

ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース(米ドル売り円買い)／Bコース(為替ヘッジなし)

ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース／ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース

運用報告書(全体版)

第2期(決算日2024年6月17日)

作成対象期間(2023年12月16日～2024年6月17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		Aコース	Bコース
信託期間		追加型投信／内外／株式 2023年8月21日以降、無期限とします。	
運用方針		外国投資法人であるウエリントン・マネージメント・ファンズ(アイルランド)ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS(円ヘッジ有、分配金無)／クラスS(円ヘッジ無、分配金無)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 マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ウエリントン・マネージメント・ファンズ(アイルランド)ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS(円ヘッジ有、分配金無)／クラスS(円ヘッジ無、分配金無)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。 投資する外国投資法人において、米ドル売り円買いの為替取引を行	
主な投資対象		ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース／Bコース	ウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS(円ヘッジ有、分配金無)／クラスS(円ヘッジ無、分配金無)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 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。
主な投資制限		ウエリントン・マネージメント・ファンズ(アイルランド)ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS(円ヘッジ有、分配金無)／クラスS(円ヘッジ無、分配金無) 野村マネー マザーファンド	新興国を含む世界各国の企業の株式を主要投資対象とします。 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
分配方針		ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース／Bコース 野村マネー マザーファンド	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。 株式への投資は行いません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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/>

<Aコース>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分	み 騰 落	中 率				
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円
2023年 8 月 21 日	10,000	—	—	—	—	—	—	3,225
1 期(2023年12月15日)	10,525	0	5.3	0.0	—	98.8	—	5,949
2 期(2024年 6 月 17 日)	11,104	10	5.6	0.0	—	98.4	—	5,781

* 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 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首)	円	%	%	%	%	%
2023年12月15日	10,525	—	0.0	—	98.8	—
12月末	10,641	1.1	0.0	—	98.8	—
2024年 1 月 末	10,728	1.9	0.0	—	99.0	—
2 月 末	10,940	3.9	0.0	—	98.8	—
3 月 末	11,296	7.3	0.0	—	99.1	—
4 月 末	10,939	3.9	0.0	—	98.5	—
5 月 末	11,045	4.9	0.0	—	99.1	—
(期 末)						
2024年 6 月 17 日	11,114	5.6	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。

<Bコース>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分	み 騰 落	中 率				
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円
2023年 8 月 21 日	10,000	—	—	—	—	—	—	30,429
1 期(2023年12月15日)	10,413	0	4.1	0.0	—	98.8		60,113
2 期(2024年 6 月 17 日)	12,528	10	20.4	0.0	—	99.3		71,706

* 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

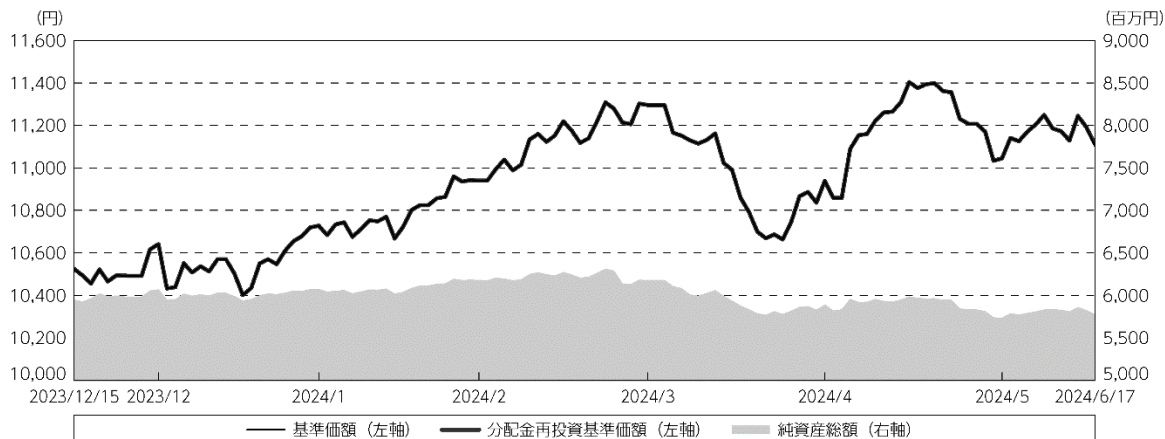
年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首)	円	%	%	%	%	%
2023年12月15日	10,413	—	0.0	—	98.8	
12月末	10,509	0.9	0.0	—	98.4	
2024年 1 月 末	11,141	7.0	0.0	—	98.6	
2 月 末	11,630	11.7	0.0	—	98.6	
3 月 末	12,110	16.3	0.0	—	99.2	
4 月 末	12,192	17.1	0.0	—	99.0	
5 月 末	12,374	18.8	0.0	—	99.0	
(期 末)						
2024年 6 月 17 日	12,538	20.4	0.0	—	99.3	

