

ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり／為替ヘッジなし

運用報告書(全体版)

第80期（決算日2022年2月7日） 第81期（決算日2022年3月7日） 第82期（決算日2022年4月7日）
第83期（決算日2022年5月9日） 第84期（決算日2022年6月7日） 第85期（決算日2022年7月7日）

作成対象期間（2022年1月8日～2022年7月7日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|--|---|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／債券 | |
| 信託期間 | 2015年4月28日から2025年7月7日までです。 | |
| 運用方針 | 円建ての外国投資信託であるSuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド(A JPY クラス、B JPY クラス)受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券への投資を通じて、北欧市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券）を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図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、SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド(A JPY クラス、B JPY クラス)受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。 | |
| 主な投資対象 | ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり／為替ヘッジなし | SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド(A JPY クラス、B JPY クラス)受益証券および野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマースナル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |
| | SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド(A JPY クラス、B JPY クラス) | 北欧（ノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランド）市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券）を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村マネーインベストメント 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。 |
| | ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり／為替ヘッジなし | 株式への直接投資は行ないません。外貨建資産への直接投資は行ないません。 |
| 分配方針 | 野村マネーインベストメント マザーファンド | 株式への投資は行ないません。外貨建資産への投資は行ないません。 |
| | 毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に分配を行な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/>

<為替ヘッジあり>

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基 (分配落) | 準 価 額 | | | 債 組 入 比 | 券 率 率 | 債 先 物 比 | 投 資 信 託 証 組 入 比 | 純 資 産 総 額 |
|-----------------|------------|-------|-----|---------------------|------------|----------|------------|--------------------|--------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 期 金 騰 落 中 率 | | | | | |
| | 円 | | 円 | % | % | % | % | 百万円 | |
| 56期(2020年2月7日) | 9,549 | | 30 | 0.9 | 0.0 | — | 98.9 | 16,945 | |
| 57期(2020年3月9日) | 9,316 | | 30 | △ 2.1 | 0.0 | — | 98.9 | 16,443 | |
| 58期(2020年4月7日) | 8,063 | | 30 | △13.1 | 0.0 | — | 98.8 | 13,829 | |
| 59期(2020年5月7日) | 8,243 | | 30 | 2.6 | 0.0 | — | 98.9 | 14,129 | |
| 60期(2020年6月8日) | 8,609 | | 30 | 4.8 | 0.0 | — | 98.9 | 14,743 | |
| 61期(2020年7月7日) | 8,788 | | 30 | 2.4 | 0.0 | — | 98.9 | 15,232 | |
| 62期(2020年8月7日) | 8,844 | | 30 | 1.0 | 0.0 | — | 98.9 | 15,384 | |
| 63期(2020年9月7日) | 9,011 | | 30 | 2.2 | 0.0 | — | 98.9 | 15,799 | |
| 64期(2020年10月7日) | 9,025 | | 30 | 0.5 | 0.0 | — | 98.9 | 15,975 | |
| 65期(2020年11月9日) | 9,000 | | 30 | 0.1 | 0.0 | — | 99.0 | 15,840 | |
| 66期(2020年12月7日) | 9,134 | | 30 | 1.8 | 0.0 | — | 98.8 | 16,106 | |
| 67期(2021年1月7日) | 9,205 | | 30 | 1.1 | 0.0 | — | 98.8 | 16,149 | |
| 68期(2021年2月8日) | 9,312 | | 30 | 1.5 | 0.0 | — | 98.9 | 16,831 | |
| 69期(2021年3月8日) | 9,360 | | 30 | 0.8 | 0.0 | — | 98.9 | 17,079 | |
| 70期(2021年4月7日) | 9,406 | | 30 | 0.8 | 0.0 | — | 98.2 | 17,168 | |
| 71期(2021年5月7日) | 9,445 | | 30 | 0.7 | 0.0 | — | 98.6 | 17,464 | |
| 72期(2021年6月7日) | 9,483 | | 30 | 0.7 | 0.0 | — | 98.5 | 17,876 | |
| 73期(2021年7月7日) | 9,497 | | 30 | 0.5 | 0.0 | — | 98.4 | 18,548 | |
| 74期(2021年8月10日) | 9,507 | | 30 | 0.4 | 0.0 | — | 98.4 | 19,311 | |
| 75期(2021年9月7日) | 9,517 | | 30 | 0.4 | 0.0 | — | 98.6 | 19,605 | |
| 76期(2021年10月7日) | 9,517 | | 30 | 0.3 | 0.0 | — | 98.5 | 20,220 | |
| 77期(2021年11月8日) | 9,511 | | 30 | 0.3 | 0.0 | — | 98.0 | 21,021 | |
| 78期(2021年12月7日) | 9,453 | | 30 | △ 0.3 | 0.0 | — | 98.4 | 21,330 | |
| 79期(2022年1月7日) | 9,481 | | 30 | 0.6 | 0.0 | — | 98.4 | 21,621 | |
| 80期(2022年2月7日) | 9,452 | | 30 | 0.0 | 0.0 | — | 98.6 | 21,841 | |
| 81期(2022年3月7日) | 9,256 | | 30 | △ 1.8 | 0.0 | — | 98.6 | 21,487 | |
| 82期(2022年4月7日) | 9,352 | | 30 | 1.4 | 0.0 | — | 98.7 | 21,983 | |
| 83期(2022年5月9日) | 9,345 | | 30 | 0.2 | 0.0 | — | 98.6 | 22,311 | |
| 84期(2022年6月7日) | 9,273 | | 30 | △ 0.4 | 0.0 | — | 98.0 | 22,202 | |
| 85期(2022年7月7日) | 9,059 | | 30 | △ 2.0 | 0.0 | — | 98.6 | 21,777 | |

* 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。

<為替ヘッジあり>

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|------|------------------------|------------|--------|----------|-------------|-------------|-----------------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| 第80期 | (期 首) 2022年 1 月 7 日 | 円 9,481 | % - | % 0.0 | % - | % 98.4 | |
| | 1 月末 | 9,487 | 0.1 | 0.0 | - | 98.1 | |
| | (期 末) 2022年 2 月 7 日 | 9,482 | 0.0 | 0.0 | - | 98.6 | |
| 第81期 | (期 首) 2022年 2 月 7 日 | 9,452 | - | 0.0 | - | 98.6 | |
| | 2 月末 | 9,363 | △0.9 | 0.0 | - | 97.4 | |
| | (期 末) 2022年 3 月 7 日 | 9,286 | △1.8 | 0.0 | - | 98.6 | |
| 第82期 | (期 首) 2022年 3 月 7 日 | 9,256 | - | 0.0 | - | 98.6 | |
| | 3 月末 | 9,348 | 1.0 | 0.0 | - | 98.2 | |
| | (期 末) 2022年 4 月 7 日 | 9,382 | 1.4 | 0.0 | - | 98.7 | |
| 第83期 | (期 首) 2022年 4 月 7 日 | 9,352 | - | 0.0 | - | 98.7 | |
| | 4 月末 | 9,381 | 0.3 | 0.0 | - | 98.1 | |
| | (期 末) 2022年 5 月 9 日 | 9,375 | 0.2 | 0.0 | - | 98.6 | |
| 第84期 | (期 首) 2022年 5 月 9 日 | 9,345 | - | 0.0 | - | 98.6 | |
| | 5 月末 | 9,304 | △0.4 | 0.0 | - | 97.8 | |
| | (期 末) 2022年 6 月 7 日 | 9,303 | △0.4 | 0.0 | - | 98.0 | |
| 第85期 | (期 首) 2022年 6 月 7 日 | 9,273 | - | 0.0 | - | 98.0 | |
| | 6 月末 | 9,096 | △1.9 | 0.0 | - | 98.2 | |
| | (期 末) 2022年 7 月 7 日 | 9,089 | △2.0 | 0.0 | - | 98.6 | |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

＜為替ヘッジなし＞

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準 (分配落) | 準価額 | | | 債組 入比 | 券率 | 債先 物比 | 券率 | 投資信託 組入比率 | 純資 産額 |
|-----------------|-------------|-----|----|---------------|----------|----|----------|----|--------------|----------|
| | | 税分 | 込配 | み金 期騰 落 | | | | | | |
| | 円 | | 円 | | % | % | % | % | 百万円 | |
| 56期(2020年2月7日) | 7,600 | | 40 | △ 0.0 | 0.2 | — | 98.6 | | 3,545 | |
| 57期(2020年3月9日) | 7,184 | | 40 | △ 4.9 | 0.2 | — | 98.4 | | 3,339 | |
| 58期(2020年4月7日) | 5,988 | | 40 | △16.1 | 0.2 | — | 98.6 | | 2,780 | |
| 59期(2020年5月7日) | 6,104 | | 40 | 2.6 | 0.2 | — | 98.9 | | 2,837 | |
| 60期(2020年6月8日) | 6,850 | | 40 | 12.9 | 0.2 | — | 98.7 | | 3,179 | |
| 61期(2020年7月7日) | 6,810 | | 40 | 0.0 | 0.2 | — | 98.7 | | 3,169 | |
| 62期(2020年8月7日) | 6,968 | | 40 | 2.9 | 0.2 | — | 98.7 | | 3,244 | |
| 63期(2020年9月7日) | 7,120 | | 40 | 2.8 | 0.2 | — | 98.7 | | 3,307 | |
| 64期(2020年10月7日) | 6,987 | | 40 | △ 1.3 | 0.2 | — | 98.6 | | 3,217 | |
| 65期(2020年11月9日) | 6,867 | | 40 | △ 1.1 | 0.2 | — | 98.8 | | 3,173 | |
| 66期(2020年12月7日) | 7,184 | | 40 | 5.2 | 0.2 | — | 98.7 | | 3,281 | |
| 67期(2021年1月7日) | 7,315 | | 40 | 2.4 | 0.2 | — | 98.7 | | 3,314 | |
| 68期(2021年2月8日) | 7,432 | | 40 | 2.1 | 0.2 | — | 98.3 | | 3,307 | |
| 69期(2021年3月8日) | 7,595 | | 40 | 2.7 | 0.2 | — | 98.6 | | 3,358 | |
| 70期(2021年4月7日) | 7,717 | | 40 | 2.1 | 0.2 | — | 97.7 | | 3,339 | |
| 71期(2021年5月7日) | 7,822 | | 40 | 1.9 | 0.2 | — | 98.5 | | 3,256 | |
| 72期(2021年6月7日) | 7,913 | | 40 | 1.7 | 0.2 | — | 98.4 | | 3,290 | |
| 73期(2021年7月7日) | 7,757 | | 40 | △ 1.5 | 0.2 | — | 98.1 | | 3,260 | |
| 74期(2021年8月10日) | 7,652 | | 40 | △ 0.8 | 0.2 | — | 98.5 | | 3,149 | |
| 75期(2021年9月7日) | 7,715 | | 40 | 1.3 | 0.2 | — | 98.4 | | 3,186 | |
| 76期(2021年10月7日) | 7,728 | | 40 | 0.7 | 0.2 | — | 98.3 | | 3,154 | |
| 77期(2021年11月8日) | 7,910 | | 40 | 2.9 | 0.2 | — | 98.2 | | 3,198 | |
| 78期(2021年12月7日) | 7,563 | | 40 | △ 3.9 | 0.2 | — | 98.2 | | 3,119 | |
| 79期(2022年1月7日) | 7,785 | | 40 | 3.5 | 0.2 | — | 98.3 | | 3,222 | |
| 80期(2022年2月7日) | 7,779 | | 40 | 0.4 | 0.2 | — | 98.3 | | 3,229 | |
| 81期(2022年3月7日) | 7,343 | | 40 | △ 5.1 | 0.0 | — | 98.3 | | 3,102 | |
| 82期(2022年4月7日) | 8,087 | | 40 | 10.7 | 0.0 | — | 98.3 | | 3,451 | |
| 83期(2022年5月9日) | 8,148 | | 40 | 1.2 | 0.0 | — | 98.2 | | 3,438 | |
| 84期(2022年6月7日) | 8,071 | | 40 | △ 0.5 | 0.0 | — | 97.3 | | 3,452 | |
| 85期(2022年7月7日) | 7,844 | | 40 | △ 2.3 | 0.0 | — | 98.4 | | 3,425 | |

