,420   | JPY    | 506,326,680   | April 08, 2022 | 4,308,412   |
| USD    | 4,199,254   | JPY    | 506,326,680   | April 20, 2022 | 4,286,991   |
| MXN    | 12,857,150  | JPY    | 75,909,370    | April 20, 2022 | 2,666,881   |
| MXN    | 12,826,972  | JPY    | 75,909,370    | April 08, 2022 | 2,666,650   |
| RUB    | 3,460,589   | JPY    | 3,186,247     | April 20, 2022 | 1,867,927   |
| RUB    | 3,737,196   | JPY    | 4,000,000     | April 20, 2022 | 1,458,157   |
| AUD    | 196,246     | JPY    | 16,793,772    | April 08, 2022 | 1,071,093   |
| AUD    | 196,264     | JPY    | 16,793,772    | April 20, 2022 | 1,070,869   |
| MXN    | 9,138,367   | JPY    | 55,293,929    | April 08, 2022 | 686,275     |
| MXN    | 9,159,248   | JPY    | 55,293,929    | April 20, 2022 | 682,659     |
| BRL    | 2,057,895   | JPY    | 51,350,811    | May 06, 2022   | 569,932     |
| AUD    | 240,200     | JPY    | 21,457,972    | April 08, 2022 | 408,096     |
| AUD    | 240,217     | JPY    | 21,457,972    | April 20, 2022 | 407,422     |
| TRY    | 1,053,940   | JPY    | 8,376,691     | April 08, 2022 | 320,357     |
| TRY    | 1,064,212   | JPY    | 8,376,691     | April 20, 2022 | 318,053     |
| TRY    | 962,073     | JPY    | 7,655,526     | April 20, 2022 | 204,736     |
| TRY    | 952,233     | JPY    | 7,655,526     | April 08, 2022 | 202,239     |
| MXN    | 244,856     | JPY    | 1,350,000     | April 08, 2022 | 149,950     |
| TRY    | 676,251     | JPY    | 5,417,721     | April 20, 2022 | 107,335     |
| USD    | 15,151      | JPY    | 1,750,000     | April 08, 2022 | 92,804      |
| TRY    | 667,381     | JPY    | 5,417,721     | April 08, 2022 | 89,470      |
| USD    | 7,823       | JPY    | 900,000       | April 08, 2022 | 51,539      |
| USD    | 5,627       | JPY    | 650,000       | April 08, 2022 | 34,471      |
| MXN    | 37,229      | JPY    | 200,000       | April 08, 2022 | 28,061      |
| AUD    | 4,113       | JPY    | 350,000       | April 08, 2022 | 24,432      |
| MXN    | 27,921      | JPY    | 150,000       | April 08, 2022 | 21,046      |
| EUR    | 2,873       | JPY    | 374,090       | April 20, 2022 | 15,772      |
| MXN    | 18,529      | JPY    | 100,000       | April 08, 2022 | 13,510      |
| AUD    | 2,337       | JPY    | 200,000       | April 08, 2022 | 12,812      |
| USD    | 1,737       | JPY    | 200,000       | April 08, 2022 | 11,361      |
| EUR    | 3,711       | JPY    | 492,498       | April 20, 2022 | 10,947      |
| TRY    | 13,283      | JPY    | 100,000       | April 08, 2022 | 9,617       |
| MXN    | 42,088      | JPY    | 250,000       | April 20, 2022 | 7,226       |
| MXN    | 41,987      | JPY    | 250,000       | April 08, 2022 | 7,211       |
| MXN    | 9,264       | JPY    | 50,000        | April 08, 2022 | 6,755       |
| MXN    | 9,059       | JPY    | 50,000        | April 08, 2022 | 5,500       |
| EUR    | 2,646       | JPY    | 354,557       | April 20, 2022 | 4,450       |
| TRY    | 12,753      | JPY    | 100,000       | April 20, 2022 | 4,197       |
| TRY    | 6,549       | JPY    | 50,000        | April 08, 2022 | 4,047       |
| TRY    | 12,601      | JPY    | 100,000       | April 08, 2022 | 3,990       |
| TRY    | 12,384      | JPY    | 100,000       | April 08, 2022 | 2,199       |
| TRY    | 12,474      | JPY    | 100,000       | April 20, 2022 | 1,921       |
| USD    | 3,068,611   | JPY    | 373,249,803   | April 08, 2022 | (28,307)    |
| USD    | 3,069,264   | JPY    | 373,249,803   | April 20, 2022 | (38,669)    |
| AUD    | 173,520     | JPY    | 15,854,690    | April 08, 2022 | (58,662)    |
| AUD    | 173,536     | JPY    | 15,854,690    | April 20, 2022 | (58,854)    |
| USD    | 83,703,688  | JPY    | 9,629,670,303 | April 08, 2022 | 550,835,803 |
| USD    | 76,143,054  | JPY    | 8,966,317,618 | April 20, 2022 | 292,392,838 |
| MXN    | 272,644,476 | JPY    | 1,505,946,532 | April 08, 2022 | 164,230,689 |
| MXN    | 221,480,688 | JPY    | 1,240,720,910 | April 20, 2022 | 112,854,482 |
| RUB    | 98,142,550  | JPY    | 91,783,934    | April 20, 2022 | 51,552,783  |

