

グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）

運用報告書(全体版)

第1期（決算日2022年9月15日）

作成対象期間（2022年3月14日～2022年9月15日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	2022年3月14日から2031年9月16日までです。	
運用方針	外国投資法人であるノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラスの円建ての外国投資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、債券（新興国を含む世界各国の固定利付および変動利付の債券（国債、政府機関債、社債等。現地通貨建てを含みます。）および債券関連証券等を主要投資対象とし、インカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いません。ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラスの円建ての外国投資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への投資比率は、通常の状態においては、ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラスの円建ての外国投資証券への投資を中心としますが、各証券への投資比率には特に制限は設けず、各証券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	グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド Bコース	外国投資法人であるノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラスの円建ての外国投資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を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス	債券（新興国を含む世界各国の固定利付および変動利付の債券（国債、政府機関債、社債等。現地通貨建てを含みます。）および債券関連証券等を主要投資対象とします。
	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。
主な投資制限	グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド Bコース	株式への直接投資は行いません。外貨建資産への直接投資は行いません。
	野村マネーインベストメント マザーファンド	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 込 配 金	騰 落 率				
(設定日) 2022年3月14日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	百万円 250
1期(2022年9月15日)	10,953	10	9.6	0.0	—	99.0	2,064

*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、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 騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
(設定日) 2022年3月14日	円 10,000	% —	% —	% —
3月末	10,302	3.0	0.0	97.8
4月末	10,610	6.1	0.0	98.8
5月末	10,428	4.3	0.0	91.3
6月末	10,739	7.4	0.0	98.8
7月末	10,672	6.7	0.0	98.5
8月末	10,817	8.2	0.0	99.3
(期 末) 2022年9月15日	10,963	9.6	0.0	99.0

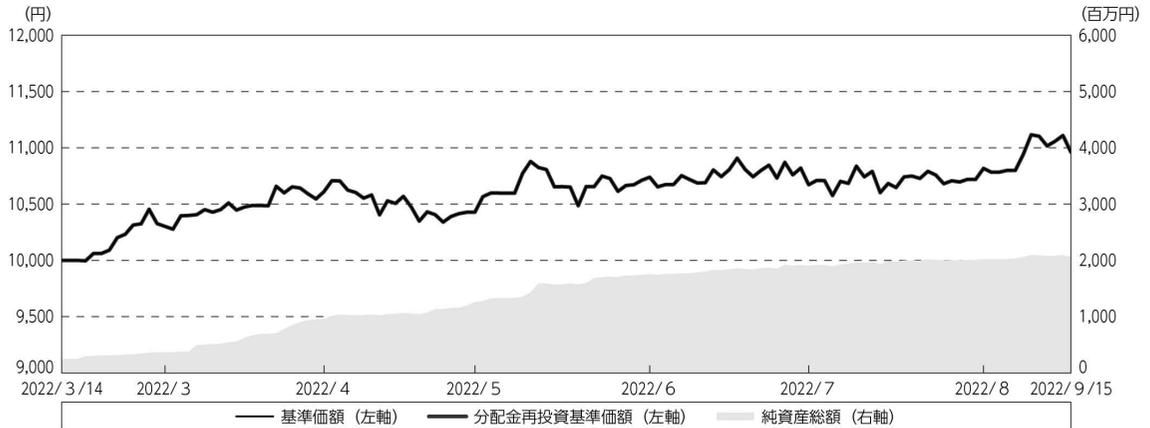
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

*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



設定日：10,000円

期末：10,953円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：9.6%（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。

(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、設定時の10,000円から期末には10,953円となりました。

当ファンドの主な基準価額変動要因は以下の通りです。

- ・実質的に投資している債券関連資産からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・実質的に投資している債券関連資産からのインカムゲイン（利子収入）
- ・実質的に保有する外貨建資産の当該通貨と円の為替変動

新興国債券の保有がマイナスに働きました。FRB（米連邦準備制度理事会）が物価上昇に対応するために大幅な利上げを行なうとの観測が強まり、世界的に債券利回りが上昇（価格は下落）しました。新興国債券についても大きく利回りが上昇したことで、新興国債券の保有が大きくマイナスに影響しました。また期末にかけて先進国の中長期年限の国債を買い、やや金利感応度を大きくしましたが、世界的な物価上昇が長引くとの観測から金利が上昇したため、国

債の保有がマイナスに影響しました。米ドルが、円に対して上昇（円安）したことがプラスに寄与しました。

○投資環境

先進国では経済活動の正常化に伴う景気回復が続いた一方で、中国では新型コロナウイルス対策による都市封鎖を断続的に続けたことが景気の重石となりました。また、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻に対する制裁で、特に欧州諸国へのエネルギー供給に大きな不透明感が出たことや世界的な供給網混乱の長期化を受けて、物価上昇が長期化すると懸念が大きく広がりました。FRBやECB（欧州中央銀行）など先進国の中央銀行は目先の景気よりも、依然として高止まりし続けているインフレの沈静化を優先して、積極的な金融引き締めを実施する姿勢を示したことから、世界的に債券の価格が大きく下落しました。主要国の利上げにより悪影響を受けやすい新興国債券についても利回りが上昇しました。

