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）

運用報告書(全体版)

第１期（決算日2023年12月６日）

作成対象期間（2023年８月21日～2023年12月６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／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）	
信託期間	2023年８月21日以降、無期限とします。	
運用方針	円建ての外国投資信託であるPIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテール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 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、PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテールクラス受益証券への投資を中心としますが、各受益証券への投資比率には特に制限は設けず、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	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）	PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテールクラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。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。
	PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテールクラス	世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、世界各国（新興国を含みます。）の債券等を主要投資対象とします。
	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	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）	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。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、原則として基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

ホームページ　http://www.nomura-am.co.jp/

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率				
(設定日)	円	円	%	%	%	%	百万円
2023年８月21日	10,000	－	－	－	－	－	1
１期(2023年12月６日)	9,475	0	△5.3	0.0	－	96.2	66

＊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	投資信託証券組入比率
		騰落率			
(設定日)	円	%	%	%	%
2023年８月21日	10,000	－	－	－	－
８月末	9,845	△1.6	0.1	－	96.8
９月末	10,226	2.3	0.0	－	98.1
10月末	10,001	0.0	0.0	－	98.7
11月末	9,432	△5.7	0.0	－	98.7
(期　末)					
2023年12月６日	9,475	△5.3	0.0	－	96.2

＊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： 9,475円 (既払分配金(税込み)：0円)
騰落率：△ 5.3% (分配金再投資ベース)

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
（注）上記騰落率は、小数点以下第２位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

実質的に投資している世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等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）

○投資環境

【世界株式市場】

期初から2023年10月にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めの長期化観測が市場で広がる中、９月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の据え置きが決定されたものの、高い金利水準の維持が示唆され、長期金利が上昇する中で下落しました。11月に入り、FOMCにおいて政策金利が維持されたことや、10月の米CPI（消費者物価指数）上昇率が市場予想を下回ったことなどが好感され、上昇基調で推移しました。

【世界債券市場】

期初から2023年９月半ばにかけては、米景気の堅調さを示す経済指標が発表されたことやインフレ圧力の根強さが意識される中、FRBによる金融引き締めの長期化観測が市場で広がり下落基調で推移しました。９月下旬から10月にかけては、９月のFOMCにおいて2024年の政策金利見通しが引き上げられたことなどを背景に長期金利が上昇する中、下落基調で推移しました。11月以降、FOMCにおいて政策金利が維持されたことや、11月中旬には、10月の米CPI上昇率が市場予想を下回り、FRBによる金融引き締め長期化観測が後退したことで長期金利が低下する中、上昇基調で推移しました。

【為替市場】

期初から2023年９月にかけては、日米金利差が意識される中、９月のFOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたものの、高い金利水準の維持が示唆され、米長期金利が上昇したことなどを背景に、円安・ドル高基調で推移しました。その後、11月に入り、10月の米ISM製造業景況指数や米雇用統計において非農業部門雇用者数の伸びが市場予想を下回ったことや、10月の米CPIがインフレ鈍化を示す結果となり、FRBによる金融引き締め長期化観測が後退したことを受け、円高・ドル安基調で推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[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）]

［PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテールクラス］受益証券および［野村マネーマザーファンド］受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする［PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテールクラス］受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

[PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）-リテールクラス]

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指して運用を行ないました。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

当作成期におけるファンドの騰落率はマイナスとなりました。共通ポートフォリオにおいて、資産別でファンドに対するマイナスの影響が大きかったのは、金利、通貨などとなりました。個別の寄与度では、コロンビアやカナダの金利ポジションなどが下位となりました。

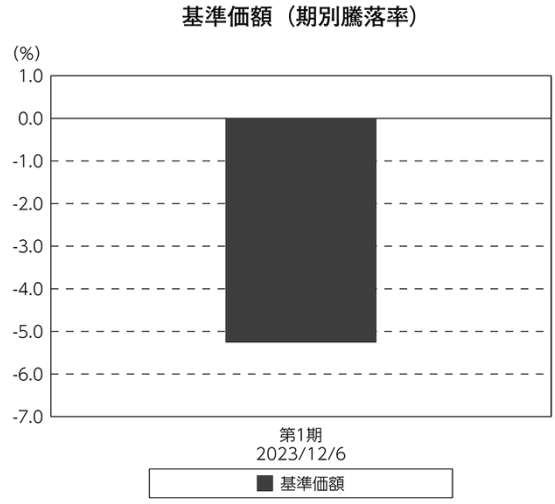
[野村マネー マザーファンド]