* 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。

<為替ヘッジなし>

○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 | 債 券 | 投 資 信 託 |
|------|------------------------|------------|--------|----------|--------|-----------|---------|
| | | | 騰 落 率 | 組 入 比 率 | | | |
| 第80期 | (期 首) 2022年 1 月 7 日 | 円 7,785 | % — | % 0.2 | % — | % 98.3 | |
| | 1 月末 | 7,667 | △ 1.5 | 0.2 | — | 97.6 | |
| | (期 末) 2022年 2 月 7 日 | 7,819 | 0.4 | 0.2 | — | 98.3 | |
| 第81期 | (期 首) 2022年 2 月 7 日 | 7,779 | — | 0.2 | — | 98.3 | |
| | 2 月末 | 7,643 | △ 1.7 | 0.0 | — | 97.7 | |
| | (期 末) 2022年 3 月 7 日 | 7,383 | △ 5.1 | 0.0 | — | 98.3 | |
| 第82期 | (期 首) 2022年 3 月 7 日 | 7,343 | — | 0.0 | — | 98.3 | |
| | 3 月末 | 8,124 | 10.6 | 0.0 | — | 97.8 | |
| | (期 末) 2022年 4 月 7 日 | 8,127 | 10.7 | 0.0 | — | 98.3 | |
| 第83期 | (期 首) 2022年 4 月 7 日 | 8,087 | — | 0.0 | — | 98.3 | |
| | 4 月末 | 8,069 | △ 0.2 | 0.0 | — | 97.9 | |
| | (期 末) 2022年 5 月 9 日 | 8,188 | 1.2 | 0.0 | — | 98.2 | |
| 第84期 | (期 首) 2022年 5 月 9 日 | 8,148 | — | 0.0 | — | 98.2 | |
| | 5 月末 | 8,017 | △ 1.6 | 0.0 | — | 97.6 | |
| | (期 末) 2022年 6 月 7 日 | 8,111 | △ 0.5 | 0.0 | — | 97.3 | |
| 第85期 | (期 首) 2022年 6 月 7 日 | 8,071 | — | 0.0 | — | 97.3 | |
| | 6 月末 | 8,120 | 0.6 | 0.0 | — | 97.5 | |
| | (期 末) 2022年 7 月 7 日 | 7,884 | △ 2.3 | 0.0 | — | 98.4 | |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

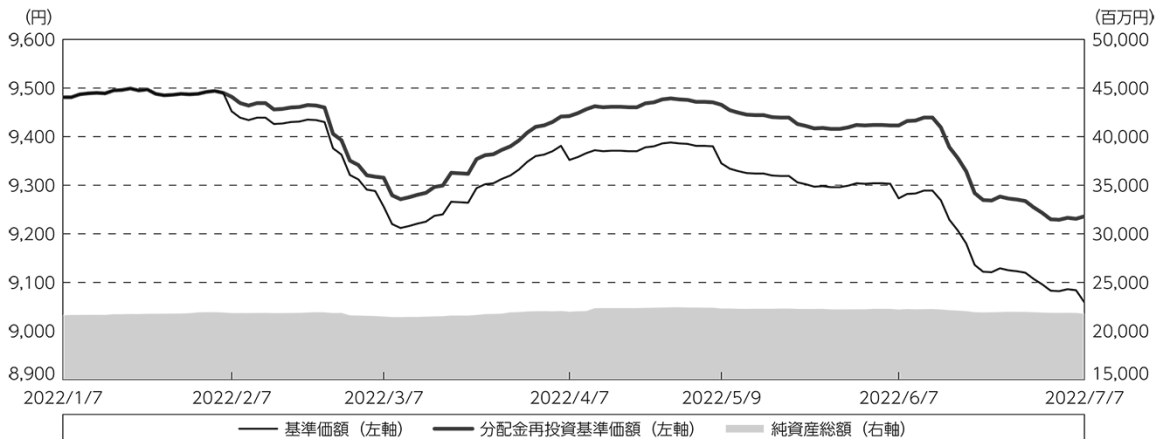
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<為替ヘッジあり>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第80期首：9,481円

第85期末：9,059円 (既払分配金(税込み)：180円)

騰落率：△ 2.6% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2022年1月7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

基準価額は当作成期首の9,481円から当作成期末には9,059円となりました。

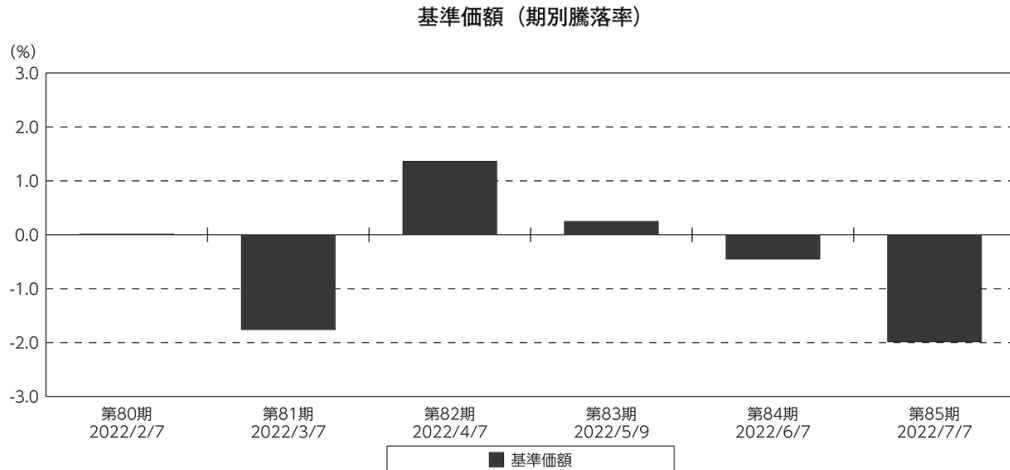
- ・実質的に投資している債券からのインカムゲイン(利息収入)
- ・実質的に投資している債券からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)
- ・為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)またはプレミアム(金利差相当分の収益)

<為替ヘッジあり>

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

<為替ヘッジあり>

◎分配金

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

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

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|-----------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2022年1月8日～ 2022年2月7日 | 2022年2月8日～ 2022年3月7日 | 2022年3月8日～ 2022年4月7日 | 2022年4月8日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月7日 | 2022年6月8日～ 2022年7月7日 |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| (対基準価額比率) | 0.316% | 0.323% | 0.320% | 0.320% | 0.322% | 0.330% |
| 当期の収益 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,223 | 2,246 | 2,274 | 2,297 | 2,321 | 2,345 |

(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。

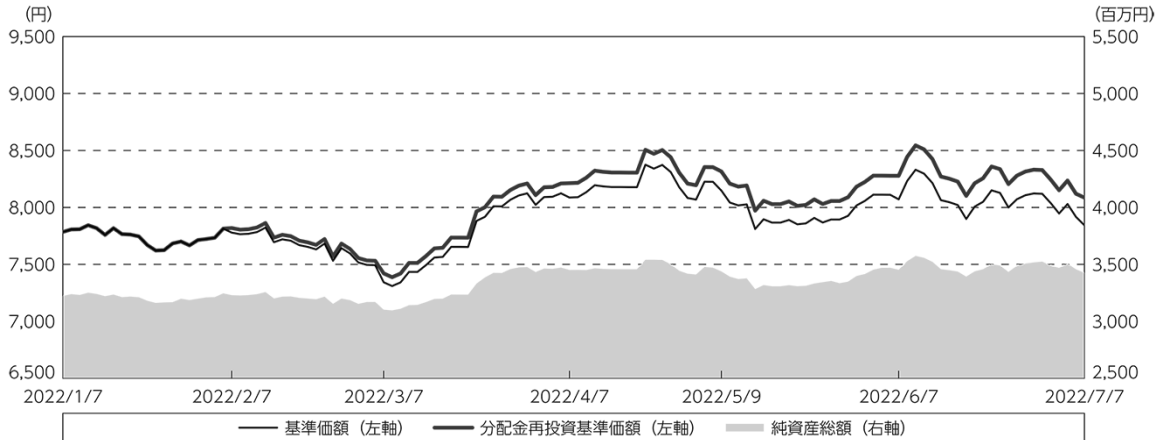
※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

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うけ、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。

<為替ヘッジなし>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第80期首：7,785円

第85期末：7,844円 (既払分配金(税込み)：240円)

騰落率：3.9% (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(2022年1月7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