* 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。

<Aコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：10,525円

期 末：11,104円(既払分配金(税込み)：10円)

騰落率： 5.6%(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(2023年12月15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、期首の10,525円から期末には11,104円となりました。

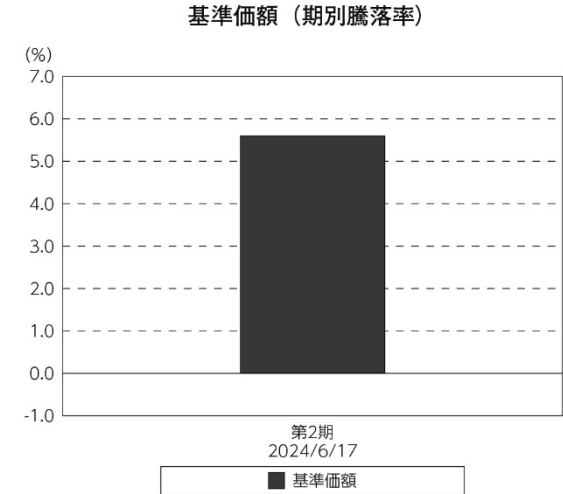
- ・ 実質的に投資している世界株式からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)
- ・ 実質的に投資している世界株式からのインカムゲイン(配当収入)
- ・ 円/米ドル為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)またはプレミアム(金利差相当分の収益)
- ・ 米ドル/投資先通貨の為替変動

<Aコース>

○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

基準価額の水準等を勘案して、1万口当り10円の収益分配を行ないました。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 2 期
	2023年12月16日～ 2024年 6 月17日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.090%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,103

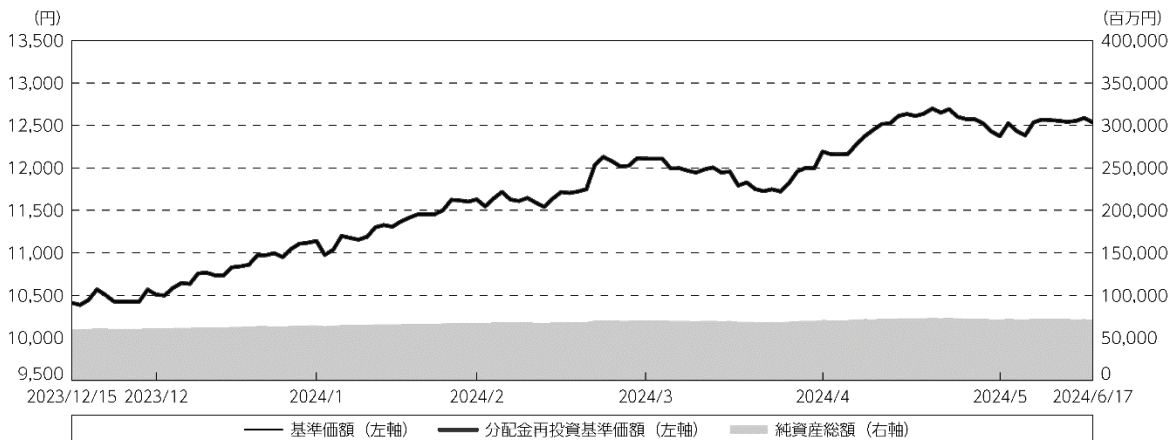
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（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。

<Bコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2023年12月15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、期首の10,413円から期末には12,528円となりました。

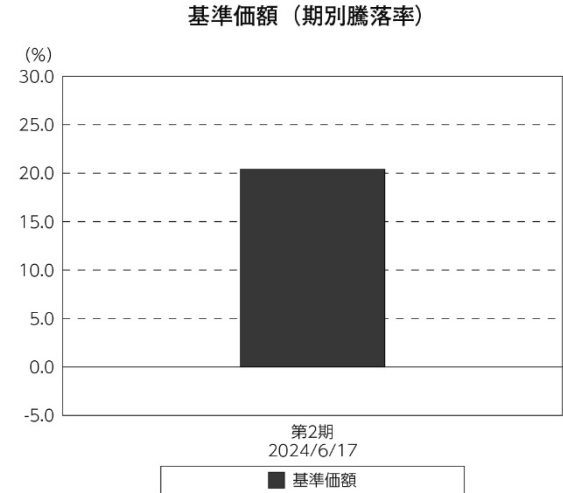
- ・ 実質的に投資している世界株式からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)
- ・ 実質的に投資している世界株式からのインカムゲイン(配当収入)
- ・ 円/投資先通貨の為替変動

<Bコース>

○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

基準価額の水準等を勘案して、1万口当り10円の収益分配を行ないました。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 2 期
	2023年12月16日～ 2024年 6 月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.080%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,527

（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。

＜Aコース／Bコース＞

○投資環境

世界株式市場は、複数の大手IT関連企業が市場予想を上回る決算を公表したことや、米国の早期利下げ期待の高まりなどを背景に、当期間では値上がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