残存１年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、決定しました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項　　目	第１期 2023年８月21日～ 2023年12月６日
当期分配金	－
（対基準価額比率）	－％
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	53

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[野村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）]

［PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド－（円ヘッジ）-リテールクラス］受益証券および［野村マネー マザーファンド］受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする［PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド－（円ヘッジ）-リテールクラス］受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

[PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド－（円ヘッジ）-リテールクラス]

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指します。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

また、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。

[野村マネー マザーファンド]

残存１年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日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留意ください。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、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。

○１万口当たりの費用明細

（2023年８月21日～2023年12月６日）

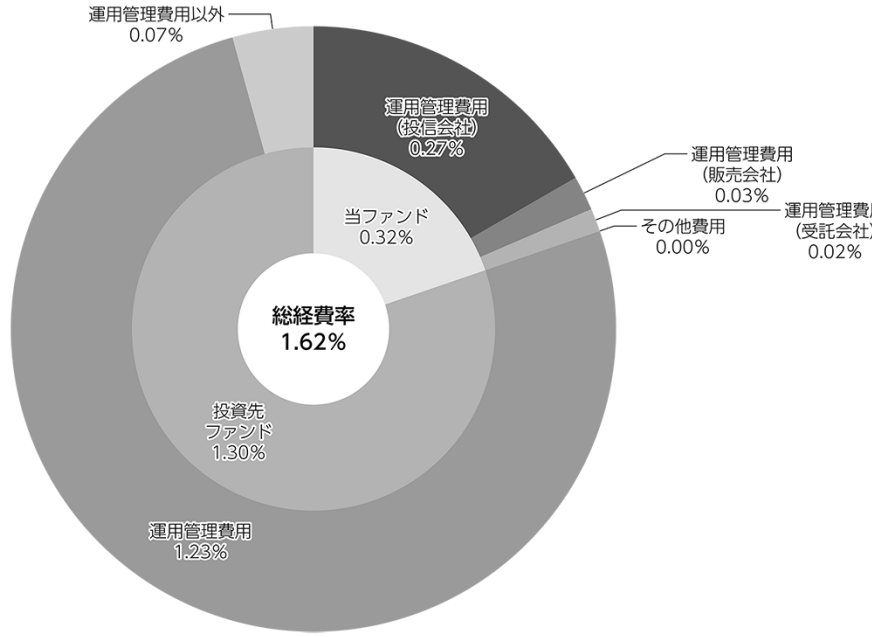
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	10	0.097	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(8)	(0.081)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（販売会社）	(1)	(0.010)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（受託会社）	(1)	(0.006)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) その他費用	0	0.001	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	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	10	0.098	
期中の平均基準価額は、9,876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）

◯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1.62％です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	**1.62**
①当ファンドの費用の比率	0.32
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.23
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.07

(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。

○売買及び取引の状況

（2023年８月21日～2023年12月６日）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国内	PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド－（円ヘッジ）-リテールクラス	7,326	65,935	－	－

＊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
	千口	千円	千口	千円
野村マネー マザーファンド	9	10	－	－

＊単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2023年８月21日～2023年12月６日）

利害関係人との取引状況

＜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）＞
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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	1,079	17	1.6	－	－	－

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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

（2023年８月21日～2023年12月６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 1	百万円 －	百万円 －	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

（2023年12月６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	%
PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド－（円ヘッジ）-リテールクラス	7,326	63,838	96.2
合計	7,326	63,838	96.2

＊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 マザーファンド	9	9

＊口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2023年12月６日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	63,838	84.1
野村マネー マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	12,070	15.9
投資信託財産総額	75,917	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12月６日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	**75,917,079**
コール・ローン等	12,068,316
投資信託受益証券(評価額)	63,838,764
野村マネー マザーファンド(評価額)	9,999
(B) 負債	**9,557,329**
未払金	9,533,825
未払信託報酬	23,262
未払利息	5
その他未払費用	237
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	**66,359,750**
元本	70,039,612
次期繰越損益金	△ 3,679,862
(D) 受益権総口数	**70,039,612口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**9,475円**

(注) 期首元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は69,039,612円、期中一部解約元本額は０円、１口当たり純資産額は0.9475円です。