基準価額は当作成期首の7,785円から当作成期末には7,844円となりました。

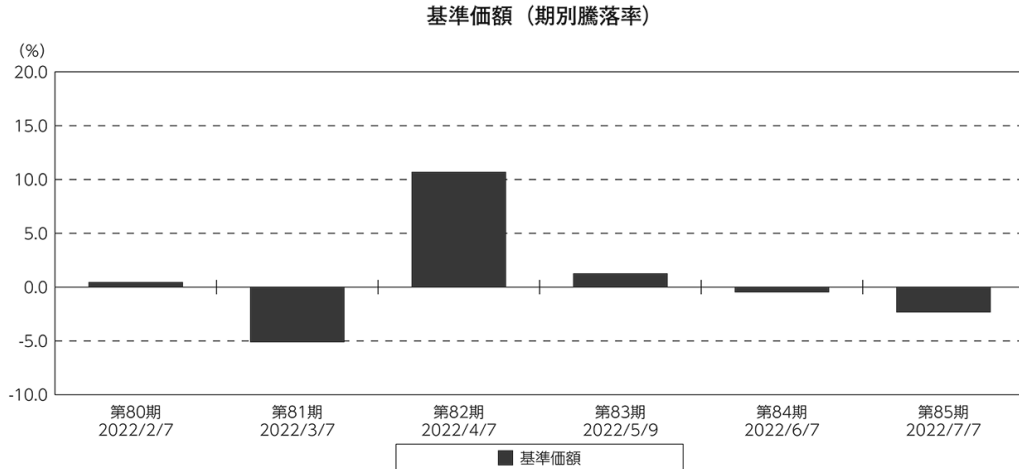
- ・実質的に投資している債券からのインカムゲイン(利息収入)
- ・実質的に投資している債券からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)
- ・ノルウェークローネ、ユーロ、米ドル、スウェーデンクローナなどの対円の為替相場推移

<為替ヘッジなし>

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

<為替ヘッジなし>

◎分配金

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

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

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|-----------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2022年1月8日～ 2022年2月7日 | 2022年2月8日～ 2022年3月7日 | 2022年3月8日～ 2022年4月7日 | 2022年4月8日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月7日 | 2022年6月8日～ 2022年7月7日 |
| 当期分配金 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| (対基準価額比率) | 0.512% | 0.542% | 0.492% | 0.489% | 0.493% | 0.507% |
| 当期の収益 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,495 | 2,530 | 2,570 | 2,605 | 2,640 | 2,675 |

(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。

※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うけ、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。

＜為替ヘッジあり／為替ヘッジなし＞

○投資環境

北欧ハイ・イールド債券市場は、当作成期間では下落しました。北欧各国の経済指標や政策金利、原油価格、個別企業の決算などに左右されました。

為替市場は、当作成期間では、日銀が金融政策決定会合において大規模な金融緩和の維持を決定したこと、インフレへの警戒などから米長期金利が上昇したことや、原油価格が上昇したことなどを受け、米ドルやノルウェークローネは円に対して上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

【ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり】

主要投資対象である [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス] 受益証券および [野村マネーインベストメントマザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス] 受益証券を高位に組み入れました。

【SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス】

主要投資対象である北欧^(※1)市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券）を高位に組み入れました。

(※1) 北欧とはノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランドの5か国を指します。

格付別配分については、BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下及び無格付けの組入比率は、2022年6月末時点で、2.3%、9.7%、76.7%、4.6%としました。

組入資産について、原則として実質的に対円で為替ヘッジを行ないました。

【ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし】

主要投資対象である [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPY クラス] 受益証券および [野村マネーインベストメントマザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPY クラス] 受益証券を高位に組み入れました。

<為替ヘッジあり／為替ヘッジなし>

[SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPY クラス]

主要投資対象である北欧^(※1)市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券）を高位に組み入れました。

(※1) 北欧とはノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランドの5か国を指します。

格付別配分については、BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下及び無格付けの組入比率は、2022年6月末時点で、2.3%、9.7%、76.7%、4.6%としました。

組入資産について、原則として実質的に対円で為替ヘッジを行ないませんでした。

[野村マネーインベストメント 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。

＜為替ヘッジあり／為替ヘッジなし＞

◎今後の運用方針

[ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり]

[SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス] 受益証券および [野村マネーインベストメント マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とします。通常の場合においては、「SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス」の組み入れを高位に維持します。

[SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス]

北欧のマクロ経済の動向や各国中央銀行の金融政策に注目しながら、個別発行体の信用力を十分に調査・分析し、慎重に銘柄選択を行なっていく方針です。

組入資産について、原則として実質的に対円で為替ヘッジを行ないます。

[ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし]

[SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPY クラス] 受益証券および [野村マネーインベストメント マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とします。通常の場合においては、「SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPY クラス」の組み入れを高位に維持します。

[SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B JPY クラス]

北欧のマクロ経済の動向や各国中央銀行の金融政策に注目しながら、個別発行体の信用力を十分に調査・分析し、慎重に銘柄選択を行なっていく方針です。

組入資産について、原則として実質的に対円で為替ヘッジを行ないません。

[野村マネーインベストメント 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、よろしく願いいたします。

＜為替ヘッジあり＞

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 1 月 8 日～2022年 7 月 7 日)

| 項 目 | 第80期～第85期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 48 | % 0.518 | (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 ） | (14) | (0.147) | 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 ） | (33) | (0.355) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (2) | (0.016) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) そ の 他 費 用 | 0 | 0.001 | (b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.001) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| 合 計 | 48 | 0.519 | |
| 作成期間の平均基準価額は、9,329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。

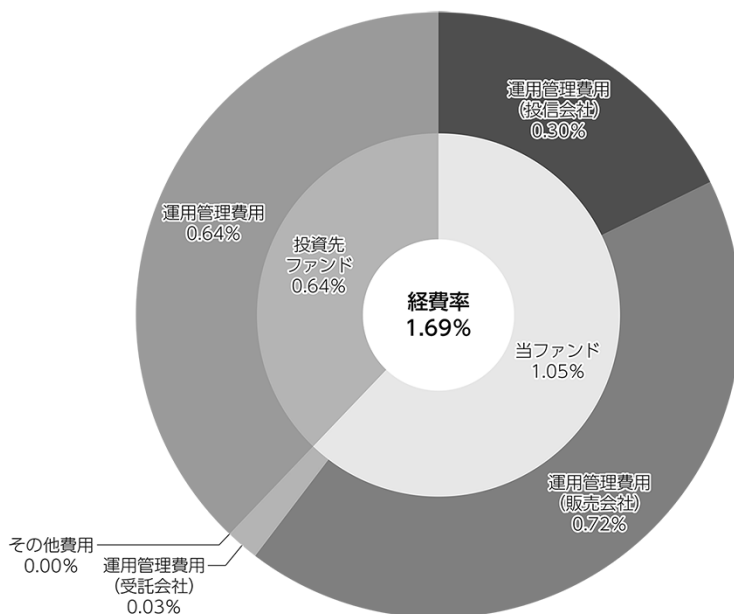
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<為替ヘッジあり>

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.69%です。



(単位: %)

| | |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②) | 1.69 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.05 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.64 |

(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。

<為替ヘッジあり>

○売買及び取引の状況

(2022年1月8日～2022年7月7日)

投資信託証券

| 銘柄 | | 第80期～第85期 | | | |
|----|--|--------------|-----------------|-------------|---------------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | SuMi TRUST インベストメント・ファンズー ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス | 口 228,627 | 千円 1,706,100 | 口 24,050 | 千円 178,500 |

*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1月8日～2022年7月7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7月7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79期末 | 第85期末 | | |
|----|--|-----------|-----------|------------|------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| | | 口 | 口 | 千円 | % |
| | SuMi TRUST インベストメント・ファンズー ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス | 2,788,982 | 2,993,559 | 21,481,779 | 98.6 |
| | 合計 | 2,788,982 | 2,993,559 | 21,481,779 | 98.6 |

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

| 銘柄 | | 第79期末 | 第85期末 | |
|----|-----------------------|-------|-------|-------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 |
| | 野村マネーインベストメント マザーファンド | 9,952 | 9,952 | 9,974 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

〈為替ヘッジあり〉

○投資信託財産の構成

(2022年7月7日現在)

| 項 目 | 第85期末 | |
|-----------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 21,481,779 | 98.1 |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド | 9,974 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 412,987 | 1.9 |
| 投資信託財産総額 | 21,904,740 | 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80期末 | 第81期末 | 第82期末 | 第83期末 | 第84期末 | 第85期末 |
|----------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 2022年2月7日現在 | 2022年3月7日現在 | 2022年4月7日現在 | 2022年5月9日現在 | 2022年6月7日現在 | 2022年7月7日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 21,977,977,565 | 21,666,951,138 | 22,122,441,883 | 22,437,128,762 | 22,300,064,878 | 21,904,740,905 |
| コール・ローン等 | 431,376,450 | 476,656,691 | 410,002,753 | 436,152,134 | 540,269,518 | 412,987,397 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 21,536,625,000 | 21,180,319,327 | 21,702,464,010 | 21,991,001,508 | 21,749,820,240 | 21,481,779,384 |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド(評価額) | 9,976,115 | 9,975,120 | 9,975,120 | 9,975,120 | 9,975,120 | 9,974,124 |
| (B) 負債 | 136,386,286 | 179,861,458 | 138,574,890 | 125,807,512 | 97,682,122 | 127,655,764 |
| 未払金 | — | 58,800,000 | — | — | — | — |
| 未払収益分配金 | 69,324,653 | 69,642,510 | 70,521,347 | 71,623,329 | 71,829,931 | 72,118,975 |
| 未払解約金 | 47,713,885 | 33,906,852 | 48,753,603 | 33,678,446 | 7,323,091 | 36,576,263 |
| 未払信託報酬 | 19,306,911 | 17,475,248 | 19,259,356 | 20,462,496 | 18,489,831 | 18,920,590 |
| 未払利息 | 202 | 66 | 48 | 171 | 353 | 115 |
| その他未払費用 | 40,635 | 36,782 | 40,536 | 43,070 | 38,916 | 39,821 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 21,841,591,279 | 21,487,089,680 | 21,983,866,993 | 22,311,321,250 | 22,202,382,756 | 21,777,085,141 |
| 元本 | 23,108,217,748 | 23,214,170,116 | 23,507,115,836 | 23,874,443,050 | 23,943,310,446 | 24,039,658,630 |
| 次期繰越損益金 | △ 1,266,626,469 | △ 1,727,080,436 | △ 1,523,248,843 | △ 1,563,121,800 | △ 1,740,927,690 | △ 2,262,573,489 |
| (D) 受益権総口数 | 23,108,217,748口 | 23,214,170,116口 | 23,507,115,836口 | 23,874,443,050口 | 23,943,310,446口 | 24,039,658,630口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,452円 | 9,256円 | 9,352円 | 9,345円 | 9,273円 | 9,059円 |