〔ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース〕

〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ有、分配金無）〕 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〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ有、分配金無）〕 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ有、分配金無）〕

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないました。組入外貨建資産については、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行ないました。

〔ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース〕

〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ無、分配金無）〕 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〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ無、分配金無）〕 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ無、分配金無）〕

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないました。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないませんでした。

〔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。

<Aコース／Bコース>

◎今後の運用方針

[ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース]

〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ有、分配金無）〕 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〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ有、分配金無）〕 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

[ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ有、分配金無）]

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないます。組入外貨建資産については、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行ないます。

[ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース]

〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ無、分配金無）〕 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〔ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ無、分配金無）〕 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

[ウエリントン・マネージメント・ファンズ（アイルランド）ーウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS（円ヘッジ無、分配金無）]

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

[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。

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。

<Aコース/Bコース>

◎（ご参考）投資対象とする外国投資法人について

○運用プロセス図

当ファンドが投資対象とする外国投資法人は下記のプロセスに基づいて運用されています。

■ 外国投資法人におけるポートフォリオ構築プロセス ■

Step1:投資ユニバースの構築

- ・新興国を含む世界各国の企業の株式のうち、時価総額が大きく流動性が高い銘柄の中から資本コストを上回る資本利益率を生み出す銘柄を抽出し、投資ユニバースを構築します。
- ・ウエリントン・マネージメント・グループの投資除外方針（核兵器の製造、問題のある武器製造、石炭採掘等、オイルサンドの生産および精製、タバコ関連事業に関連する企業の除外）に従って、一部企業を投資ユニバースから除外します。

Step2:投資候補銘柄の選定（企業調査とESG分析の融合）

企業調査を担当するチームに加え、専任のESG分析を担当するチームの綿密な調査を活用してポートフォリオ・マネージャーが投資候補銘柄を選定します。

- ・企業調査を担当するチームと密接に協働して、ビジネスモデルの優位性や収益性等に着目した調査により、長期的な視点で収益をあげることが期待される優良企業を特定します。
- ・ESG分析を担当するチームと密接に協働して、個別企業の分析や過去の知見の活用等により、業種・地域ごとにスチュワードシップへの優れた取り組みを見せる企業を選定します。

Step3:投資対象銘柄の決定（ポートフォリオ・マネージャーの精緻な分析）

資本利益率とスチュワードシップ評価に焦点を当てた銘柄の評価を行ない、投資対象銘柄を決定します。

- ・各銘柄のスチュワードシップ責任に関する定性的な評価に対してスコアを付与（定量評価）します。
- ・議決権行使やエンゲージメント（対話）を通じて得られる独自の知見を活用します。
- ・なお、企業の本源的価値の評価、経営環境の変化への適応力、企業文化、資本政策等を勘案します。

Step4 : ポートフォリオ構築

- ・ポートフォリオのリスク水準やバリュエーション等を勘案して投資対象銘柄の保有比率を決定します。
なお、ポートフォリオ構築後は、リバランスを通じたポートフォリオの調整を行ないます。
- ・議決権行使やエンゲージメント（対話）を通じて投資先企業の持続可能な成長を促します。
- ・投資先企業のスチュワードシップへのコミットメントに対する信頼が失われた場合、または投資先企業における収益性の悪化からの回復が難しいと判断される場合には当該銘柄を売却します。

※上記ポートフォリオの構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

<Aコース／Bコース>

○主要組入銘柄の解説とESGへの取り組みが企業価値向上に資する理由

組み入れ銘柄の紹介・解説になります。

☆ビザ（米国）**①事業内容**

ビザ（Visa Inc.）はクレジットカード会社です。小売り電子決済ネットワークの運営、国際的な金融サービスの提供に従事しています。金融機関、販売業者、消費者、企業、政府機関などが相互に行なう決済ネットワークやデータ転送サービスを通じて、国際的な商取引を提供しています。

②ESGへの取り組みが企業価値向上に資する理由

高利益率を誇るビジネスモデルです。特に新興国市場において現金決済よりもデジタル決済が増加していることが追い風となっており、そこでは銀行口座を持たない消費者や既存の金融機関のサービスの恩恵を受けることができていない事業者を包摂する点を評価しています。また、デジタル決済へのシフトを進めるために、革新的な技術への投資を惜しまない点も評価しています。加えて同社のサイバーセキュリティは極めて堅牢であり、迅速な異変への対応を可能にしています。

☆リクルートホールディングス（日本）**①事業内容**

リクルートホールディングスは人材サービス会社です。人材技術、マーケティングメディア、人材派遣サービスを提供しています。求人検索エンジン「Indeed」、およびオンライン求人・企業情報サイト「Glassdoor」を運営しています。日本および国外で広告サービス、人材ソリューション、人材派遣サービスを手掛けています。