○損益の状況 (2023年８月21日～2023年12月６日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	**119,619**
受取配当金	119,780
支払利息	△ 161
(B) 有価証券売買損益	**△2,096,497**
売買損	△2,096,497
(C) 信託報酬等	**△ 23,499**
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	**△2,000,377**
(E) 追加信託差損益金	**△1,679,485**
(配当等相当額)	(278,959)
(売買損益相当額)	(△1,958,444)
(F) 計(Ｄ＋Ｅ)	**△3,679,862**
(G) 収益分配金	**0**
次期繰越損益金(Ｆ＋Ｇ)	**△3,679,862**
追加信託差損益金	△1,679,485
(配当等相当額)	(278,893)
(売買損益相当額)	(△1,958,378)
分配準備積立金	95,903
繰越損益金	△2,096,280

＊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（2023年８月21日～2023年12月６日）は以下の通りです。

項　　目	当　　期
	2023年８月21日～ 2023年12月６日
a. 配当等収益(経費控除後)	95,903円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	278,893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)	374,796円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	53円
g. 分配金	0円
h. 分配金(１万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	0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。

PIMCOバミューダ・トラストⅣ－
PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド－
（円ヘッジ）-リテールクラス／（円ヘッジなし）-リテールクラス

2023年6月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	英領バミューダ諸島籍円建外国投資信託
運用方針	世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、投資顧問会社が独自に開発した定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指します。 ※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。
投資対象	世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、世界各国（新興国を含みます。）の債券等
管理会社 投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受託会社	メイプルズ・トラスティ・サービシーズ（バミューダ）リミテッド
管理事務代行会社 保管受託銀行	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
名義書換事務 受託会社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン（ルクセンブルグ）エス・シー・エー

＊作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

運用計算書

2023年6月30日に終了した期間

（単位：千）

収益：		
利息(外国税額控除後)*	$	2,134
収益		0
収益合計		2,134
費用：		
投資顧問報酬 —（日本円、為替ヘッジあり）— 機関		158(2)
投資顧問報酬 —（日本円、為替ヘッジあり）— 小売		135(1)
投資顧問報酬 —（日本円、為替ヘッジなし）— 小売		289(1)
管理費用 —（日本円、為替ヘッジあり）— 機関		27(2)
支払利息		35
費用合計		644
純投資損益		1,490
当期実現損益：		
投資有価証券(外国税額控除後)*		(692)
上場又は中央清算された金融デリバティブ商品		(3,885)
店頭金融デリバティブ商品		(6,308)
外貨通貨		9
当期実現損益		(10,876)
当期未実現評価損益：		
投資有価証券(外国税額控除後)*		(539)
上場又は中央清算された金融デリバティブ商品		1,720
店頭金融デリバティブ商品		1,018
外貨建資産および負債		(3)
当期未実現評価損益		2,196
当期実現および未実現評価損益		(8,680)
運用の結果による純資産の増減額	$	(7,190)
* 外国税	$	0

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。
(1) 2022年12月15日(設定日)から2023年6月30日までの期間
(2) 2023年2月9日(設定日)から2023年6月30日までの期間