(注) 第80期首元本額は22,806,470,899円、第80～85期中追加設定元本額は2,768,574,376円、第80～85期中一部解約元本額は1,535,386,645円、1口当たり純資産額は、第80期0.9452円、第81期0.9256円、第82期0.9352円、第83期0.9345円、第84期0.9273円、第85期0.9059円です。

＜為替ヘッジあり＞

○損益の状況

| 項 目 | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2022年1月8日～ 2022年2月7日 | 2022年2月8日～ 2022年3月7日 | 2022年3月8日～ 2022年4月7日 | 2022年4月8日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月7日 | 2022年6月8日～ 2022年7月7日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 139,828,875 | 141,031,525 | 142,521,867 | 146,670,889 | 146,811,118 | 148,082,108 |
| 受取配当金 | 139,835,151 | 141,036,489 | 142,523,716 | 146,676,030 | 146,815,965 | 148,090,535 |
| 支払利息 | △ 6,276 | △ 4,964 | △ 1,849 | △ 5,141 | △ 4,847 | △ 8,427 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 117,864,731 | △ 506,610,396 | 171,413,935 | △ 71,571,742 | △ 228,257,220 | △ 569,102,871 |
| 売買益 | 342,652 | 3,471,962 | 171,762,923 | 232,922 | 2,697,208 | 2,905,164 |
| 売買損 | △ 118,207,383 | △ 510,082,358 | △ 348,988 | △ 71,804,664 | △ 230,954,428 | △ 572,008,035 |
| (C) 信託報酬等 | △ 19,347,546 | △ 17,512,030 | △ 19,299,892 | △ 20,505,566 | △ 18,528,747 | △ 18,960,411 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,616,598 | △ 383,090,901 | 294,635,910 | 54,593,581 | △ 99,974,849 | △ 439,981,174 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 154,764,224 | △ 218,380,963 | △ 664,803,736 | △ 437,471,250 | △ 447,371,422 | △ 613,369,947 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 1,045,154,190 | △ 1,055,966,062 | △ 1,082,559,670 | △ 1,108,620,802 | △ 1,121,751,488 | △ 1,137,103,393 |
| (配当等相当額) | (3,556,482,114) | (3,603,175,703) | (3,686,076,353) | (3,782,275,211) | (3,826,100,714) | (3,865,449,720) |
| (売買損益相当額) | (△ 4,601,636,304) | (△ 4,659,141,765) | (△ 4,768,636,023) | (△ 4,890,896,013) | (△ 4,947,852,202) | (△ 5,002,553,113) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 1,197,301,816 | △ 1,657,437,926 | △ 1,452,727,496 | △ 1,491,498,471 | △ 1,669,097,759 | △ 2,190,454,514 |
| (H) 収益分配金 | △ 69,324,653 | △ 69,642,510 | △ 70,521,347 | △ 71,623,329 | △ 71,829,931 | △ 72,118,975 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 1,266,626,469 | △ 1,727,080,436 | △ 1,523,248,843 | △ 1,563,121,800 | △ 1,740,927,690 | △ 2,262,573,489 |
| 追加信託差損益金 | △ 1,045,154,190 | △ 1,055,966,062 | △ 1,082,559,670 | △ 1,108,620,802 | △ 1,121,751,488 | △ 1,137,103,393 |
| (配当等相当額) | (3,556,482,119) | (3,603,175,702) | (3,686,076,352) | (3,782,275,210) | (3,826,100,713) | (3,865,449,718) |
| (売買損益相当額) | (△ 4,601,636,309) | (△ 4,659,141,764) | (△ 4,768,636,022) | (△ 4,890,896,012) | (△ 4,947,852,201) | (△ 5,002,553,111) |
| 分配準備積立金 | 1,580,917,211 | 1,612,727,630 | 1,660,801,127 | 1,703,215,850 | 1,732,950,501 | 1,773,702,509 |
| 繰越損益金 | △ 1,802,389,490 | △ 2,283,842,004 | △ 2,101,490,300 | △ 2,157,716,848 | △ 2,352,126,703 | △ 2,899,172,605 |

* 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(2022年1月8日～2022年7月7日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2022年1月8日～ 2022年2月7日 | 2022年2月8日～ 2022年3月7日 | 2022年3月8日～ 2022年4月7日 | 2022年4月8日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月7日 | 2022年6月8日～ 2022年7月7日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 120,481,599円 | 123,519,429円 | 133,759,674円 | 126,165,264円 | 128,282,267円 | 129,121,533円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金相増後) | 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 | 3,556,482,119円 | 3,603,175,702円 | 3,686,076,352円 | 3,782,275,210円 | 3,826,100,713円 | 3,865,449,718円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 1,529,760,265円 | 1,558,850,711円 | 1,597,562,800円 | 1,648,673,915円 | 1,676,498,165円 | 1,716,699,951円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 5,206,723,983円 | 5,285,545,842円 | 5,417,398,826円 | 5,557,114,389円 | 5,630,881,145円 | 5,711,271,202円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,253円 | 2,276円 | 2,304円 | 2,327円 | 2,351円 | 2,375円 |
| g. 分配金 | 69,324,653円 | 69,642,510円 | 70,521,347円 | 71,623,329円 | 71,829,931円 | 72,118,975円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

<為替ヘッジあり>

○分配金のお知らせ

| | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|------------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30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。

＜為替ヘッジなし＞

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 1 月 8 日～2022年 7 月 7 日)

| 項 目 | 第80期～第85期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 41 | % 0.518 | (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 ） | (12) | (0.147) | 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 ） | (28) | (0.355) | 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 ） | (1) | (0.016) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) そ の 他 費 用 | 0 | 0.001 | (b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.001) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| 合 計 | 41 | 0.519 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,940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。

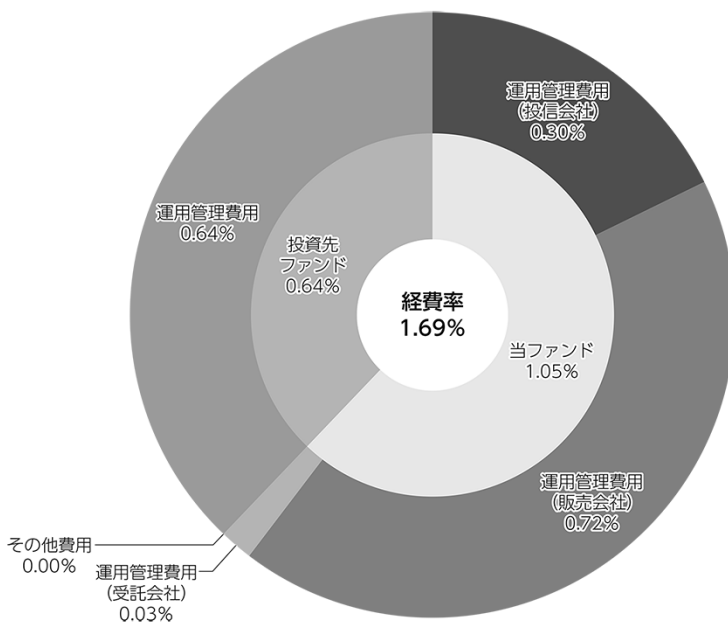
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<為替ヘッジなし>

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.69%です。



(単位: %)

| | |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②) | 1.69 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.05 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.64 |

(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。

<為替ヘッジなし>

○売買及び取引の状況

(2022年1月8日～2022年7月7日)

投資信託証券

| 銘柄 | | 第80期～第85期 | | | |
|----|--|-------------|---------------|-------------|---------------|
| | | 買付 | | 売付 | |
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | SuMi TRUST インベストメント・ファンズー ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B_JPY クラス | 口 65,159 | 千円 372,600 | 口 18,691 | 千円 109,800 |

*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1月8日～2022年7月7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7月7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79期末 | 第85期末 | | |
|--|--------------|--------------|-----------------|-----------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| SuMi TRUST インベストメント・ファンズー ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド B_JPY クラス | 口 553,447 | 口 599,915 | 千円 3,370,322 | % 98.4 |
| 合計 | 553,447 | 599,915 | 3,370,322 | 98.4 |

*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79期末 | 第85期末 | |
|-----------------------|-------------|-------------|-------------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド | 千口 9,952 | 千口 9,952 | 千円 9,974 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

＜為替ヘッジなし＞

○投資信託財産の構成

(2022年7月7日現在)

| 項 目 | 第85期末 | |
|-----------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 3,370,322 | 97.2 |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド | 9,974 | 0.3 |
| コール・ローン等、その他 | 86,566 | 2.5 |
| 投資信託財産総額 | 3,466,862 | 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80期末 | 第81期末 | 第82期末 | 第83期末 | 第84期末 | 第85期末 |
|----------------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2022年2月7日現在 | 2022年3月7日現在 | 2022年4月7日現在 | 2022年5月9日現在 | 2022年6月7日現在 | 2022年7月7日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 3,254,645,403 | 3,162,852,375 | 3,482,038,578 | 3,481,328,506 | 3,476,583,462 | 3,466,862,736 |
| コール・ローン等 | 71,186,716 | 102,575,495 | 68,664,625 | 80,582,606 | 108,362,172 | 86,566,142 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 3,173,482,572 | 3,050,301,760 | 3,392,398,833 | 3,375,570,780 | 3,358,246,170 | 3,370,322,470 |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド(評価額) | 9,976,115 | 9,975,120 | 9,975,120 | 9,975,120 | 9,975,120 | 9,974,124 |
| 未収入金 | — | — | 11,000,000 | 15,200,000 | — | — |
| (B) 負債 | 24,893,153 | 60,671,397 | 30,715,131 | 43,177,770 | 23,822,292 | 41,794,458 |
| 未払金 | — | 32,300,000 | — | 15,000,000 | — | 20,800,000 |
| 未払収益分配金 | 16,607,737 | 16,898,901 | 17,070,099 | 16,879,216 | 17,112,731 | 17,466,132 |
| 未払解約金 | 5,425,856 | 8,900,882 | 10,707,842 | 8,115,150 | 3,913,833 | 533,268 |
| 未払信託報酬 | 2,853,533 | 2,566,207 | 2,931,025 | 3,176,694 | 2,789,796 | 2,988,752 |
| 未払利息 | 33 | 14 | 8 | 31 | 70 | 24 |
| その他未払費用 | 5,994 | 5,393 | 6,157 | 6,679 | 5,862 | 6,282 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,229,752,250 | 3,102,180,978 | 3,451,323,447 | 3,438,150,736 | 3,452,761,170 | 3,425,068,278 |
| 元本 | 4,151,934,407 | 4,224,725,328 | 4,267,524,773 | 4,219,804,077 | 4,278,182,950 | 4,366,533,187 |
| 次期繰越損益金 | △ 922,182,157 | △ 1,122,544,350 | △ 816,201,326 | △ 781,653,341 | △ 825,421,780 | △ 941,464,909 |
| (D) 受益権総口数 | 4,151,934,407口 | 4,224,725,328口 | 4,267,524,773口 | 4,219,804,077口 | 4,278,182,950口 | 4,366,533,187口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,779円 | 7,343円 | 8,087円 | 8,148円 | 8,071円 | 7,844円 |