| 通貨(買い) |            | 通貨(売り) |               | 満期日            | 未実現損益(円)   |
|--------|------------|--------|---------------|----------------|------------|
| AUD    | 4,954,110  | JPY    | 414,460,132   | April 08, 2022 | 36,525,807 |
| AUD    | 4,476,609  | JPY    | 379,641,533   | April 20, 2022 | 27,834,010 |
| BRL    | 47,487,168 | JPY    | 1,182,575,101 | May 06, 2022   | 15,527,144 |
| TRY    | 16,652,235 | JPY    | 126,534,672   | April 20, 2022 | 9,516,144  |
| TRY    | 17,545,729 | JPY    | 135,710,254   | April 08, 2022 | 9,075,973  |
| EUR    | 66,227     | JPY    | 8,584,303     | April 20, 2022 | 400,068    |
| JPY    | 10,750,000 | USD    | 86,447        | April 20, 2022 | 238,329    |
| JPY    | 10,750,000 | USD    | 86,428        | April 08, 2022 | 238,140    |
| JPY    | 4,900,000  | USD    | 39,676        | April 20, 2022 | 75,445     |
| JPY    | 4,900,000  | USD    | 39,667        | April 08, 2022 | 75,429     |
| JPY    | 3,550,000  | USD    | 28,745        | April 20, 2022 | 54,660     |
| JPY    | 3,550,000  | USD    | 28,738        | April 08, 2022 | 54,647     |
| JPY    | 2,100,000  | BRL    | 81,513        | May 06, 2022   | 43,408     |
| JPY    | 1,700,000  | BRL    | 65,987        | May 06, 2022   | 35,140     |
| JPY    | 10,200,000 | MXN    | 1,665,329     | April 20, 2022 | 22,370     |
| JPY    | 10,200,000 | MXN    | 1,661,479     | April 08, 2022 | 22,035     |
| JPY    | 800,000    | BRL    | 30,949        | May 06, 2022   | 19,156     |
| JPY    | 650,000    | USD    | 5,227         | April 20, 2022 | 14,410     |
| JPY    | 650,000    | USD    | 5,225         | April 08, 2022 | 14,400     |
| JPY    | 5,350,000  | USD    | 43,901        | April 20, 2022 | 11,718     |
| JPY    | 5,350,000  | USD    | 43,892        | April 08, 2022 | 11,601     |
| JPY    | 4,500,000  | USD    | 36,926        | April 20, 2022 | 9,856      |
| JPY    | 4,500,000  | USD    | 36,918        | April 08, 2022 | 9,758      |
| JPY    | 300,000    | MXN    | 48,434        | April 08, 2022 | 3,295      |
| JPY    | 300,000    | MXN    | 48,550        | April 20, 2022 | 3,283      |
| JPY    | 27,500,000 | USD    | 226,134       | April 20, 2022 | 2,849      |
| JPY    | 27,500,000 | USD    | 226,086       | April 08, 2022 | 2,086      |
| JPY    | 850,000    | MXN    | 138,777       | April 20, 2022 | 1,864      |
| JPY    | 850,000    | MXN    | 138,456       | April 08, 2022 | 1,836      |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 532           | April 08, 2022 | 1,564      |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 532           | April 20, 2022 | 1,564      |
| JPY    | 100,000    | MXN    | 16,144        | April 08, 2022 | 1,098      |
| JPY    | 100,000    | MXN    | 16,183        | April 20, 2022 | 1,094      |
| JPY    | 100,000    | AUD    | 1,094         | April 20, 2022 | 371        |
| JPY    | 100,000    | AUD    | 1,094         | April 08, 2022 | 370        |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 547           | April 20, 2022 | 186        |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 547           | April 08, 2022 | 185        |
| JPY    | 1,050,000  | USD    | 8,634         | April 20, 2022 | 109        |
| JPY    | 1,050,000  | USD    | 8,632         | April 08, 2022 | 80         |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 550           | April 20, 2022 | (66)       |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 549           | April 08, 2022 | (67)       |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 553           | April 20, 2022 | (412)      |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 553           | April 08, 2022 | (413)      |
| JPY    | 50,000     | TRY    | 6,159         | April 08, 2022 | (826)      |
| JPY    | 3,300,000  | USD    | 27,146        | April 20, 2022 | (869)      |
| JPY    | 3,350,000  | USD    | 27,557        | April 20, 2022 | (883)      |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 559           | April 20, 2022 | (949)      |
| JPY    | 50,000     | AUD    | 559           | April 08, 2022 | (951)      |
| JPY    | 3,300,000  | USD    | 27,140        | April 08, 2022 | (963)      |
| JPY    | 3,350,000  | USD    | 27,551        | April 08, 2022 | (978)      |
| JPY    | 50,000     | TRY    | 6,241         | April 20, 2022 | (991)      |
| JPY    | 100,000    | BRL    | 4,007         | May 06, 2022   | (1,110)    |
| JPY    | 50,000     | TRY    | 6,219         | April 08, 2022 | (1,321)    |
| JPY    | 50,000     | TRY    | 6,283         | April 20, 2022 | (1,337)    |
| JPY    | 150,000    | AUD    | 1,679         | April 20, 2022 | (2,848)    |
| JPY    | 150,000    | AUD    | 1,679         | April 08, 2022 | (2,853)    |
| JPY    | 100,000    | MXN    | 16,795        | April 08, 2022 | (2,884)    |
| JPY    | 100,000    | MXN    | 16,835        | April 20, 2022 | (2,890)    |