期末純資産総額		（単位：千）
(JPY-Hedged)-Retail	$	21,774
(JPY-Unhedged)-Retail		46,551

期末現在発行済受益証券数	（単位：千）
(JPY-Hedged)-Retail	329
(JPY-Unhedged)-Retail	652

期末1口当たり純資産価格		
(JPY-Hedged)-Retail	$	66.10
(JPY-Unhedged)-Retail		71.35

※PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドの期末純資産額は101,922千米ドル。

組入資産の明細

（金額は千単位＊、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く）

2023年6月30日現在

		額面金額（単位:千）	評価額（単位:千）
投資有価証券84.7%			
オーストラリア0.7%			
社債等0.7%			
National Australia Bank Ltd.			
5.247% due 09/26/2023	AUD	1,000	$ 667
オーストラリア合計			**667**
（取得原価$693）			
カナダ6.2%			
社債等2.6%			
Bank of Montreal			
5.329% due 07/09/2024	$	400	399
5.800% due 12/12/2024		100	100
Bank of Nova Scotia			
5.447% due 07/31/2024		300	299
5.474% due 04/15/2024		700	699
Canadian Imperial Bank of Commerce			
0.500% due 12/14/2023		500	488
National Bank of Canada			
5.579% due 08/06/2024		400	399
Toronto-Dominion Bank			
5.905% due 07/19/2023		220	220
			2,604
ソブリン債3.6%			
CPPIB Capital, Inc.			
6.338% due 03/11/2026		2,800	2,863
PSP Capital, Inc.			
5.331% due 03/03/2025		800	799
			3,662
カナダ合計			**6,266**
（取得原価$6,262）			
ケイマン諸島3.1%			
資産担保証券3.1%			
Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.			
6.263% due 08/15/2034		300	293
Barings CLO Ltd.			
6.470% due 01/20/2032		400	395
Madison Park Funding XXVI Ltd.			
6.499% due 07/29/2030		494	492
Madison Park Funding XXX Ltd.			
6.010% due 04/15/2029		855	846
Magnetite XIV-R Ltd.			
6.382% due 10/18/2031		400	397
MF1 Ltd.			
6.237% due 10/16/2036		400	390
OZLM XVI Ltd.			
6.348% due 05/16/2030		222	221
Tralee CLO II Ltd.			
6.570% due 07/20/2029		109	109
ケイマン諸島合計			**3,143**
（取得原価$3,141）			
デンマーク0.8%			
社債等0.8%			
Danske Bank A/S			
5.375% due 01/12/2024		800	795
デンマーク合計			**795**
（取得原価$798）			
フランス2.2%			
社債等2.2%			
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.			
3.750% due 07/20/2023		900	899
BNP Paribas S.A.			
3.800% due 01/10/2024		300	296
4.705% due 01/10/2025		200	198
BPCE S.A.			
4.000% due 09/12/2023		500	498
6.780% due 09/12/2023		400	401
フランス合計			**2,292**
（取得原価$2,295）			
ドイツ0.9%			
社債等0.9%			
Deutsche Bank AG			
0.898% due 05/28/2024		300	285
5.589% due 11/08/2023		600	599
ドイツ合計			**884**
（取得原価$885）			
アイルランド0.1%			
社債等0.1%			
AerCap Ireland Capital DAC			
3.150% due 02/15/2024		150	147
アイルランド合計			**147**
（取得原価$148）			
イスラエル0.9%			
ソブリン債0.9%			
Israel Government Bond			
3.750% due 03/31/2024	ILS	3,500	947
イスラエル合計			**947**
（取得原価$953）			

	額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
イタリア0.4%		
社債等0.4%		
Eni SpA		
4.000% due 09/12/2023	$ 400	398
イタリア合計		**398**
（取得原価$399）		
日本4.7%		
社債等4.7%		
Aozora Bank Ltd.		
1.050% due 09/09/2024	200	188
Mitsubishi HC Capital, Inc.		
3.960% due 09/19/2023	300	299
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.		
4.788% due 07/18/2025	500	493
6.128% due 07/26/2023	400	400
Mizuho Financial Group, Inc.		
0.849% due 09/08/2024	500	495
3.922% due 09/11/2024	300	299
Nomura Holdings, Inc.		
2.648% due 01/16/2025	900	852
ORIX Corp.		
4.050% due 01/16/2024	900	890
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
6.125% due 07/19/2023	400	400
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.850% due 03/25/2024	500	482
日本合計		**4,798**
（取得原価$4,812）		
多国籍 0.8%		
社債等0.8%		
NXP BV		
4.875% due 03/01/2024	800	794
多国籍合計		**794**
（取得原価$797）		
オランダ1.9%		
社債等1.9%		
Enel Finance International NV		
2.650% due 09/10/2024	500	481
ING Groep NV		
4.100% due 10/02/2023	500	498
Siemens Financieringsmaatschappij NV		
5.520% due 03/11/2024	1,000	1,001
オランダ合計		**1,980**
（取得原価$1,982）		
韓国2.6%		
社債等1.2%		
Hyundai Capital Services, Inc.		
0.750% due 09/15/2023	400	396
SK Broadband Co. Ltd.		
3.875% due 08/13/2023	800	798
		1,194