(注) 第80期首元本額は4,139,577,091円、第80～85期中追加設定元本額は631,058,024円、第80～85期中一部解約元本額は404,101,928円、1口当たり純資産額は、第80期0.7779円、第81期0.7343円、第82期0.8087円、第83期0.8148円、第84期0.8071円、第85期0.7844円です。

＜為替ヘッジなし＞

○損益の状況

| 項 目 | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|---------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2022年1月8日～ 2022年2月7日 | 2022年2月8日～ 2022年3月7日 | 2022年3月8日～ 2022年4月7日 | 2022年4月8日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月7日 | 2022年6月8日～ 2022年7月7日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 32,879,886 | 33,391,016 | 33,991,630 | 33,929,806 | 34,129,447 | 35,169,596 |
| 受取配当金 | 32,880,958 | 33,391,828 | 33,991,907 | 33,930,533 | 34,130,273 | 35,171,102 |
| 支払利息 | △ 1,072 | △ 812 | △ 277 | △ 727 | △ 826 | △ 1,506 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 15,298,387 | △ 196,344,879 | 299,377,681 | 10,448,510 | △ 45,256,584 | △ 113,739,133 |
| 売買益 | 1,179,061 | 956,624 | 301,596,977 | 11,784,550 | 1,265,689 | 95,393 |
| 売買損 | △ 16,477,448 | △ 197,301,503 | △ 2,192,966 | △ 1,336,040 | △ 46,522,273 | △ 113,834,526 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,859,527 | △ 2,571,600 | △ 2,937,182 | △ 3,183,373 | △ 2,795,658 | △ 2,995,034 |
| (D) 当期繰越損益金 (A+B+C) | 14,721,972 | △ 165,525,463 | 330,432,129 | 41,194,943 | △ 13,922,795 | △ 81,564,571 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 285,210,903 | △ 283,472,022 | △ 460,144,542 | △ 142,996,488 | △ 116,744,354 | △ 146,643,899 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 635,085,489 | △ 656,647,964 | △ 669,418,814 | △ 662,972,580 | △ 677,641,900 | △ 695,790,307 |
| (配当等相当額) | (486,006,945) | (511,715,182) | (529,999,818) | (532,511,364) | (557,713,923) | (586,070,316) |
| (売買損益相当額) | (△1,121,092,434) | (△1,168,363,146) | (△1,199,418,632) | (△1,195,483,944) | (△1,235,355,823) | (△1,281,860,623) |
| (G) 計 (D+E+F) | △ 905,574,420 | △ 1,105,645,449 | △ 799,131,227 | △ 764,774,125 | △ 808,309,049 | △ 923,998,777 |
| (H) 収益分配金 | △ 16,607,737 | △ 16,898,901 | △ 17,070,099 | △ 16,879,216 | △ 17,112,731 | △ 17,466,132 |
| 次期繰越損益金 (G+H) | △ 922,182,157 | △ 1,122,544,350 | △ 816,201,326 | △ 781,653,341 | △ 825,421,780 | △ 941,464,909 |
| 追加信託差損益金 | △ 635,085,489 | △ 656,647,964 | △ 669,418,814 | △ 662,972,580 | △ 677,641,900 | △ 695,790,307 |
| (配当等相当額) | (486,006,950) | (511,715,181) | (529,999,817) | (532,511,364) | (557,713,921) | (586,070,311) |
| (売買損益相当額) | (△1,121,092,439) | (△1,168,363,145) | (△1,199,418,631) | (△1,195,483,944) | (△1,235,355,821) | (△1,281,860,618) |
| 分配準備積立金 | 550,200,503 | 557,174,567 | 566,917,724 | 566,911,499 | 571,882,675 | 582,194,881 |
| 繰越損益金 | △ 837,297,171 | △ 1,023,070,953 | △ 713,700,236 | △ 685,592,260 | △ 719,662,555 | △ 827,869,483 |

* 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 (2022年1月8日～2022年7月7日) は以下の通りです。

| 項 目 | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2022年1月8日～ 2022年2月7日 | 2022年2月8日～ 2022年3月7日 | 2022年3月8日～ 2022年4月7日 | 2022年4月8日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月7日 | 2022年6月8日～ 2022年7月7日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 30,020,628円 | 30,819,349円 | 33,691,995円 | 31,495,740円 | 31,333,685円 | 32,174,397円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金相抵後) | 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 | 486,006,950円 | 511,715,181円 | 529,999,817円 | 532,511,364円 | 557,713,921円 | 586,070,311円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 536,787,612円 | 543,254,119円 | 550,295,828円 | 552,294,975円 | 557,661,721円 | 567,486,616円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 1,052,815,190円 | 1,085,788,649円 | 1,113,987,640円 | 1,116,302,079円 | 1,146,709,327円 | 1,185,731,324円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,535円 | 2,570円 | 2,610円 | 2,645円 | 2,680円 | 2,715円 |
| g. 分配金 | 16,607,737円 | 16,898,901円 | 17,070,099円 | 16,879,216円 | 17,112,731円 | 17,466,132円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 |

<為替ヘッジなし>

○分配金のお知らせ

| | 第80期 | 第81期 | 第82期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 |
|------------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40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。

SuMi TRUST インベストメント・ファンダー
ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス/B JPY クラス

2021年3月31日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|--|
| 形 態 | アイルランド籍円建て外国投資信託 |
| 主 要 投 資 対 象 | 北欧(ノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランド)市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債(投資適格債券およびハイ・イールド債券) |
| 運 用 方 針 | 北欧市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。 なお、ファンドは北欧市場の優先証券、国債、政府保証債、地方債、短期金融商品等にも投資します。 |
| 投 資 顧 問 会 社 | DNBアセット・マネジメント・エーエス |
| 受 託 会 社 | SMTトラステーズ(アイルランド)リミテッド |
| 保 管 銀 行 | 三井住友信託銀行ロンドン支店 |
| 管 理 会 社 | SMTファンド・サービシーズ(アイルランド)リミテッド |

*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

2021年3月31日に終了する計測期間

| | |
|----------------------------------|----------------------|
| | ノルウェークローネ |
| 収益 | |
| 利息収入 | 111,981,213 |
| 実現・未実現純損益 | (78,642,661) |
| 収益合計(1) | 33,338,552 |
| 費用 | |
| 投資顧問報酬 | (7,209,293) |
| 事務管理代行報酬 | (2,081,427) |
| 保管費用 | (732,554) |
| 受託費用 | (480,329) |
| 監査費用 | (171,571) |
| 逆イールド費用 | (510,477) |
| 雑費用 | (111,087) |
| 費用合計(2) | (11,296,738) |
| 金融費用控除全損益(1)+(2) | 22,041,814 |
| 金融費用 | |
| 分配金(Class A 円建てヘッジあり) | (118,472,072) |
| 分配金(Class B 円建て) | (35,958,541) |
| 金融費用合計(3) | (154,430,613) |
| 運用の結果による純資産の減額(1)+(2)+(3) | (132,388,799) |

組入資産明細
(2021年3月31日時点)

| | 保有額面 | 公正価格 (ノルウェークローネ) | NAVに占める割合 (%) |
|--|-----------|---------------------|------------------|
| 普通株式 | | | |
| バミューダ諸島 | | | |
| Seddrill Ltd | 34,243 | 60,742 | 0.01 |
| | | 60,742 | 0.01 |
| ジャージー諸島 | | | |
| Lithium Topco | 20,547 | - | - |
| | | - | - |
| ノルウェー | | | |
| Norwegian Air Shuttle | 54 | 3,586 | - |
| | | 3,586 | - |
| 普通株式合計 | | 64,328 | 0.01 |
| 社債 | | | |
| バミューダ諸島 | | | |
| Floatel International 12.75% 11-Apr-24 | 12,750 | 27,210 | - |
| Floatel International 12.75% 11-Apr-24 | 200,000 | 25,609 | - |
| Floatel International 9% 11-Apr-24 | 1,199,000 | 2,695,238 | 0.18 |
| Floatel International 12.75% 31-Dec-49 | 12,750 | 27,210 | - |
| | | 2,775,267 | 0.18 |
| カナダ | | | |
| Sanjel Corp ZCP DFLTD | 41,250 | - | - |
| Sanjel Corp ZCP DFLTD | 41,250 | - | - |
| Sanjel Corp ZCP DFLTD | 41,250 | - | - |
| Sanjel Corp ZCP DFLTD | 41,250 | - | - |
| Sanjel Corp ZCP DFLTD | 41,250 | - | - |
| Shamaram Petrol 12% 05-Jul-23 | 475,000 | 3,808,101 | 0.24 |
| | | 3,808,101 | 0.24 |
| ケイマン諸島 | | | |
| Shelf Drilling 8.25% 15-Feb-25 | 400,000 | 2,499,016 | 0.16 |
| | | 2,499,016 | 0.16 |
| キプロス | | | |
| Prosafe SE 0% 23-Aug-21 | 2,402,224 | 134,525 | 0.01 |
| | | 134,525 | 0.01 |
| デンマーク | | | |
| DKT Finance Aps 7% 17-Jun-23 | 900,000 | 9,259,899 | 0.60 |
| Norican 4.5% 15-May-23 | 2,100,000 | 19,542,096 | 1.26 |
| Welltec 9.5% 01-Dec-22 | 300,000 | 2,535,296 | 0.16 |
| | | 31,337,291 | 2.02 |
| フィンランド | | | |
| Outokumpu 4.125% 18-Jun-24 | 600,000 | 6,125,067 | 0.39 |
| | | 6,125,067 | 0.39 |