| 通貨(買い) |            | 通貨(売り) |           | 満期日            | 未実現損益(円)  |
|--------|------------|--------|-----------|----------------|-----------|
| JPY    | 300,000    | BRL    | 12,005    | May 06, 2022   | (2,898)   |
| JPY    | 300,000    | BRL    | 12,022    | May 06, 2022   | (3,330)   |
| JPY    | 50,000     | TRY    | 6,510     | April 08, 2022 | (3,726)   |
| JPY    | 100,000    | AUD    | 1,140     | April 20, 2022 | (3,793)   |
| JPY    | 100,000    | AUD    | 1,140     | April 08, 2022 | (3,795)   |
| JPY    | 300,000    | MXN    | 49,984    | April 08, 2022 | (6,198)   |
| JPY    | 300,000    | MXN    | 50,105    | April 20, 2022 | (6,221)   |
| JPY    | 100,000    | AUD    | 1,168     | April 08, 2022 | (6,405)   |
| JPY    | 900,000    | USD    | 7,464     | April 20, 2022 | (7,620)   |
| JPY    | 900,000    | USD    | 7,462     | April 08, 2022 | (7,659)   |
| JPY    | 98,225     | TRY    | 12,866    | April 08, 2022 | (7,951)   |
| JPY    | 250,000    | MXN    | 42,244    | April 08, 2022 | (8,782)   |
| JPY    | 250,000    | MXN    | 42,343    | April 20, 2022 | (8,783)   |
| JPY    | 750,000    | MXN    | 124,234   | April 20, 2022 | (9,260)   |
| JPY    | 750,000    | MXN    | 123,951   | April 08, 2022 | (9,309)   |
| JPY    | 1,500,000  | USD    | 12,416    | April 20, 2022 | (9,828)   |
| JPY    | 1,500,000  | USD    | 12,414    | April 08, 2022 | (9,876)   |
| JPY    | 350,000    | MXN    | 59,142    | April 08, 2022 | (12,295)  |
| JPY    | 350,000    | MXN    | 59,281    | April 20, 2022 | (12,296)  |
| JPY    | 550,000    | USD    | 4,629     | April 20, 2022 | (12,897)  |
| JPY    | 550,000    | USD    | 4,628     | April 08, 2022 | (12,917)  |
| JPY    | 2,050,000  | USD    | 16,969    | April 20, 2022 | (13,431)  |
| JPY    | 2,050,000  | USD    | 16,965    | April 08, 2022 | (13,498)  |
| JPY    | 196,840    | AUD    | 2,340     | April 08, 2022 | (16,261)  |
| JPY    | 300,000    | USD    | 2,606     | April 08, 2022 | (17,041)  |
| JPY    | 700,000    | USD    | 5,918     | April 20, 2022 | (19,663)  |
| JPY    | 700,000    | USD    | 5,917     | April 08, 2022 | (19,670)  |
| JPY    | 2,750,000  | USD    | 22,807    | April 20, 2022 | (23,284)  |