	額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
ソブリン債1.4%		
Export-Import Bank of Korea		
4.628% due 10/30/2023	AUD 1,200	800
Korea Expressway Corp.		
0.928% due 09/02/2023	1,000	661
		1,461
韓国合計		**2,655**
（取得原価$2,645）		
スペイン1.5%		
社債等1.5%		
Banco Santander S.A.		
0.701% due 06/30/2024	$ 1,500	1,492
スペイン合計		**1,492**
（取得原価$1,492）		
スイス 0.3%		
社債等0.3%		
UBS AG		
5.450% due 02/09/2024	300	299
スイス合計		**299**
（取得原価$300）		
英国1.6%		
社債等1.6%		
Lloyds Banking Group PLC		
4.050% due 08/16/2023	700	699
Nationwide Building Society		
0.550% due 01/22/2024	200	194
NatWest Group PLC		
3.875% due 09/12/2023	738	734
英国合計		**1,627**
（取得原価$1,629）		
米国29.7%		
資産担保証券6.9%		
Capital One Multi-Asset Execution Trust		
5.773% due 07/15/2027	200	200
CarMax Auto Owner Trust		
5.767% due 01/15/2026	300	300
Citibank Credit Card Issuance Trust		
5.988% due 05/14/2029	800	800
DLLAD LLC		
5.190% due 04/20/2026	300	297
Ford Credit Auto Owner Trust		
5.028% due 04/15/2024	396	396
GM Financial Automobile Leasing Trust		
5.616% due 06/20/2025	200	200
GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust		
4.890% due 01/16/2024	88	88
5.667% due 09/16/2025	597	597
Harley-Davidson Motorcycle Trust		
5.320% due 06/15/2026	1,149	1,143
Hyundai Auto Lease Securitization Trust		
0.380% due 09/16/2024	625	618

	額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Kubota Credit Owner Trust		
5.400% due 02/17/2026	300	298
Navient Private Education Loan Trust		
6.093% due 11/15/2068	268	264
Nissan Auto Lease Trust		
0.520% due 08/15/2024	453	450
5.697% due 03/17/2025	300	300
SoFi Consumer Loan Program Trust		
5.810% due 05/15/2031	302	301
Toyota Auto Receivables Owner Trust		
5.637% due 08/15/2025	387	387
World Omni Auto Receivables Trust		
5.777% due 11/16/2026	400	401
		7,040
社債等18.3%		
American Express Co.		
5.311% due 11/03/2023	485	485
5.801% due 05/03/2024	300	301
American Honda Finance Corp.		
5.478% due 01/12/2024	545	545
American Tower Corp.		
5.000% due 02/15/2024	500	497
Athene Global Funding		
0.950% due 01/08/2024	900	874
1.200% due 10/13/2023	100	98
Bank of America Corp.		
3.864% due 07/23/2024	800	799
Bayer U.S. Finance II LLC		
3.875% due 12/15/2023	500	495
Boeing Co.		
1.433% due 02/04/2024	600	584
Caterpillar Financial Services Corp.		
5.539% due 11/13/2023	106	106
Charter Communications Operating LLC		
6.949% due 02/01/2024	500	502
CNH Industrial Capital LLC		
4.200% due 01/15/2024	400	396
Daimler Truck Finance North America LLC		
1.125% due 12/14/2023	389	381
6.093% due 04/05/2024	200	200
Energy Transfer LP		
3.900% due 05/15/2024	900	885
GA Global Funding Trust		
1.250% due 12/08/2023	500	488
General Motors Financial Co., Inc.		
5.850% due 03/08/2024	700	699
Gilead Sciences, Inc.		
0.750% due 09/29/2023	500	494
Goldman Sachs Group, Inc.		
1.217% due 12/06/2023	900	883
HCA, Inc.		
5.000% due 03/15/2024	800	795
Hyundai Capital America		
0.800% due 01/08/2024	210	205
Komatsu Finance America, Inc.		
0.849% due 09/09/2023	500	495
Morgan Stanley		
5.519% due 01/25/2024	900	899
5.555% due 11/10/2023	500	500
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.		
5.489% due 08/07/2023	477	477
New York Life Global Funding		
5.406% due 10/21/2023	595	595
Pacific Gas & Electric Co.		
1.700% due 11/15/2023	800	786
Penske Truck Leasing Co. LP		
3.900% due 02/01/2024	700	691
Pfizer, Inc.		
5.882% due 09/15/2023	80	80
Protective Life Global Funding		
3.104% due 04/15/2024	500	490
Starbucks Corp.		
5.509% due 02/14/2024	700	700
Thermo Fisher Scientific, Inc.		
5.562% due 10/18/2024	900	900
Toyota Motor Credit Corp.		
5.569% due 01/10/2025	500	500
Tyson Foods, Inc.		
3.900% due 09/28/2023	500	498
VMware, Inc.		
1.000% due 08/15/2024	350	332
		18,655
米国政府機関4.5%		
Federal Home Loan Bank		
5.350% due 05/17/2024	1,800	1,797
5.360% due 05/10/2024	900	898
5.370% due 05/21/2024	1,000	998
Freddie Mac		
5.375% due 04/24/2025	900	896
		4,589
米国合計		**30,284**
（取得原価$30,329）		
短期商品26.3%		
コマーシャル・ペーパー15.9%		
American Electric Power Co., Inc. (a)		
5.473% due 08/07/2023	400	398
5.474% due 08/08/2023	400	398
AT&T, Inc.		
5.914% due 11/21/2023 (a)	600	586
Bayer Corp.		
5.928% due 07/10/2023 (a)	500	499
Becton Dickinson & Co.		
5.418% due 07/10/2023 (a)	900	899
Conagra Brands, Inc. (a)		
5.782% due 07/06/2023	400	400
5.791% due 07/05/2023	500	500
Electricite de France S.A. (a)		
5.547% due 08/03/2023	400	398
5.547% due 08/04/2023	400	398