| | 保有額面 | 公正価格 (ノルウェークローネ) | NAVに占める割合 (%) |
|--|-----------|---------------------|------------------|
| ドイツ | | | |
| Hormann Finance GMBH 4.5% 06-Jun-24 | 200,000 | 2,121,923 | 0.14 |
| | | 2,121,923 | 0.14 |
| アイルランド | | | |
| Oilflow SPV 1 Dac 12% 13-Jan-22 | 1,500,000 | 7,737,240 | 0.50 |
| | | 7,737,240 | 0.50 |
| ジャージー諸島 | | | |
| Walnut Bidco 6.75% 01-Aug-24 | 1,460,000 | 15,288,629 | 0.98 |
| | | 15,288,629 | 0.98 |
| ルクセンブルク | | | |
| Euronav Luxembourg SA 7.5% 31-May-22 | 800,000 | 7,133,543 | 0.46 |
| Niam VI Lux 5.25% 05-Mar-25 | 185,593 | 1,866,660 | 0.12 |
| Stena Inter 5.75% 01-Mar-24 | 200,000 | 1,730,565 | 0.11 |
| | | 10,730,768 | 0.69 |
| マーシャル諸島 | | | |
| Altera Shuttle Tankers 7.125% 15-Aug-22 | 1,800,000 | 15,627,922 | 1.00 |
| Borealis Finance LLC 7.5% 16-Nov-22 | 700,000 | 6,130,433 | 0.39 |
| Diana Shipping 9.5% 27-Sep-23 | 1,000,000 | 8,831,565 | 0.57 |
| Eagle Bulk Shipping Inc 8.25% 28-Nov-22 | 809,988 | 7,126,957 | 0.46 |
| Navig8 Topco Holdings 12% 03-May-23 | 1,100,000 | 9,624,734 | 0.62 |
| Teekay Corp 9.25% 15-Nov-22 | 800,000 | 6,880,298 | 0.45 |
| | | 54,221,909 | 3.49 |
| モナコ | | | |
| R-Logitech 8.5% 29-Mar-23 | 1,400,000 | 13,058,684 | 0.84 |
| | | 13,058,684 | 0.84 |
| オランダ | | | |
| Metalgroup 7% 06-Jun-22 | 1,400,000 | 12,711,471 | 0.82 |
| | | 12,711,471 | 0.82 |
| ノルウェー | | | |
| DNO ASA 8.75% 31-May-23 | 1,800,000 | 15,688,104 | 1.01 |
| DNO ASA 8.375% 29-May-24 | 1,350,000 | 11,740,149 | 0.75 |
| DOF Subsea ASA 9.5% 14-Mar-22 | 600,000 | 1,399,471 | 0.09 |
| DOF Subsea ASA 0% 31-Dec-49 | 28,500 | 66,475 | 0.00 |
| DOF Subsea ASA 0% 31-Dec-49 | 28,500 | 66,475 | 0.00 |
| Jacktel 0% 01-Mar-21 | 32,500 | 64,272 | 0.00 |
| Jacktel 10% 04-Dec-23 | 1,300,000 | 2,570,864 | 0.17 |
| Norwegian Energy 9% 17-Jun-26 | 2,200,000 | 18,798,749 | 1.21 |
| Wallenius Wilhelmsen 6% 31-Dec-22 | 764,909 | 6,921,302 | 0.45 |
| | | 57,315,861 | 3.68 |
| スウェーデン | | | |
| Goldcup 5.25% 05-Feb-24 | 600,000 | 6,144,426 | 0.39 |
| Point Properties 22-Mar-24 | 6,000,000 | 5,883,562 | 0.38 |
| Stena AB 7% 01-Feb-24 | 3,310,000 | 28,717,434 | 1.85 |
| Transcom Holding 6.5% 22-Mar-23 | 1,200,000 | 12,039,037 | 0.77 |
| | | 52,784,459 | 3.39 |
| イギリス | | | |
| Genel Energy Finance Ltd 9.25% 14-Oct-25 | 1,000,000 | 8,920,486 | 0.57 |
| Siccar Point Energy 9% 04-Mar-26 | 1,400,000 | 11,991,971 | 0.77 |
| Tizir Ltd 9.5% 19-Jul-22 | 1,280,000 | 11,338,640 | 0.73 |
| | | 32,251,097 | 2.07 |

| | 保有額面 | 公正価格 (ノルウェークローネ) | NAVに占める割合 (%) |
|-------------------------------------|------------|---------------------|------------------|
| アメリカ | | | |
| American Tanker Inc 7.75% 02-Jul-25 | 1,400,000 | 12,204,846 | 0.78 |
| | | 12,204,846 | 0.78 |
| 社債合計 | | 317,106,154 | 20.38 |
| 変動利付債 | | | |
| バミューダ諸島 | | | |
| BW Offshore FRN 04-Dec-23 | 13,000,000 | 13,005,417 | 0.84 |
| Gaslog Ltd FRN 27-Nov-24 | 10,000,000 | 10,318,750 | 0.66 |
| Hoegh LNG Holdings FRN 01-Feb-22 | 20,000,000 | 20,223,286 | 1.30 |
| Hoegh LNG Holdings FRN 30-Jan-25 | 2,000,000 | 1,986,050 | 0.13 |
| SFL Corp Ltd FRN 21-Jan-25 | 10,000,000 | 9,508,929 | 0.61 |
| Ship Finance Intl FRN 13-Sep-23 | 8,000,000 | 7,958,571 | 0.51 |
| Ship Finance Intl FRN 04-Jun-24 | 3,000,000 | 2,921,250 | 0.19 |
| Sirius Intl FRN 22-Sep-47 | 18,000,000 | 17,623,256 | 1.13 |
| Stolt-Nielsen Ltd FRN 29-Jun-23 | 10,000,000 | 10,330,357 | 0.66 |
| Stolt-Nielsen Ltd FRN 20-Feb-24 | 10,000,000 | 10,085,714 | 0.65 |
| | | 103,961,580 | 6.68 |
| デンマーク | | | |
| AX V INV1 Holding ApS FRN 29-Jun-22 | 1,500,000 | 15,161,966 | 0.97 |
| Danske Bank FRN Perp 3 | 1,500,000 | 13,758,334 | 0.88 |
| DFDS AS 2.36% 28-Sep-22 | 13,000,000 | 12,832,625 | 0.82 |
| DLF Seeds AS FRN Perp | 1,200,000 | 12,629,203 | 0.81 |
| European Energy AS FRN 20-Sep-23 | 300,000 | 3,137,737 | 0.20 |
| Frontmatec Group ApS FRN 10-Oct-24 | 1,400,000 | 13,348,449 | 0.86 |
| Idavang FRN 11-Dec-21 | 1,200,000 | 12,099,475 | 0.78 |
| Jyske Bank AS FRN Perp 09-Jul-67 | 11,000,000 | 11,376,508 | 0.73 |
| Jyske Bank FRN Perp | 9,000,000 | 9,012,424 | 0.58 |
| Scan Transgroup FRN 04-Nov-24 | 2,000,000 | 20,085,529 | 1.29 |
| Sydbank AS FRN Perp 28-Aug-66 | 1,400,000 | 14,600,704 | 0.95 |
| | | 138,042,954 | 8.87 |
| フィンランド | | | |
| AX Del One Oy FRN 19-Apr-21 | 443,183 | 3,734,918 | 0.24 |
| Havator Group FRN 24-Jan-24 | 600,000 | 6,377,838 | 0.41 |
| Sunborn Finance Oy FRN 09-Feb-23 | 600,000 | 5,252,135 | 0.34 |
| Sunborn London Oy FRN 27-Sep-21 | 456,231 | 4,371,267 | 0.28 |
| | | 19,736,158 | 1.27 |
| フランス | | | |
| Electricite De France SA FRN Perp | 900,000 | 10,289,185 | 0.66 |
| Electricite De France SA FRN Perp 4 | 500,000 | 5,176,338 | 0.33 |
| | | 15,465,523 | 0.99 |
| ドイツ | | | |
| Deutsche Bank FRN Perp | 900,000 | 9,103,726 | 0.59 |
| Momox FRN 10-Jul-25 | 500,000 | 5,198,209 | 0.33 |
| Secop Group FRN 28-Jan-24 | 2,000,000 | 20,516,937 | 1.32 |
| | | 34,818,872 | 2.24 |