| JPY    | 2,750,000  | USD    | 22,802    | April 08, 2022 | (23,400)  |
| JPY    | 284,530    | AUD    | 3,383     | April 08, 2022 | (23,505)  |
| JPY    | 350,000    | MXN    | 62,210    | April 08, 2022 | (31,092)  |
| JPY    | 1,000,000  | USD    | 8,483     | April 08, 2022 | (31,811)  |
| JPY    | 650,000    | MXN    | 112,588   | April 08, 2022 | (39,701)  |
| JPY    | 650,000    | MXN    | 112,864   | April 20, 2022 | (39,770)  |
| JPY    | 750,000    | MXN    | 129,910   | April 08, 2022 | (45,809)  |
| JPY    | 750,000    | MXN    | 130,228   | April 20, 2022 | (45,889)  |
| JPY    | 1,150,000  | USD    | 9,924     | April 08, 2022 | (57,026)  |
| JPY    | 1,227,640  | USD    | 10,628    | April 08, 2022 | (65,103)  |
| JPY    | 2,650,000  | USD    | 22,359    | April 20, 2022 | (68,825)  |
| JPY    | 2,650,000  | USD    | 22,354    | April 08, 2022 | (68,918)  |
| JPY    | 2,200,000  | USD    | 18,663    | April 08, 2022 | (69,985)  |
| JPY    | 10,200,000 | BRL    | 408,186   | May 06, 2022   | (98,543)  |
| JPY    | 1,264,225  | TRY    | 165,604   | April 08, 2022 | (102,331) |
| JPY    | 4,450,000  | USD    | 37,454    | April 20, 2022 | (104,353) |
| JPY    | 4,450,000  | USD    | 37,446    | April 08, 2022 | (104,510) |
| JPY    | 1,750,000  | AUD    | 20,451    | April 20, 2022 | (111,590) |
| JPY    | 1,750,000  | AUD    | 20,449    | April 08, 2022 | (111,614) |
| JPY    | 6,000,000  | MXN    | 999,691   | April 08, 2022 | (123,952) |
| JPY    | 6,000,000  | MXN    | 1,002,115 | April 20, 2022 | (124,410) |
| JPY    | 909,015    | MXN    | 169,209   | April 08, 2022 | (127,539) |
| JPY    | 2,894,885  | USD    | 25,063    | April 08, 2022 | (153,519) |
| JPY    | 262,550    | RUB    | 314,959   | April 20, 2022 | (197,446) |
| JPY    | 18,050,000 | MXN    | 2,989,920 | April 20, 2022 | (222,845) |
| JPY    | 18,050,000 | MXN    | 2,983,103 | April 08, 2022 | (224,026) |
| JPY    | 1,705,965  | MXN    | 317,559   | April 08, 2022 | (239,354) |
| JPY    | 3,050,000  | MXN    | 542,120   | April 08, 2022 | (270,947) |
| JPY    | 4,196,035  | TRY    | 557,362   | April 08, 2022 | (403,288) |
| JPY    | 595,250    | RUB    | 714,071   | April 20, 2022 | (447,648) |