②ESGへの取り組みが企業価値向上に資する理由

同社は2025年に向けた目標として、2030年までに取締役会を含む従業員のすべての役職レベルにおいて女性比率を50%に引き上げることを目指しており、日本企業としては特に優れたジェンダーギャップ解消の取り組みとして評価するとともに、中長期的には同社の人的資本の強みにつながると考えています。また、人材サービス業は景気後退局面では利益が減退しやすい傾向がありますが、同社の持つ価格決定力によって安定した収益を得ている点も評価しています。

<Aコース／Bコース>

☆ディア（米国）

①事業内容

ディア（Deere & Company）は農機具メーカーです。農業、建設・林業、商業、消費者を対象に各種機械の製造・販売を手掛けています。自社製品および他社製品の交換部品も供給しています。製品・部品を対象とするファイナンス・サービスも手掛けています。

②ESGへの取り組みが企業価値向上に資する理由

幅広いディーラーネットワーク・業界最高水準の技術・ブランド力などの観点から、優れた競争力を兼ね備えた企業であると考えています。同社製品にはソフトウェアやAI（人工知能）の活用が進められており、これらによって効率的な農薬散布や燃費の改善、収穫量の増加などの環境負荷を減らしつつ、顧客である農家に付加価値をもたらしている点を高く評価しています。

○投資対象とする外国投資法人におけるサステナブル投資

①ESGレーティング

投資対象とする外国投資法人は、2023年12月末時点においてE（環境）、S（社会）、G（企業統治）すべての項目において世界株式（MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス）と比較して良好なスコアを示しました。

外国投資法人が投資を行なう企業に対しては、ESGレーティングが付与されます。これは第三者評価機関のデータ等を利用した上で、企業の属するセクターや市場、企業規模などを考慮して同セクター内の基準を定義するものです。スコアは1～5で表され、1が最も優れています。

なおESGレーティングはウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー社独自のメソドロジーによって算出・公表されています。

<Aコース/Bコース>

【外国投資法人とMSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスの比較 ー総合レーティングおよびE・S・Gそれぞれのスコア】

	ESGレーティング	E (環境)	S (社会)	G (企業統治)
外国投資法人	1.9	2.1	2.1	2.1
MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス	2.5	2.3	2.6	2.7

【外国投資法人とMSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスの比較 ー投資先企業のレーティング分布】

	1	2	3	4	5	レーティングなし
外国投資法人	25%	56%	17%	0%	0%	2%
MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス	13%	35%	41%	10%	0%	1%

<使用した指数の著作権等について>

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスは、MSCI社が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。また、MSCIは同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(出所) WELLINGTON GLOBAL STEWARDS FUND QUARTERLY SUSTAINABILITY REPORT

②サステナビリティ指標に関するデータ（2023年12月末時点）

- ・外国投資法人は、ESG特性を重視して選定された銘柄に純資産総額の90%以上投資を行なうことを目標として運用されており、外国投資法人が定める社会や環境に関するスチュワードシップ基準について、一定の基準を満たす企業への純資産総額に対する投資比率は97.37%でした。
- ・外国投資法人において、科学的な根拠に基づいて温室効果ガスの排出削減に向けた目標を定めている、もしくは目標設定に向けてコミットしている企業への純資産総額に対する投資比率は67.00%でした。
- ・外国投資法人において、炭素強度（売上高あたりのスコープ1および2※の温室効果ガス排出量）が、投資先企業が属するセクター平均よりも少なくとも25%以上低い企業への純資産総額に対する投資比率は77.10%でした。

※事業活動に伴う温室効果ガス排出量の範囲を規定したもの
(出所)

Wellington Management Funds (Ireland) plc
Appendix 5 Sustainable Finance Disclosure Regulation (“SFDR”)

<Aコース／Bコース>

○スチュワードシップ活動

投資対象とする外国投資法人では、ポートフォリオ構築プロセスにおいて、議決権行使やエンゲージメント（対話）を通じて得た知見などを活用して投資対象銘柄を決定します。ウエリントン・マネージメント・グループは、議決権行使やエンゲージメント（対話）を通じて、投資先企業の持続可能な成長を促しています。

ウエリントン・マネージメント・グループのスチュワードシップ活動の詳細は、以下のサイト（「野村アセットマネジメントの主なESGファンド」内）「外部委託ファンドのスチュワードシップ方針／スチュワードシップ活動」にある「ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド」の「スチュワードシップの活動はこちら」より、ウエリントン・マネージメント・グループのサイト（英語）にアクセスいただくと、ご覧いただけます。

<https://www.nomura-am.co.jp/special/esg/esg-integration/esglineup.html#esglineup4>

<Aコース>

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年12月16日～2024年 6 月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 56	% 0. 512	(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. 139)	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)	(40)	(0. 361)	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. 011)	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	56	0. 514	
期中の平均基準価額は、10,931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。