| | 保有額面 | 公正価格 (ノルウェークローネ) | NAVに占める割合 (%) |
|-----------------------------------|------------|---------------------|------------------|
| ジブラルタル | | | |
| Sunborn Gibraltar FRN 05-Sep-22 | 1,400,000 | 14,200,188 | 0.91 |
| | | 14,200,188 | 0.91 |
| アイスランド | | | |
| Arion Banking HF FRN 09-Jul-29 | 10,000,000 | 10,347,130 | 0.67 |
| Solis Bond Co FRN 06-Jan-24 | 1,000,000 | 10,183,223 | 0.65 |
| | | 20,530,353 | 1.32 |
| ジャージー諸島 | | | |
| Lithium Bidco II FRN 09-Jul-25 | 553,357 | 4,718,930 | 0.31 |
| Lithium Bidco II FRN 09-Jan-26 | 837,597 | 3,004,211 | 0.19 |
| | | 7,723,141 | 0.50 |
| ルクセンブルク | | | |
| Avanzia Bank FRN 24-Mar-31 | 400,000 | 4,028,142 | 0.26 |
| Avanzia Bank FRN Perp | 3,000,000 | 3,021,563 | 0.19 |
| Jotul Holdings FRN 31-Jan-22 | 11,219,505 | 10,546,335 | 0.68 |
| | | 17,596,040 | 1.13 |
| マーシャル諸島 | | | |
| Golar LNG Partner FRN 22-Nov-21 | 321,628 | 2,747,245 | 0.18 |
| Golar LNG Partner FRN 15-Nov-22 | 753,920 | 6,439,077 | 0.41 |
| Navigator Holdings FRN 02-Nov-23 | 13,000,000 | 13,471,250 | 0.87 |
| Teekay LNG Partners FRN 29-Aug-23 | 9,000,000 | 9,142,500 | 0.59 |
| Teekay LNG Partners FRN 02-Sep-25 | 2,000,000 | 2,030,000 | 0.13 |
| Teekay Offshore PA FRN 28-Oct-21 | 9,000,000 | 9,211,427 | 0.59 |
| | | 43,041,499 | 2.77 |
| オランダ | | | |
| Exmar Netherlands FRN 27-May-22 | 10,000,000 | 9,500,000 | 0.61 |
| Ijsbeer Energie 9.5% 07-Sep-23 | 3,500,000 | 35,158,454 | 2.26 |
| Tulip Oil Neth Off FRN 25-Oct-22 | 1,400,000 | 14,463,688 | 0.93 |
| | | 59,122,142 | 3.80 |
| ノルウェー | | | |
| ABAX AS FRN 23-Jun-25 | 12,500,000 | 12,822,916 | 0.82 |
| Ainmt Scandinavia FRN 07-Apr-22 | 6,000,000 | 6,036,600 | 0.39 |
| Aker ASA FRN 07-Sep-22 | 8,000,000 | 8,389,240 | 0.54 |
| Aker ASA FRN 31-Jan-23 | 15,000,000 | 15,183,750 | 0.98 |
| Aker ASA FRN 22-Nov-24 | 2,000,000 | 1,968,750 | 0.13 |
| Aker Solutions ASA FRN 25-Jul-22 | 15,000,000 | 14,943,750 | 0.96 |
| Axactor SE FRN 12-Jan-24 | 2,300,000 | 23,854,074 | 1.53 |
| B2 Holding ASA FRN 04-Oct-21 | 800,000 | 8,271,987 | 0.53 |
| B2 Holdings ASA FRN 14-Nov-22 | 1,200,000 | 12,125,810 | 0.78 |
| B2 Holding ASA FRN 23-May-23 | 200,000 | 2,019,923 | 0.13 |
| B2 Holding ASA FRN 28-May-24 | 800,000 | 8,311,115 | 0.53 |
| Bakkegruppen FRN 03-Feb-25 | 5,000,000 | 5,075,000 | 0.33 |
| Beerenberg 13-Nov-23 | 12,000,000 | 12,375,000 | 0.80 |
| Bonheur ASA FRN 09-Jul-21 | 8,000,000 | 8,046,728 | 0.52 |
| Bonheur ASA FRN 24-May-22 | 4,000,000 | 4,064,125 | 0.26 |
| Bonheur ASA FRN 04-Sep-24 | 7,000,000 | 7,025,000 | 0.45 |
| Borgestad ASA FRN 08-Jan-23 | 5,000,000 | 4,962,500 | 0.32 |
| Color Group FRN 02-Oct-24 | 2,000,000 | 1,687,500 | 0.11 |
| Colour Group ASA FRN 23-Nov-23 | 6,000,000 | 5,296,250 | 0.34 |
| DNB Bank 6.5% FRN Perp | 1,500,000 | 13,328,742 | 0.86 |

| | 保有額面 | 公正価格 (ノルウェークローネ) | NAVに占める割合 (%) |
|--|------------|---------------------|------------------|
| Ekornes QM FRN 02-Oct-23 | 18,000,000 | 19,188,751 | 1.23 |
| Endur Asa FRN 03-Mar-25 | 4,000,000 | 4,020,000 | 0.26 |
| Fibo Group AS FRN 02-Apr-22 | 7,000,000 | 7,175,000 | 0.46 |
| Fiven AS FRN 05-Apr-22 | 1,000,000 | 10,007,650 | 0.64 |
| Frigaard Property AS FRN 10-Feb-24 | 7,000,000 | 7,035,000 | 0.45 |
| Gjensidige Forsikring FRN Perp | 3,000,000 | 3,031,363 | 0.19 |
| Gjensidige Forsikring FRN Perp | 5,000,000 | 4,996,590 | 0.32 |
| GLX Holding AS FRN 08-Dec-23 | 9,000,000 | 9,171,000 | 0.59 |
| Green Cube Innovation FRN 31-May-22 | 7,000,000 | 6,903,750 | 0.44 |
| Holmetjern Inv FRN 16-Feb-22 | 3,000,000 | 2,535,000 | 0.16 |
| Hospitality Inv FRN 31-Oct-22 | 11,000,000 | 10,917,500 | 0.70 |
| Ice Group Scandinavia FRN 10-Oct-23 | 3,000,000 | 3,193,163 | 0.21 |
| Ice Group Scandinavia FRN 10-Mar-25 | 6,000,000 | 6,057,000 | 0.39 |
| Kistefos AS FRN 10-May-23 | 15,000,000 | 15,037,500 | 0.97 |
| Kistefos AS FRN 11-Sep-24 | 20,000,000 | 20,040,000 | 1.29 |
| Klaveness Comb FRN 11-Feb-25 | 8,000,000 | 7,977,500 | 0.51 |
| Merkantilbygg FRN 28-Sep-22 | 4,000,000 | 4,040,000 | 0.26 |
| Modex AS FRN 02-Mar-26 | 5,000,000 | 5,050,000 | 0.32 |
| MPC Container Ships FRN 22-Sep-22 | 612,294 | 5,298,624 | 0.34 |
| Nordic Capital Partners II FRN 24-Oct-21 | 9,000,000 | 9,090,000 | 0.58 |
| Norlandia Health Care FRN 20-Dec-21 | 4,000,000 | 3,975,625 | 0.26 |
| Norlandia Health FRN 20-Dec-21 | 4,000,000 | 3,901,505 | 0.25 |
| Norske Skog AS FRN 02-Mar-26 | 1,000,000 | 10,077,879 | 0.65 |
| Nortura SA FRN 25-May-78 | 5,000,000 | 5,121,875 | 0.33 |
| Ocean Yield ASA FRN 23-Sep-21 | 2,000,000 | 2,004,660 | 0.13 |
| Ocean Yield ASA FRN 12-Dec-24 | 11,000,000 | 10,928,959 | 0.70 |
| Ocean Yield ASA FRN Perp | 1,000,000 | 8,468,770 | 0.54 |
| Odfjell SE FRN 13-Jun-22 | 6,000,000 | 6,118,125 | 0.39 |
| Odfjell SE FRN 19-Sep-23 | 15,000,000 | 15,306,251 | 0.98 |
| Songa Container FRN 14-Dec-21 | 515,664 | 4,412,893 | 0.28 |
| Storm Real Estate FRN 11-Dec-23 | 10,000,000 | 10,089,416 | 0.65 |
| Wallenius Wilhelmsen FRN 12-Oct-22 | 10,000,000 | 10,025,000 | 0.65 |
| Wallenius Wilhelmsen FRN 09-Sep-24 | 7,500,000 | 7,888,124 | 0.52 |
| | | 434,873,233 | 27.95 |
| スペイン | | | |
| Global Agrajes FRN 22-Dec-25 | 1,000,000 | 10,434,041 | 0.67 |
| | | 10,434,041 | 0.67 |
| スウェーデン | | | |
| AE4 2017 Sweden AB FRN 08-Nov-24 | 3,750,000 | 3,815,334 | 0.25 |
| Bellman Group AB FRN 10-Feb-26 | 7,500,000 | 7,497,573 | 0.48 |
| Betsson AB FRN 26-Sep-22 | 15,000,000 | 15,001,756 | 0.96 |
| Bewi Group AB FRN 19-Apr-22 | 600,000 | 6,144,216 | 0.39 |
| Cabonline Group FRN 09-Dec-22 | 12,500,000 | 9,395,685 | 0.60 |
| Consilium AB FRN Perp 01-Feb-66 | 4,000,000 | 3,990,322 | 0.26 |
| Dilasso Timber AB FRN 08-Jul-23 | 9,350,000 | 9,500,353 | 0.61 |
| Fastator AB FRN 22-Sep-23 | 5,000,000 | 4,974,975 | 0.32 |
| Fastator AB FRN 22-Sep-24 | 3,750,000 | 3,721,830 | 0.24 |
| Fastighets AB Trianon FRN Perp | 6,000,000 | 6,144,080 | 0.39 |
| FNG Nordic AB 6.7% 25-Jul-24 | 15,000,000 | 14,691,776 | 0.94 |
| Genova Property FRN Perp | 3,750,000 | 3,685,893 | 0.24 |

| | 保有額面 | 公正価格 (ノルウェークローネ) | NAVに占める割合 (%) |
|--|------------|----------------------|------------------|
| Heimstaden Bostad FRN Perp | 600,000 | 6,219,040 | 0.40 |
| Hoist Finance AB 8.625% FRN Perp | 900,000 | 8,800,336 | 0.57 |
| Hoist Finance AB FRN Perp 26-Feb-69 | 600,000 | 5,454,425 | 0.35 |
| Hoist Group Holding Intl FRN 29-Jun-21 | 12,000,000 | 11,740,681 | 0.75 |
| Hoist Group Holding Intl FRN 31-Mar-24 | 2,500,000 | 2,478,025 | 0.16 |
| Host Property AB FRN 28-Nov-22 | 6,250,000 | 5,539,475 | 0.36 |
| Klovern AB FRN 04-Apr-22 | 9,000,000 | 8,984,924 | 0.58 |
| Klovern AB FRN Perp 21-Sep-67 | 6,000,000 | 6,001,513 | 0.39 |
| Lansforsakringar Bank FRN Perp 10-Jul-67 | 6,000,000 | 6,218,936 | 0.40 |
| Legres AB FRN 09-Jul-22 | 10,000,000 | 8,644,911 | 0.56 |
| Leovegas AB FRN 10-Dec-23 | 2,500,000 | 2,500,121 | 0.16 |
| Nordea Bank FRN Perp1 | 100,000 | 868,382 | 0.06 |
| North Invest FRN 12-Sep-21 | 5,000,000 | 4,921,282 | 0.32 |
| Nyfosa AB FRN 22-May-22 | 8,750,000 | 8,672,229 | 0.56 |
| Rottneros FRN 01-Sep-22 | 3,000,000 | 3,040,852 | 0.20 |
| Samhallsbyggnadsbolaget FRN Perp 28-Jan-68 | 2,000,000 | 1,954,880 | 0.13 |
| Samhallsbyggnadsbolaget FRN Perp 26-Jul-68 | 300,000 | 3,227,038 | 0.21 |
| SEB 5.125 FRN Perp 13-May-69 | 400,000 | 3,615,656 | 0.23 |
| Skandinaviska Enskilda 5.625% Perp | 400,000 | 3,527,937 | 0.23 |
| Slaetoe Value I FRN 17-Feb-25 | 5,000,000 | 4,947,798 | 0.31 |
| Stendorren Fastigheter FRN 28-Apr-24 | 2,500,000 | 2,456,162 | 0.15 |
| Stendorren Fastigheter FRN Perp | 2,500,000 | 2,525,475 | 0.16 |
| | | 200,903,871 | 12.92 |
| イギリス | | | |
| Barclays Bank FRN Perp | 1,100,000 | 10,432,998 | 0.67 |
| Benchmark Holdings FRN 21-Jun-23 | 7,000,000 | 7,061,250 | 0.45 |
| Independent Oil & Gas FRN 20-Sep-24 | 2,000,000 | 17,996,213 | 1.16 |
| RSA Insurance Group Plc FRN Perp | 9,000,000 | 9,078,618 | 0.58 |
| | | 44,569,079 | 2.86 |
| 変動利付債合計 | | 1,165,018,674 | 74.88 |
| 先渡外国為替取引 | | (52,746,779) | (3.39) |
| 純金融資産合計 | | 1,429,442,377 | 91.88 |
| その他純資産 | | 126,309,721 | 8.12 |
| 純資産合計 | | 1,555,752,098 | 100.00 |