為替市場では、米国と日本の金利差の大幅な拡大により、米ドルが円に対して上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド Bコース]

[ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス]の円建ての外国投資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] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする[ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス]の円建ての外国投資証券への投資比率を概ね高位に維持しました。

[ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス]

債券組入比率は、概ね高位を維持しました。同ポートフォリオにおける債券種別の投資配分は、国債、金融債などの比率が高めとなりました。またデリバティブを用いてリスク性資産や金利ポジションを一部ヘッジしました。

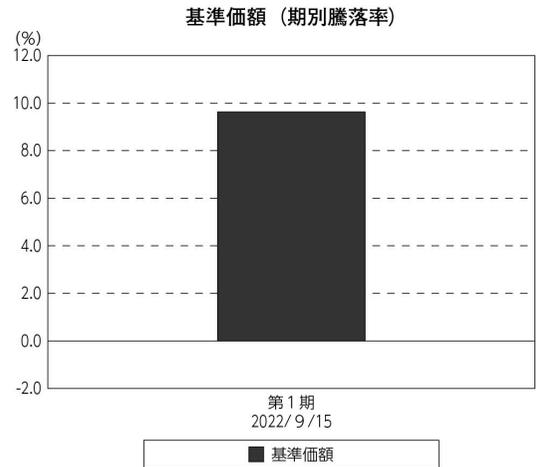
[野村マネーインベストメント マザーファンド]

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。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、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。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

当期の収益分配金は、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第1期
	2022年3月14日～ 2022年9月15日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.091%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	952

(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

[グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド Bコース]

[ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス]の円建ての外国投資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] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする[ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス]の円建ての外国投資証券への投資比率は、概ね90%以上を目処とします。

[ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD JPYクラス]

世界の債券関連資産を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。当ファンドでは、中長期の市場見通しをベースとしながらも、短期のキャピタルゲインも狙うことで、債券市場からの安定した収益を獲得する運用を行ないます。また、債券関連資産の価格変動性が高まると判断した場合には、デリバティブによる機動的なヘッジを導入して、運用効率を高めることを狙います。

[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注意ください。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、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3月14日～2022年9月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	58	0.549	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(15)	(0.140)	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 ）	(42)	(0.392)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝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	58	0.551	
期中の平均基準価額は、10,594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。

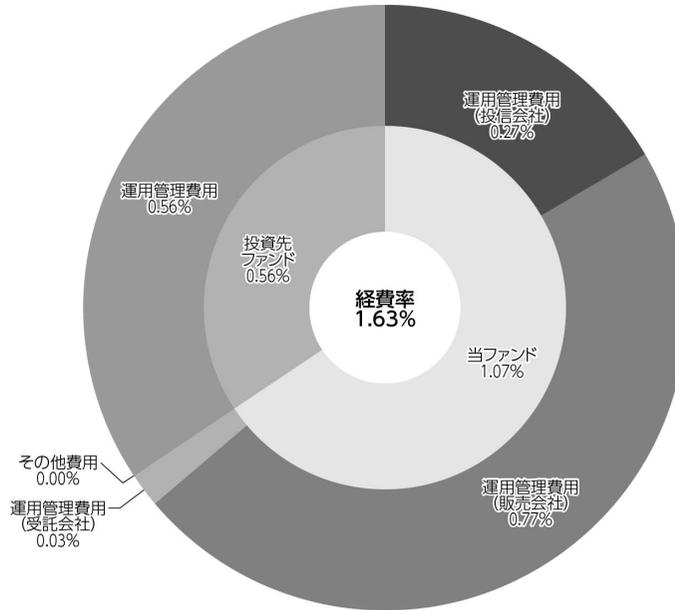
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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1.63%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	1.63
①当ファンドの費用の比率	1.07
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.56

(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3月14日～2022年9月15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・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD_JPYクラス	187,117	1,982,000	1,945	21,000

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	野村マネーインベストメント マザーファンド	30,030	30,100	29,931	30,000

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月14日～2022年9月15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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2022年3月14日～2022年9月15日)

設定時残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取引の理由
百万円 250	百万円 -	百万円 -	百万円 250	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2022年9月15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	当 期 末		
		口 数	評 価 額	比 率
		口	千円	%
	ノムラ・ファンズ・アイルランドーグローバル・ダイナミック・ボンド・ファンドーRD_JPYクラス	185,171	2,043,708	99.0
	合 計	185,171	2,043,708	99.0

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
	野村マネーインベストメント マザーファンド	99	99

*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9月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,043,708	98.5
野村マネーインベストメント マザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	30,582	1.5
投資信託財産総額	2,074,389	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9月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,074,389,707
コール・ローン等	30,580,920
投資信託受益証券(評価額)	2,043,708,797
野村マネーインベストメント マザーファンド(評価額)	99,990
(B) 負債	9,540,539
未払収益分配金	1,885,205
未払解約金	182,204
未払信託報酬	7,450,361
未払利息	26
その他未払費用	22,743
(C) 純資産総額(A-B)	2,064,849,168
元本	1,885,205,366
次期繰越損益金	179,643,802
(D) 受益権総口数	1,885,205,366口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,953円