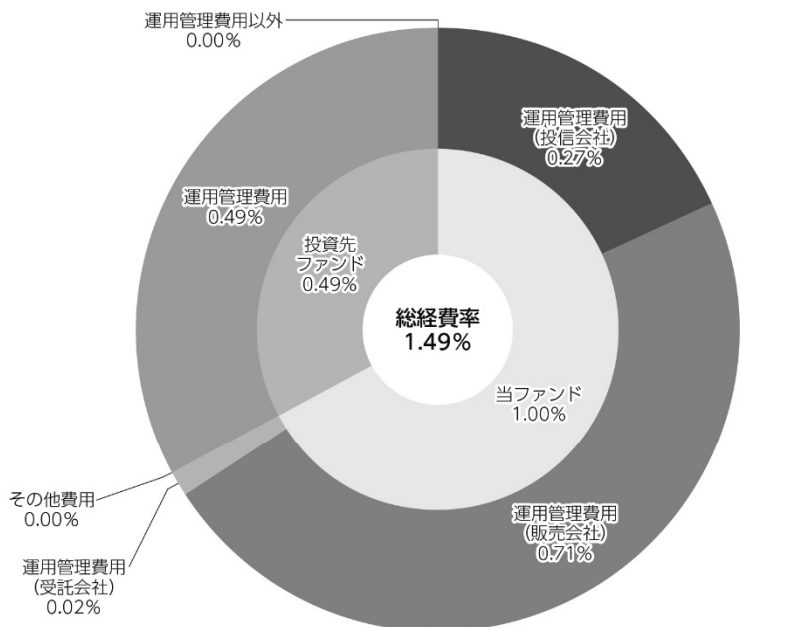
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<Aコース>

(参考情報)

○総経費率

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総経費率（年率）は1.49%です。



(単位：%)

総経費率(①+②+③)	1.49
①当ファンドの費用の比率	1.00
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.49
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00

(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) 当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（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) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。

(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。

<Aコース>

○売買及び取引の状況

(2023年12月16日～2024年 6月17日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ウエリントン・マネージメント・ファンズ (アイルランド) –	口	千円	口	千円
	ウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドー				
	クラスS (円ヘッジ有、分配金無)	8,088	87,900	57,147	640,100

*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

(2023年12月16日～2024年 6月17日)

利害関係人との取引状況

<ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース>

該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 771	百万円 60	% 7.8	百万円 —	百万円 —	% —

平均保有割合 0.0%

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

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

<Aコース>

○組入資産の明細 (2024年6月17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
		口	口	千円	%
ウエリントン・マネージメント・ファンズ(アイルランド)－ウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS (円ヘッジ有、分配金無)		556,004	506,945	5,691,479	98.4
合 計		556,004	506,945	5,691,479	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	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
野村マネー マザーファンド		98	98	100

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成 (2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,691,479	97.6
野村マネー マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	141,391	2.4
投資信託財産総額	5,832,970	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

<Aコース>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,832,970,406
コール・ローン等	75,991,198
投資信託受益証券(評価額)	5,691,479,037
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,000
未収入金	65,400,000
未収利息	171
(B) 負債	51,714,269
未払収益分配金	5,206,544
未払解約金	15,677,687
未払信託報酬	30,729,895
その他未払費用	100,143
(C) 純資産総額(A－B)	5,781,256,137
元本	5,206,544,497
次期繰越損益金	574,711,640
(D) 受益権総口数	5,206,544.497口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,104円

(注) 期首元本額は5,652,678,747円、期中追加設定元本額は368,489,828円、期中一部解約元本額は814,624,078円、1口当たり純資産額は1.1104円です。

○損益の状況 (2023年12月16日～2024年6月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	21,087
受取利息	23,799
支払利息	△ 2,712
(B) 有価証券売買損益	325,556,995
売買益	365,792,294
売買損	△ 40,235,299
(C) 信託報酬等	△ 30,830,038
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	294,748,044
(E) 前期繰越損益金	263,654,859
(F) 追加信託差損益金	21,515,281
(配当等相当額)	(18,299,119)
(売買損益相当額)	(3,216,162)
(G) 計(D＋E＋F)	579,918,184
(H) 収益分配金	△ 5,206,544
次期繰越損益金(G＋H)	574,711,640
追加信託差損益金	21,515,281
(配当等相当額)	(18,299,119)
(売買損益相当額)	(3,216,162)
分配準備積立金	553,196,359

* 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(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 (2023年12月16日～2024年6月17日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年12月16日～ 2024年6月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	18,039円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	294,706,930円
c. 信託約款に定める収益調整金	21,515,281円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	263,677,934円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	579,918,184円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,113円
g. 分配金	5,206,544円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