| | 満期日 | 購入 (ノルウェークローネ) | 売却 (ノルウェークローネ) | 未実現利益 (ノルウェークローネ) | 未実現損失 (ノルウェークローネ) |
|--------------------------|------------|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| 店頭金融デリバティブ商品 先渡外国為替取引 | | | | | |
| ユーロ | | | | | |
| Long | 12/04/2021 | (19,798,879) | 19,181,154 | - | (617,725) |
| Short | 12/04/2021 | 455,996,461 | (440,923,700) | 15,072,761 | - |
| | | 436,197,582 | (421,742,546) | 15,072,761 | (617,725) |
| 日本円 | | | | | |
| Long | 12/04/2021 | (1,398,536,645) | 1,324,166,733 | - | (74,369,912) |
| Short | 12/04/2021 | 39,593,307 | (37,935,321) | 1,657,986 | - |
| | | (1,358,943,338) | 1,286,231,412 | 1,657,986 | (74,369,912) |
| スウェーデンクローナ | | | | | |
| Long | 12/04/2021 | (10,215,550) | 9,731,872 | - | (483,678) |
| Short | 12/04/2021 | 204,996,079 | (195,536,579) | 9,459,500 | - |
| | | 194,780,529 | (185,804,707) | 9,459,500 | (483,678) |
| 米ドル | | | | | |
| Long | 12/04/2021 | (28,413,851) | 28,562,346 | 148,495 | - |
| Short | 12/04/2021 | 262,990,449 | (266,604,655) | - | (3,614,206) |
| | | 234,576,598 | (238,042,309) | 148,495 | (3,614,206) |
| 先渡外国為替取引合計 | | (493,388,629) | 440,641,850 | 26,338,742 | (79,085,521) |

店頭金融デリバティブ取引の取引相手先はカストディアンです。

アセットクラス別資産割合

| | |
|---------------|---------------|
| 全資産構成: | % |
| 現金及び現金同等物 | 7.22 |
| 上場有価証券 | 90.17 |
| 店頭金融デリバティブ商品 | 1.60 |
| その他資産 | 1.01 |
| 資産合計 | 100.00 |

野村マネーインベストメント マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日2022年2月18日）

作成対象期間（2021年2月19日～2022年2月18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 | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、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せん。 |
| 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。 外貨建資産への投資は行いません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|-------------|-----|-----------|-----------|--------|------------|
| | | 期騰 | 中率 | | | |
| 8期(2018年2月19日) | 円 10,044 | | % △0.0 | % 23.9 | % — | 百万円 109 |
| 9期(2019年2月18日) | 10,037 | | △0.1 | 33.9 | — | 59 |
| 10期(2020年2月18日) | 10,033 | | △0.0 | 64.8 | — | 20 |
| 11期(2021年2月18日) | 10,029 | | △0.0 | 59.8 | — | 20 |
| 12期(2022年2月18日) | 10,023 | | △0.1 | 0.3 | — | 3,520 |

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

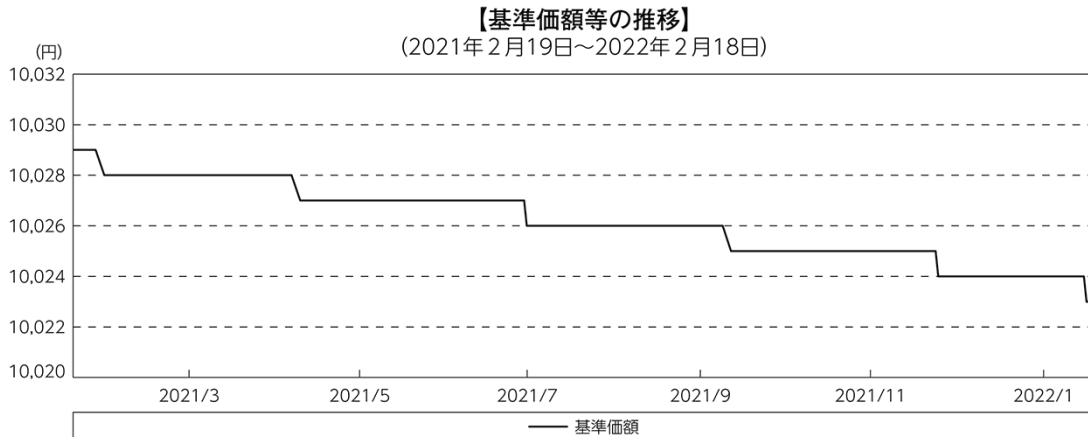
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期首) 2021年2月18日 | 円 10,029 | | % — | % 59.8 | % — |
| 2月末 | 10,029 | | 0.0 | 59.8 | — |
| 3月末 | 10,028 | | △0.0 | 54.5 | — |
| 4月末 | 10,028 | | △0.0 | 54.5 | — |
| 5月末 | 10,027 | | △0.0 | 54.4 | — |
| 6月末 | 10,027 | | △0.0 | 54.4 | — |
| 7月末 | 10,026 | | △0.0 | 54.4 | — |
| 8月末 | 10,026 | | △0.0 | 54.4 | — |
| 9月末 | 10,026 | | △0.0 | 54.4 | — |
| 10月末 | 10,025 | | △0.0 | 54.4 | — |
| 11月末 | 10,025 | | △0.0 | 54.3 | — |
| 12月末 | 10,024 | | △0.0 | 54.3 | — |
| 2022年1月末 | 10,024 | | △0.0 | 54.3 | — |
| (期末) 2022年2月18日 | 10,023 | | △0.1 | 0.3 | — |

*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徐々に緩和されつつある中で、消費や生産、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-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.05%程度で推移しました。

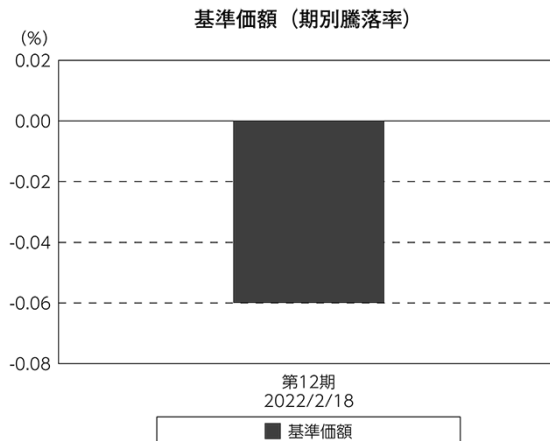
○当ファンドのポートフォリオ

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2月19日～2022年2月18日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2021年2月19日～2022年2月18日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|-------------|---------------------|
| 国内 | 国債証券 | 千円 2,000 | 千円 — (14,000) |
| | 特殊債券 | 21,056 | — (10,000) |

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年2月19日～2022年2月18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2月18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 | % | % | % | % | % | |
| 特殊債券 (除く金融債) | 11,000 (11,000) | 11,006 (11,006) | 0.3 (0.3) | — (—) | — (—) | — (—) | 0.3 (0.3) | |
| 合計 | 11,000 (11,000) | 11,006 (11,006) | 0.3 (0.3) | — (—) | — (—) | — (—) | 0.3 (0.3) | |

*()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 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第39回 | 0.801 | 1,000 | 1,004 | 2022/8/15 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券(6年) 第18回 | 0.001 | 10,000 | 10,002 | 2022/5/30 |
| 合 計 | | | 11,000 | 11,006 | |

*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2月18日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 11,006 | 0.3 |
| コール・ローン等、その他 | 3,509,250 | 99.7 |
| 投資信託財産総額 | 3,520,256 | 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2月18日現在)

○損益の状況 (2021年2月19日~2022年2月18日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 3,520,256,158 |
| コール・ローン等 | 3,509,246,700 |
| 公社債(評価額) | 11,006,474 |
| 未収利息 | 2,961 |
| 前払費用 | 23 |
| (B) 負債 | 2,211 |
| 未払利息 | 2,211 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,520,253,947 |
| 元本 | 3,512,181,953 |
| 次期繰越損益金 | 8,071,994 |
| (D) 受益権総口数 | 3,512,181,953口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,023円 |

(注) 期首元本額は20,014,038円、期中追加設定元本額は3,492,167,915円、期中一部解約元本額は0円、1口当たり純資産額は1.0023円です。

(注) 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

- ・野村スペース国内ベンチャー戦略ファンド2202(適格機関投資家私募制限付) 3,491,968,473円
- ・ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり 9,952,230円
- ・ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし 9,952,230円
- ・ダブル・ブレイン(マイルド) 99,721円
- ・ダブル・ブレイン(ブル) 99,721円
- ・ダブル・ブレイン 99,612円
- ・ノムラ日本株ベータヘッジ戦略ファンド(SMA専用) 9,966円

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|-----------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 32,656 |
| 受取利息 | 42,755 |
| 支払利息 | △ 10,099 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 50,156 |
| 売買損 | △ 50,156 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 17,500 |
| (D) 前期繰越損益金 | 57,409 |
| (E) 追加信託差損益金 | 8,032,085 |
| (F) 計(C+D+E) | 8,071,994 |
| 次期繰越損益金(F) | 8,071,994 |

*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。

○お知らせ

該当事項はございません。