| 通貨(買い) |                | 通貨(売り) |             | 満期日            | 未実現損益(円)             |
|--------|----------------|--------|-------------|----------------|----------------------|
| JPY    | 10,950,000     | USD    | 94,609      | April 08, 2022 | (556,880)            |
| JPY    | 19,488,517     | AUD    | 230,530     | April 08, 2022 | (1,497,300)          |
| JPY    | 5,000,000      | RUB    | 4,665,835   | April 20, 2022 | (1,814,430)          |
| JPY    | 3,026,510      | RUB    | 3,578,855   | April 20, 2022 | (2,200,390)          |
| JPY    | 64,900,177     | MXN    | 11,984,202  | April 08, 2022 | (8,513,163)          |
| JPY    | 459,015,225    | USD    | 3,967,962   | April 08, 2022 | (23,590,393)         |
| JPY    | 41,800,000     | RUB    | 45,399,065  | April 20, 2022 | (24,505,114)         |
| INR    | 350,000,000    | JPY    | 520,397,850 | April 27, 2022 | 40,295,039           |
| IDR    | 15,430,000,000 | JPY    | 123,132,943 | April 27, 2022 | 7,263,251            |
| CNY    | 5,130,000      | JPY    | 93,205,107  | April 27, 2022 | 4,952,718            |
| INR    | 23,000,000     | JPY    | 35,799,385  | April 27, 2022 | 1,046,148            |
| CNY    | 350,000        | JPY    | 6,520,356   | April 27, 2022 | 176,572              |
| IDR    | 1,070,000,000  | JPY    | 8,883,247   | April 27, 2022 | 159,133              |
| CNY    | 290,000        | JPY    | 5,519,603   | April 27, 2022 | 29,280               |
| IDR    | 850,000,000    | JPY    | 7,197,460   | April 27, 2022 | (14,261)             |
|        |                |        |             |                | <b>1,314,821,206</b> |