<Aコース>

○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。

2024年11月 5 日より、ファンドの設定解約の申込締切時間は以下の記載のとおり変更となる予定です。

原則、午後 3 時30分までに、販売会社が受付けた分を当日のお申込み分とします。

（販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。）

<Bコース>

○ 1 万口当たりの費用明細 (2023年12月16日～2024年 6 月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 60	% 0. 512	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(16)	(0. 139)	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. 361)	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. 011)	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	60	0. 514	
期中の平均基準価額は、11,659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。

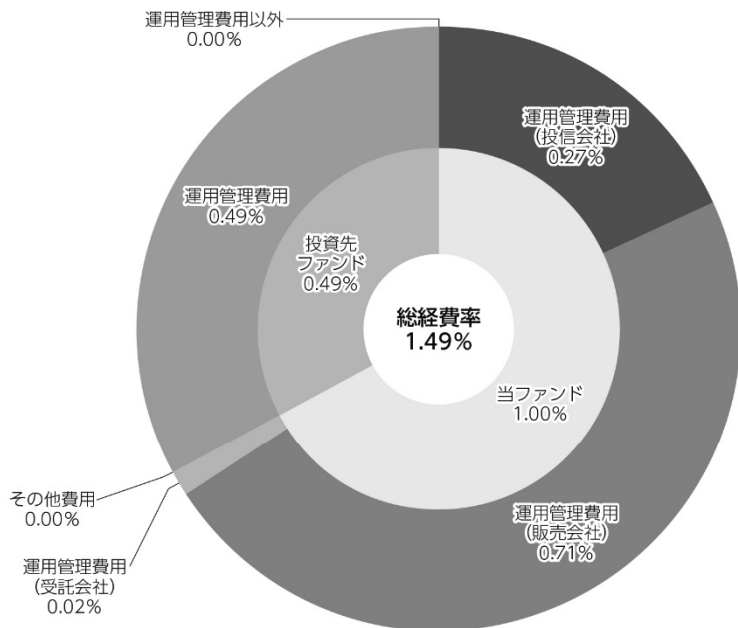
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<Bコース>

(参考情報)

○総経費率

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総経費率（年率）は1.49%です。



(単位：%)

総経費率(①+②+③)	1.49
①当ファンドの費用の比率	1.00
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.49
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00

(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) 当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（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) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。

(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。

<Bコース>

○売買及び取引の状況 (2023年12月16日～2024年 6月17日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ウエリントン・マネージメント・ファンズ (アイルランド) –	口	千円	口	千円
	ウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドー クラスS (円ヘッジ無、分配金無)				
		55,629	657,600	123,066	1,536,400

*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 (2023年12月16日～2024年 6月17日)

利害関係人との取引状況

<ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース>
該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等	うち利害関係人	
	A	との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 771	百万円 60	% 7.8	百万円 —	百万円 —	% —

平均保有割合 0.0%

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

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

<Bコース>

○組入資産の明細 (2024年6月17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
		口	口	千円	%
ウエリントン・マネージメント・ファンズ(アイルランド)－ウエリントン・グローバル・スチュワード・ファンドークラスS(円ヘッジ無、分配金無)		5,675,235	5,607,798	71,174,180	99.3
合 計		5,675,235	5,607,798	71,174,180	99.3

*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
		千口	千口	千円
野村マネー マザーファンド		98	98	100

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成 (2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	71,174,180	98.2
野村マネー マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	1,292,358	1.8
投資信託財産総額	72,466,638	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

<Bコース>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	72,466,638,793
コール・ローン等	1,292,355,442
投資信託受益証券(評価額)	71,174,180,427
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,000
未収利息	2,924
(B) 負債	759,898,067
未払収益分配金	57,239,336
未払解約金	356,210,803
未払信託報酬	345,321,939
その他未払費用	1,125,989
(C) 純資産総額(A－B)	71,706,740,726
元本	57,239,336,083
次期繰越損益金	14,467,404,643
(D) 受益権総口数	57,239,336,083口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,528円

(注) 期首元本額は57,729,035,228円、期中追加設定元本額は4,444,577,904円、期中一部解約元本額は4,934,277,049円、1口当たり純資産額は1.2528円です。

○損益の状況 (2023年12月16日～2024年6月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	194,202
受取利息	227,632
支払利息	△ 33,430
(B) 有価証券売買損益	11,993,397,199
売買益	12,684,357,825
売買損	△ 690,960,626
(C) 信託報酬等	△ 346,447,928
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	11,647,143,473
(E) 前期繰越損益金	1,983,503,302
(F) 追加信託差損益金	893,997,204
(配当等相当額)	(157,760,209)
(売買損益相当額)	(736,236,995)
(G) 計(D＋E＋F)	14,524,643,979
(H) 収益分配金	△ 57,239,336
次期繰越損益金(G＋H)	14,467,404,643
追加信託差損益金	893,997,204
(配当等相当額)	(157,760,209)
(売買損益相当額)	(736,236,995)
分配準備積立金	13,573,407,439