	額面金額（単位：千）	評価額（単位：千）
Enbridge U.S., Inc.		
5.472% due 07/26/2023 (a)	650	647
Global Payments, Inc. (a)		
5.958% due 07/28/2023	300	299
5.959% due 07/21/2023	1,000	996
Humana, Inc.		
5.477% due 07/10/2023 (a)	900	899
Keurig Dr Pepper, Inc.		
5.255% due 07/05/2023 (a)	250	250
Leidos, Inc.		
5.933% due 07/10/2023 (a)	600	599
McCormick & Co., Inc.		
5.373% due 07/25/2023 (a)	800	797
National Grid North America, Inc.		
5.486% due 07/13/2023 (a)	500	499
Northrop Grumman Corp.		
5.680% due 08/17/2023 (a)	900	893
Quanta Services, Inc. (a)		
5.919% due 07/17/2023	400	399
5.921% due 07/18/2023	400	399
Raytheon Technologies Corp.		
5.489% due 07/12/2023 (a)	650	649
S&P Global, Inc.		
5.428% due 07/06/2023 (a)	900	899
Thomson Reuters Corp.		
5.500% due 07/12/2023 (a)	900	898
Trane Technologies PLC		
5.609% due 07/24/2023 (a)	900	897
VW Credit, Inc.		
5.426% due 07/25/2023 (a)	800	797
Walgreens Boots Alliance, Inc.		
6.034% due 07/05/2023 (a)	900	899
		16,192

定期預金1.7%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.020% due 07/03/2023	AUD	25	17
Bank of Nova Scotia			
3.790% due 07/04/2023	CAD	85	64
4.570% due 07/03/2023	$	20	20
BNP Paribas Bank			
(0.370%) due 07/03/2023	¥	528	4
2.470% due 07/03/2023	SEK	521	48
2.850% due 07/03/2023	NOK	5	0
3.020% due 07/03/2023	AUD	56	37
3.050% due 07/03/2023	SGD	86	63
3.720% due 07/03/2023	HKD	39	5
6.420% due 07/03/2023	ZAR	413	22
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.370%) due 07/03/2023	¥	92	1
0.650% due 07/03/2023	CHF	0	1
4.170% due 07/03/2023	GBP	1	2
4.570% due 07/03/2023	$	1	1

	額面金額（単位：千）		評価額（単位：千）
Citibank N.A.			
4.570% due 07/03/2023		145	145
DBS Bank Ltd.			
4.570% due 07/03/2023		113	113
DnB Bank ASA			
2.470% due 07/03/2023	SEK	166	15
3.020% due 07/03/2023	AUD	31	20
HSBC Bank			
3.050% due 07/03/2023	SGD	17	13
3.720% due 07/03/2023	HKD	168	21
HSBC Bank PLC			
2.620% due 07/03/2023	EUR	147	160
4.170% due 07/03/2023	GBP	19	24
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.570% due 07/03/2023	$	112	112
MUFG Bank Ltd.			
(0.370%) due 07/03/2023	¥	1,475	10
Royal Bank of Canada			
3.790% due 07/04/2023	CAD	46	35
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
(0.370%) due 07/03/2023	¥	14,934	103
2.620% due 07/03/2023	EUR	23	25
4.170% due 07/03/2023	GBP	49	63
4.570% due 07/03/2023	$	220	220
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
(0.370%) due 07/03/2023	¥	3,832	27
2.620% due 07/03/2023	EUR	37	40
4.170% due 07/03/2023	GBP	65	82
4.570% due 07/03/2023	$	257	257
			1,770