## 先物契約

2022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     | 156 | FUT NIKKEI 225 (OSE) | Jun 2022 | 4,341,480,000 | 302,143,640        |
|         |     |                      |          | 4,341,480,000 | 302,143,640        |
|         |     |                      |          |               | <b>302,143,640</b> |

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年8月19日）

作成対象期間（2021年8月20日～2022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ない、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ないます。 |
| 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 | 株式への投資は行ないません。                                       |

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       |  | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|---------|-----------|--|-----------|-----------|---------|
|                   |         | 期 騰 落 中 率 |  |           |           |         |
|                   | 円       | %         |  | %         | %         | 百万円     |
| 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  |
| 20期(2022年 8 月19日) | 10, 199 | △0.0      |  | 57.5      | —         | 7, 850  |

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。  
\* 当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

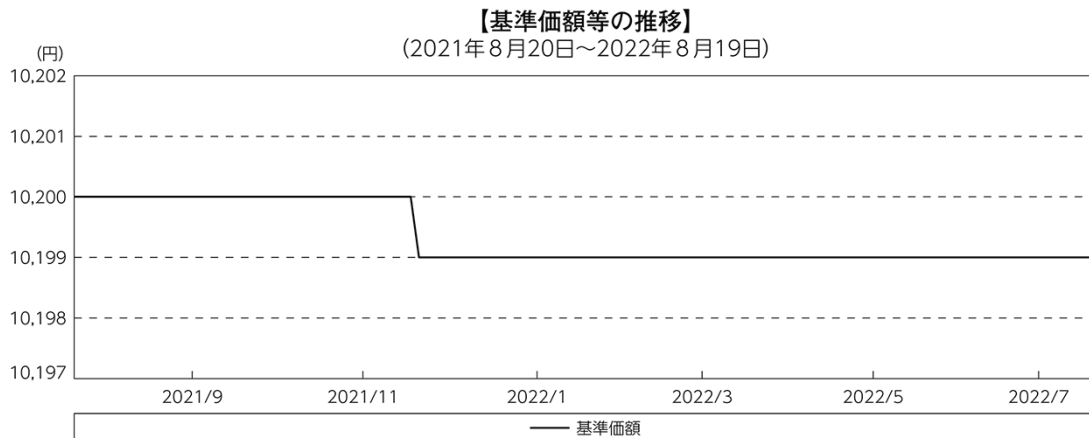
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日                 | 基 準     | 価 額   |  | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|-----------------------|---------|-------|--|-----------|-----------|-----|
|                       |         | 騰 落 率 |  |           |           |     |
| (期 首)<br>2021年 8 月19日 | 円       | %     |  | %         | %         | %   |
|                       | 10, 200 | —     |  | 60.1      | —         | —   |
| 8 月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 56.8      | —         | —   |
| 9 月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 55.1      | —         | —   |
| 10月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 51.6      | —         | —   |
| 11月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 54.5      | —         | —   |
| 12月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 52.1      | —         | —   |
| 2022年 1 月末            | 10, 199 | △0.0  |  | 57.1      | —         | —   |
| 2 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 57.5      | —         | —   |
| 3 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 59.5      | —         | —   |
| 4 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 60.1      | —         | —   |
| 5 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 62.0      | —         | —   |
| 6 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 55.6      | —         | —   |
| 7 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 53.7      | —         | —   |
| (期 末)<br>2022年 8 月19日 | 10, 199 | △0.0  |  | 57.5      | —         | —   |

\* 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による厳しい状況が緩和される中で、消費や雇用環境などには持ち直しの動きが見られました。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12月には、2022年3月末が期限となっていた「新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム」について中小企業向けに部分的な延長を決定しました。

TDB(国庫短期証券)3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね－0.1%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は0～－0.05%程度で推移しました。



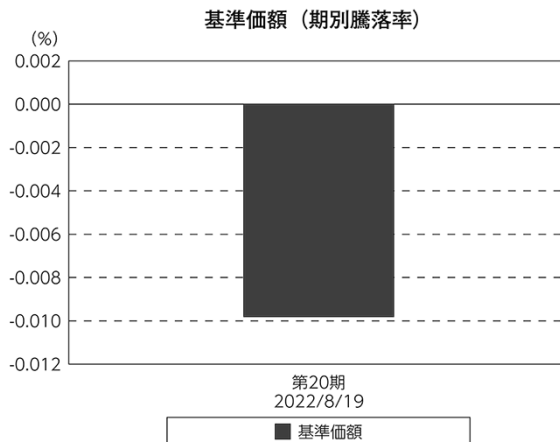
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

(2021年 8 月20日～2022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

(2021年 8 月20日～2022年 8 月19日)

公社債

|            |                | 買 付 額             | 売 付 額                    |
|------------|----------------|-------------------|--------------------------|
| 国<br><br>内 | 地方債証券          | 千円<br>4, 055, 682 | 千円<br>—<br>(4, 600, 000) |
|            | 特殊債券           | 7, 031, 417       | —<br>(6, 457, 000)       |
|            | 社債券（投資法人債券を含む） | 2, 136, 048       | —<br>(3, 130, 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。

○ 利害関係人との取引状況等

(2021年 8 月20日～2022年 8 月19日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A           |               |           | 売付額等<br>C           |               |        |
|-----|---------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|--------|
|     | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ |           | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |        |
| 公社債 | 百万円<br>13, 223      | 百万円<br>30     | %<br>0. 2 | 百万円<br>—            | 百万円<br>—      | %<br>— |