* 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(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 (2023年12月16日～2024年6月17日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年12月16日～ 2024年6月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	194,239円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	11,646,697,789円
c. 信託約款に定める収益調整金	893,997,204円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,983,754,747円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	14,524,643,979円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,537円
g. 分配金	57,239,336円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

<Bコース>

○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。

2024年11月 5 日より、ファンドの設定解約の申込締切時間は以下の記載のとおり変更となる予定です。

原則、午後 3 時30分までに、販売会社が受付けた分を当日のお申込み分とします。

（販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。）

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日2023年8月21日）

作成対象期間（2022年8月20日～2023年8月21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
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
21期(2023年 8 月21日)	10, 196	△0.0		5.7	—	6, 733

* 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

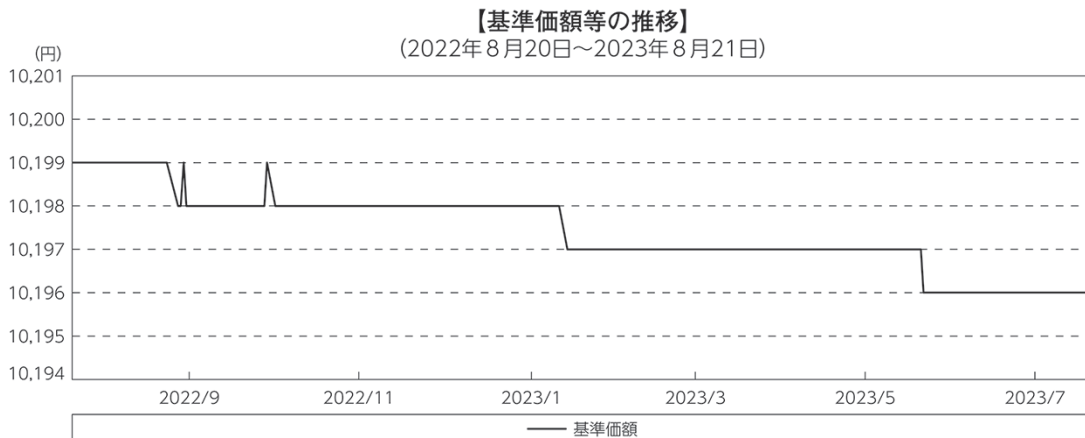
年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰 落	率			
(期 首) 2022年 8 月19日	円 10, 199		% —	% 57.5	% —	
8 月末	10, 199		0.0	58.4	—	
9 月末	10, 198		△0.0	48.5	—	
10 月末	10, 198		△0.0	44.4	—	
11 月末	10, 198		△0.0	34.4	—	
12 月末	10, 198		△0.0	20.7	—	
2023年 1 月末	10, 198		△0.0	16.4	—	
2 月末	10, 197		△0.0	25.4	—	
3 月末	10, 197		△0.0	22.8	—	
4 月末	10, 197		△0.0	26.2	—	
5 月末	10, 197		△0.0	14.3	—	
6 月末	10, 196		△0.0	9.1	—	
7 月末	10, 196		△0.0	4.3	—	
(期 末) 2023年 8 月21日	10, 196		△0.0	5.7	—	

* 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、消費や雇用環境など景気全般に持ち直しの動きが見られました。このような中、日銀は2022年12月の金融政策決定会合で、長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を一部見直し、長期金利の許容変動幅を±0.5%と、従来の±0.25%から拡大することを決定しました。また、2023年7月には、イールドカーブ・コントロールの運用を更に柔軟化し、従前の上限であった+0.5%からの上振れを容認し、実質的な長期金利の上限を+1%とすることを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通じて-0.10%～-0.30%程度で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01%～-0.08%程度で推移しました。

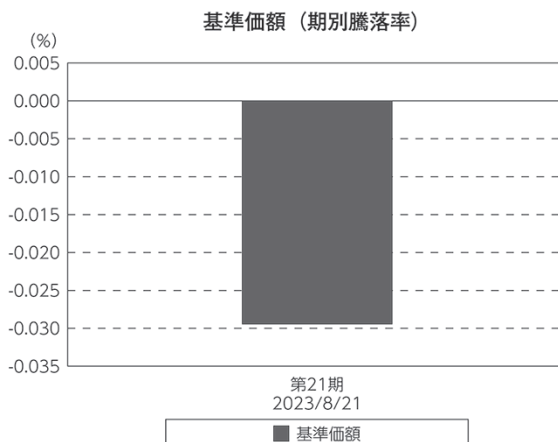
○当ファンドのポートフォリオ

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。

日銀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

(2022年 8 月20日～2023年 8 月21日)

該当事項はございません。

○ 売買及び取引の状況

(2022年 8 月20日～2023年 8 月21日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	地方債証券	千円 4, 557, 523	千円 503, 685 (4, 569, 320)
	特殊債券	2, 284, 885	— (5, 187, 000)
	社債券（投資法人債券を含む）	300, 407	— (1, 000, 000)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○ 利害関係人との取引状況等