日本短期国債 8.7%			
(0.200%) due 07/18/2023 (b)	¥	330,000	2,283
(0.197%) due 08/28/2023 (a)		600,000	4,152
(0.181%) due 08/07/2023 (b)		350,000	2,422
			8,857

短期商品合計		**26,819**
（取得原価$27,305）		
投資有価証券合計84.7%	**$**	**86,287**
（取得原価$86,865）		
金融デリバティブ商品1.6%		**1,695**
（取得原価またはプレミアム$66）		
その他の資産および負債13.7%		**13,940**
純資産100.0%	**$**	**101,922**

(a) クーポンは最終利回りである。
(b) クーポンは加重平均最終利回りである。

●制限付証券

2023年6月30日現在

単位:千

発行体	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	純資産に占める市場価格の割合
Deutsche Bank AG	0.898%	05/28/2024	05/31/2023	$ 285	$ 285	0.28%

◎借入およびその他の金融取引

2023年6月30日現在

●売り建て

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	元本	受取金	売建有価証券に係る未払金
BOS	Fannie Mae, TBA	4.500%	07/01/2038	$ 1,700	$ (1,672)	$ (1,667)
BOS	Fannie Mae, TBA	6.000%	07/01/2053	1,400	(1,414)	(1,412)
JPS	Ginnie Mae, TBA	5.500%	08/01/2053	5,000	(4,997)	(4,975)
WFS	Fannie Mae, TBA	5.500%	08/01/2053	1,300	(1,299)	(1,294)
WFS	Ginnie Mae, TBA	5.500%	08/01/2053	900	(900)	(895)
売り建て合計(10.1%)					**$ (10,282)**	**$ (10,243)**

◎上場金融デリバティブ商品

2023年6月30日現在

●先物契約

単位：千（契約数を除く）

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
3-Month EURIBOR Interest Rate June Futures	Short	06/2024	70	$ 47	$ 19	$ 0
3-Month SOFR June Futures	Short	09/2024	108	192	0	(3)
3-Month Sonia June Futures	Short	09/2024	46	183	23	0
3-Month Sonia March Futures	Short	06/2024	4	22	2	0
API2 Rotterdam Coal August Futures	Short	08/2023	14	(113)	0	(66)
Australia Government 3-Year Bond September Futures	Short	09/2023	166	66	58	0
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09/2023	29	12	27	0
BIST 30 Index August Futures	Long	08/2023	149	20	0	0
Brent Crude Oil November Futures	Short	09/2023	7	(2)	0	(5)
CAC 40 10 Euro July Futures	Long	07/2023	7	12	9	0
CBOE Volatility Index July Futures	Short	07/2023	94	146	30	0
CBT Soybean Meal December Futures	Short	12/2023	25	(70)	0	(42)
CBT Soybean Meal November Futures	Long	11/2023	7	(4)	27	0
CBT Soybean Oil December Futures	Short	12/2023	37	(184)	0	(89)
CBT Corn September Futures	Long	09/2023	21	(112)	0	(37)
CBT Wheat September Futures	Short	09/2023	8	(8)	7	0
CME Lean Hog October Futures	Short	10/2023	24	24	9	0
CME Live Cattle October Futures	Long	10/2023	14	76	11	0
Coffee Robusta September Futures	Long	09/2023	43	(62)	0	(34)
DAX Index September Futures	Long	09/2023	2	(2)	5	0
ECX Emission December Futures	Long	12/2023	10	(33)	15	0
Euro STOXX Banks Index September Futures	Long	09/2023	280	65	45	0
Euro-BTP 3-Year Note September Futures	Short	09/2023	86	36	23	0
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	Long	09/2023	13	9	0	(13)
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	Short	09/2023	3	2	3	0
FTSE 100 Index September Futures	Long	09/2023	6	(5)	2	0
FTSE/JSE Top 40 Index September Futures	Long	09/2023	42	(13)	22	0
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09/2023	5	24	16	0
Gasoline October Futures	Short	09/2023	1	(1)	0	(2)
Gold 100oz August Futures	Short	08/2023	12	37	0	(14)
Hard Red Winter Wheat September Futures	Long	09/2023	29	(90)	0	0
ICE-ICE Cocoa September Futures	Long	09/2023	27	38	8	0
ICE-ICE White Sugar October Futures	Short	09/2023	4	(2)	0	(2)
IBEX 35 Index July Futures	Long	07/2023	8	25	12	0
LME Lead October Futures	Long	10/2023	8	(4)	21	0
LME Primary Aluminum September Futures	Short	09/2023	59	101	14	0
LME Primary Nickel August Futures	Short	08/2023	9	40	6	0
LME Primary Nickel October Futures	Short	10/2023	8	2	2	0
LME Zinc September Futures	Short	09/2023	38	26	0	(44)
Low Sulphur Gas Oil October Futures	Short	10/2023	15	0	0	(20)
Milling Wheat September Futures	Short	09/2023	98	132	3	0
NASDAQ 100 E-mini September Futures	Long	09/2023	8	81	38	0
Nikkei 225 (SGX) September Futures	Long	09/2023	13	51	2	0
No.2 Cotton December Futures	Short	12/2023	53	15	0	(36)
NY Harbor ULSD October Futures	Short	09/2023	11	(13)	0	(18)
NYB-ICE Cocoa September Futures	Long	09/2023	19	76	17	0
NYB-ICE Coffee December Futures	Short	12/2023	12	26	10	0