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

○組入資産の明細

(2022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         |               |         |                     | 残存期間別組入比率 |         |         |
|------------|---------------|---------------|---------|---------------------|-----------|---------|---------|
|            | 額 面 金 額       | 評 価 額         | 組 入 比 率 | うちB B格以下<br>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      | 750, 000      | 750, 520      | 9. 6    | —                   | —         | —       | 9. 6    |
|            | ( 750, 000)   | ( 750, 520)   | ( 9. 6) | (—)                 | (—)       | (—)     | ( 9. 6) |
| 特殊債券       | 2, 430, 000   | 2, 431, 889   | 31. 0   | —                   | —         | —       | 31. 0   |
| (除く金融債)    | (2, 430, 000) | (2, 431, 889) | (31. 0) | (—)                 | (—)       | (—)     | (31. 0) |
| 金融債券       | 530, 000      | 530, 049      | 6. 8    | —                   | —         | —       | 6. 8    |
|            | ( 530, 000)   | ( 530, 049)   | ( 6. 8) | (—)                 | (—)       | (—)     | ( 6. 8) |
| 普通社債券      | 800, 000      | 800, 923      | 10. 2   | —                   | —         | —       | 10. 2   |
| (含む投資法人債券) | ( 800, 000)   | ( 800, 923)   | (10. 2) | (—)                 | (—)       | (—)     | (10. 2) |
| 合 計        | 4, 510, 000   | 4, 513, 382   | 57. 5   | —                   | —         | —       | 57. 5   |
|            | (4, 510, 000) | (4, 513, 382) | (57. 5) | (—)                 | (—)       | (—)     | (57. 5) |

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。  
\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。  
\*金額の単位未満は切り捨て。  
\*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。  
\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄                          | 柄 | 当 期 末 |           |           |
|-----------------------------|---|-------|-----------|-----------|
|                             |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     |
| 地方債証券                       |   | %     | 千円        | 千円        |
| 東京都 公募第711回                 |   | 0.82  | 300,000   | 300,218   |
| 福岡県 公募平成24年度第4回             |   | 0.84  | 50,000    | 50,007    |
| 千葉県 公募平成24年度第5回             |   | 0.82  | 100,000   | 100,074   |
| 共同発行市場地方債 公募第114回           |   | 0.82  | 300,000   | 300,220   |
| 小 計                         |   |       | 750,000   | 750,520   |
| 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 財投機関債第96回 |   | 0.796 | 300,000   | 300,221   |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回 |   | 2.28  | 150,000   | 150,305   |
| 地方公共団体金融機構債券 第40回           |   | 0.825 | 110,000   | 110,101   |
| 地方公共団体金融機構債券 第41回           |   | 0.801 | 100,000   | 100,146   |
| 地方公共団体金融機構債券 第42回           |   | 0.801 | 40,000    | 40,086    |
| 日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債        |   | 0.825 | 300,000   | 300,456   |
| 都市再生債券 財投機関債第68回            |   | 0.854 | 200,000   | 200,159   |
| 都市再生債券 財投機関債第71回            |   | 0.767 | 200,000   | 200,131   |
| 日本学生支援債券 財投機関債第60回          |   | 0.001 | 300,000   | 300,000   |
| 日本学生支援債券 財投機関債第61回          |   | 0.001 | 100,000   | 100,000   |
| 国際協力機構債券 第14回財投機関債          |   | 0.825 | 300,000   | 300,221   |
| 東日本高速道路 第48回                |   | 0.09  | 100,000   | 100,032   |
| 西日本高速道路 第37回                |   | 0.09  | 130,000   | 130,016   |
| 西日本高速道路 第38回                |   | 0.09  | 100,000   | 100,010   |
| 小 計                         |   |       | 2,430,000 | 2,431,889 |
| 金融債券                        |   |       |           |           |
| 商工債券 利付第811回い号              |   | 0.17  | 30,000    | 30,018    |
| しんきん中金債券 利付第333回            |   | 0.09  | 200,000   | 200,011   |
| 商工債券 利付(3年)第236回            |   | 0.02  | 300,000   | 300,019   |
| 小 計                         |   |       | 530,000   | 530,049   |
| 普通社債券(含む投資法人債券)             |   |       |           |           |
| 伊藤忠商事 第67回社債間限定同順位特約付       |   | 0.964 | 100,000   | 100,052   |
| 東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付    |   | 2.22  | 100,000   | 100,408   |
| 三井不動産 第46回社債間限定同順位特約付       |   | 0.964 | 200,000   | 200,063   |
| 三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無     |   | 0.929 | 300,000   | 300,205   |
| 電源開発 第35回社債間限定同順位特約付        |   | 1.126 | 100,000   | 100,193   |
| 小 計                         |   |       | 800,000   | 800,923   |
| 合 計                         |   |       | 4,510,000 | 4,513,382 |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年8月19日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 4,513,382 | 57.5  |
| コール・ローン等、その他 | 3,340,370 | 42.5  |
| 投資信託財産総額     | 7,853,752 | 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 (2022年8月19日現在)