(2022年 8 月20日～2023年 8 月21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

(2023年 8 月21日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5 年以上	2 年以上	2 年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	230, 000	230, 079	3. 4	—	—	—	3. 4
	(230, 000)	(230, 079)	(3. 4)	(—)	(—)	(—)	(3. 4)
特殊債券 (除く金融債)	54, 000	54, 051	0. 8	—	—	—	0. 8
	(54, 000)	(54, 051)	(0. 8)	(—)	(—)	(—)	(0. 8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	100, 000	100, 043	1. 5	—	—	—	1. 5
	(100, 000)	(100, 043)	(1. 5)	(—)	(—)	(—)	(1. 5)
合 計	384, 000	384, 175	5. 7	—	—	—	5. 7
	(384, 000)	(384, 175)	(5. 7)	(—)	(—)	(—)	(5. 7)

* () 内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第724回	0. 7	10, 000	10, 005	2023/ 9 /20
大阪府 公募 (5 年) 第155回	0. 001	100, 000	100, 000	2023/10/30
京都府 公募平成25年度第 7 回	0. 8	90, 000	90, 058	2023/ 9 /19
愛知県 公募平成25年度第15回	0. 699	10, 000	10, 012	2023/10/25
福岡県 公募平成25年度第 4 回	0. 816	20, 000	20, 003	2023/ 8 /25
小 計		230, 000	230, 079	
特殊債券(除く金融債)				
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第200回	0. 801	34, 000	34, 030	2023/ 9 /29
地方公共団体金融機構債券 第54回	0. 73	10, 000	10, 019	2023/11/28
西日本高速道路 第47回	0. 07	10, 000	10, 002	2023/12/20
小 計		54, 000	54, 051	
普通社債券(含む投資法人債券)				
三井住友ファイナンス&リース 第21回社債間限定同順位特約付	0. 18	100, 000	100, 043	2023/11/27
小 計		100, 000	100, 043	
合 計		384, 000	384, 175	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 384,175	% 5.7
コール・ローン等、その他	6,358,969	94.3
投資信託財産総額	6,743,144	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 (2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,743,144,910
コール・ローン等	6,358,433,056
公社債(評価額)	384,175,187
未収利息	210,342
前払費用	326,325
(B) 負債	10,011,425
未払金	10,002,200
未払利息	9,225
(C) 純資産総額(A－B)	6,733,133,485
元本	6,603,862,387
次期繰越損益金	129,271,098
(D) 受益権総口数	6,603,862,387口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,196円

(注) 期首元本額は7,697,164,972円、期中追加設定元本額は6,899,643,779円、期中一部解約元本額は7,992,946,364円、1口当たり純資産額は1.0196円です。

○損益の状況 (2022年8月20日～2023年8月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	10,224,214
受取利息	11,704,539
その他収益金	26,370
支払利息	△ 1,506,695
(B) 有価証券売買損益	△ 12,018,108
売買損	△ 12,018,108
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 1,793,894
(D) 前期繰越損益金	153,116,866
(E) 追加信託差損益金	135,776,221
(F) 解約差損益金	△157,828,095
(G) 計(C＋D＋E＋F)	129,271,098
次期繰越損益金(G)	129,271,098

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

*損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界業種別投資シリーズ(マネーパブル・ファンド)	2,663,398,020
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用)	1,486,454,639
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
野村アンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2210(適格機関投資家転売制限付)	730,584,834
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(適格機関投資家転売制限付)	158,756,834
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーパブル・ファンド)	68,496,125
野村世界高金利通貨投信	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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543

ファンド名	当期末 元本額	
	円	
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	984,543	
野村グローバルCB投信(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信(円コース) 毎月分配型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース) 毎月分配型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース) 毎月分配型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース) 年2回決算型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース) 年2回決算型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース) 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(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・イールド債券投信(円コース) 毎月分配型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898	
野村豪ドル債オープン・プレミアム 毎月分配型	982,801	
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609	
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(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	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609	
野村新世界高金利通貨投信	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 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	

ファンド名	当期末 元本額	
	円	
野村新米国ハイ・イールド債券投信(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(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 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PMCO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PMCO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PMCO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	
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	
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(ブラジルリアルコース) 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	
グローバル・ストック Dコース	116,529	
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	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	

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261
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
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98,078
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース	98,078
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース	98,059
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース	98,059
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
マイライフ・エール(資産成長型)	98,049
マイライフ・エール(年2%目標払出型)	98,049
マイライフ・エール(年6%目標払出型)	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらッ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらッ・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(インドルピアコース) 年2回決算型	63,772
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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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(中国元コース) 年2回決算型	13,042
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,808
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド(米ドル売り円買い)(野村SMA・EW向け)	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 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

〇お知らせ

該当事項はございません。