(注) 期首元本額は250,000,000円、期中追加設定元本額は1,642,756,986円、期中一部解約元本額は7,551,620円、1口当たり純資産額は1,0953円です。

○損益の状況 (2022年3月14日～2022年9月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	11,991,879
受取配当金	11,996,619
支払利息	△ 4,740
(B) 有価証券売買損益	82,502,876
売買益	82,708,759
売買損	△ 205,883
(C) 信託報酬等	△ 7,473,104
(D) 当期損益金(A+B+C)	87,021,651
(E) 追加信託差損益金	94,507,356
(配当等相当額)	(1,188,590)
(売買損益相当額)	(93,318,766)
(F) 計(D+E)	181,529,007
(G) 収益分配金	△ 1,885,205
次期繰越損益金(F+G)	179,643,802
追加信託差損益金	94,507,356
(配当等相当額)	(1,188,590)
(売買損益相当額)	(93,318,766)
分配準備積立金	85,136,446

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

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

* 損益の状況の中で(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。

(注) 分配金の計算過程(2022年3月14日～2022年9月15日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年3月14日～ 2022年9月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	11,043,536円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	75,978,115円
c. 信託約款に定める収益調整金	94,507,356円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	181,529,007円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	962円
g. 分配金	1,885,205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。

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	純資産総額
		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

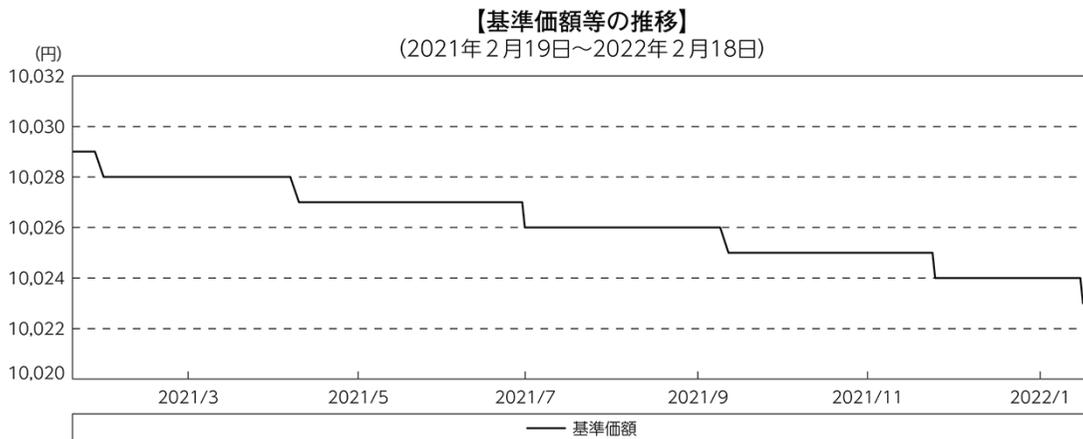
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落		
(期首) 2021年2月18日	円 10,029		% —	% 59.8	% —
2月末	10,029		0.0	59.8	—
3月末	10,028		△0.0	54.5	—
4月末	10,028		△0.0	54.5	—
5月末	10,027		△0.0	54.4	—
6月末	10,027		△0.0	54.4	—
7月末	10,026		△0.0	54.4	—
8月末	10,026		△0.0	54.4	—
9月末	10,026		△0.0	54.4	—
10月末	10,025		△0.0	54.4	—
11月末	10,025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

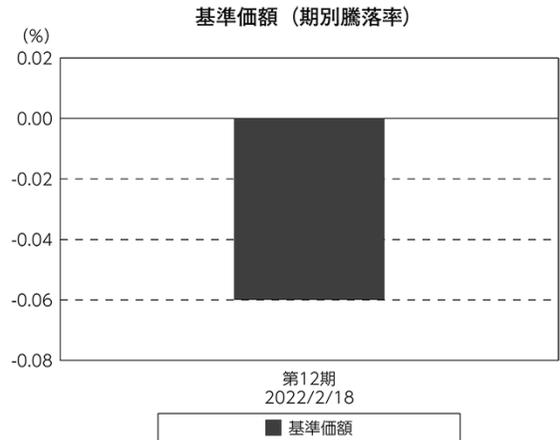
○当ファンドのポートフォリオ

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	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	
特殊債券 (除く金融債)	千円 11,000 (11,000)	千円 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	利 率	当 期		末	
		額 面 金 額	評 価 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	評 価 額	率
公社債	千円 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)

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,520,256,158 円
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

- ・野村スパークス国内ベンチャー戦略ファンド2202(適格機関投資家限定) 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

○損益の状況

(2021年2月19日~2022年2月18日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	32,656 円
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。