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 7,853,752,692  |
| コール・ローン等        | 3,326,621,034  |
| 公社債(評価額)        | 4,513,382,357  |
| 未収利息            | 7,215,305      |
| 前払費用            | 6,533,996      |
| (B) 負債          | 3,470,854      |
| 未払解約金           | 3,470,000      |
| 未払利息            | 854            |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 7,850,281,838  |
| 元本              | 7,697,164,972  |
| 次期繰越損益金         | 153,116,866    |
| (D) 受益権総口数      | 7,697,164,972口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 10,199円        |

(注) 期首元本額は8,979,256,768円、期中追加設定元本額は3,202,453,404円、期中一部解約元本額は4,484,545,200円、1口当たり純資産額は1.0199円です。

## ○損益の状況 (2021年8月20日～2022年8月19日)

| 項 目            | 当 期          |
|----------------|--------------|
|                | 円            |
| (A) 配当等収益      | 23,315,784   |
| 受取利息           | 23,990,043   |
| 支払利息           | △ 674,259    |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 24,456,523 |
| 売買損            | △ 24,456,523 |
| (C) 当期損益金(A＋B) | △ 1,140,739  |
| (D) 前期繰越損益金    | 179,893,174  |
| (E) 追加信託差損益金   | 63,852,596   |
| (F) 解約差損益金     | △ 89,488,165 |
| (G) 計(C＋D＋E＋F) | 153,116,866  |
| 次期繰越損益金(G)     | 153,116,866  |

\*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<br>元本額    |
|-----------------------------------------|---------------|
|                                         | 円             |
| 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)IIプライス(適格機関投資家専用) | 1,941,761,887 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)IIプライス(適格機関投資家専用) | 1,503,668,510 |
| 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)  | 1,248,281,712 |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)              | 441,709,194   |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)  | 188,174,367   |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)               | 128,372,175   |
| 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信                            | 34,318,227    |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                      | 7,492,405     |
| ネクストコア                                  | 2,282,012     |
| 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       |
| 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       |

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

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額 | 円 |
|---------------------------------------|------------|---|
|                                       |            |   |
| 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(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・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型      | 982,609    |   |
| 野村ドイチエ・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(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PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 毎月分配型  | 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PIMCO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PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 毎月分配型  | 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    |   |

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額 | 円 |
|---------------------------------------|------------|---|
|                                       |            |   |
| 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(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信(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信(ブラジルレアルコース) 毎月分配型         | 398,357    |   |
| 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         | 373,897    |   |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース) 毎月分配型             | 177,539    |   |
| 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          | 149,947    |   |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース) 年2回決算型            | 132,547    |   |
| 野村通貨選択日本株投信(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信(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(ブラジルレアルコース) 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(インドネシアルピアコース) 年2回決算型    | 98,261     |   |
| 野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 毎月分配型     | 98,261     |   |
| 野村ドイチエ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 年2回決算型    | 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     |   |
| 野村ドイチエ・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     |   |
| 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     |   |

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

| ファンド名                                    | 当期末   |
|------------------------------------------|-------|
|                                          | 元本額   |
|                                          | 円     |
| 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) 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PIMCO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PIMCO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   |

## ○お知らせ

該当事項はございません。