単位：千（契約数を除く）

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
NYB- ICE Coffee September Futures	Short	09/2023	26	168	25	0
NYM Natural Gas October Futures	Short	09/2023	40	(25)	0	(30)
Nymex Palladium September Futures	Short	09/2023	15	270	11	0
OMXS 30 Index July Futures	Long	07/2023	90	(12)	42	0
Phelix DE Base Month August Futures	Short	08/2023	7	23	0	(26)
Platinum October Futures	Short	10/2023	32	22	0	(12)
Red Spring Wheat September Futures	Long	09/2023	4	0	0	(2)
Russell 2000 Mini Index September Futures	Long	09/2023	4	2	1	0
S&P 500 E-mini Index September Futures	Long	09/2023	3	19	8	0
S&P/TSX 60 Index September Futures	Long	09/2023	2	6	5	0
SGX FTSE China A50 Index July Futures	Short	07/2023	272	(18)	0	(19)
SGX FTSE Taiwan Index July Futures	Long	07/2023	72	(30)	2	0
SGX MSCI Singapore July Futures	Short	07/2023	43	6	0	(2)
SGX Nifty 50 Index July Futures	Long	07/2023	136	126	35	0
SGX TSI Iron Ore August Futures	Long	08/2023	39	(1)	0	(8)
Silver September Futures	Short	09/2023	7	(4)	0	(8)
SPI 200 Index September Futures	Long	09/2023	14	13	2	0
Sugar No.11 October Futures	Long	09/2023	14	(40)	138	0
Topix Index September Futures	Long	09/2023	24	123	0	(12)
TTF Natural Gas October Futures	Short	09/2023	25	(23)	0	(52)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2023	18	(14)	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2023	35	34	0	(2)
UK Natural Gas August Futures	Short	07/2023	20	(63)	0	(49)
VSTOXX Mini Index July Futures	Short	07/2023	294	42	27	0
WIG 20 Index September Futures	Long	09/2023	241	9	15	0
WTI Crude November Futures	Short	10/2023	14	(3)	0	(9)
先物契約合計				**$ 1,498**	**$ 797**	**$ (656)**

●スワップ契約

クレジットインデックスに係るクレジットデフォルトスワップ－プロテクションの売り(1)

単位：千

インデックス・トランシェ	受取固定金利	満期日	想定元本(2)	市場価格(3)	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
CDX.EM-39 Index	1.000%	06/20/2028	$ 15,630	$ (741)	$ 81	$ 38	$ 0
CDX.HY-40 Index	5.000%	06/20/2028	2,200	65	29	16	0
CDX.IG-40 Index	1.000%	06/20/2028	14,800	226	34	19	0
iTraxx Europe Crossover Series 39 Index	5.000%	06/20/2028	EUR 1,900	85	7	15	0
iTraxx Europe Series 39 Index	1.000%	06/20/2028	20,700	273	55	38	0
				$ (92)	$ 206	$ 126	$ 0

●金利スワップ

単位:千

変動金利支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本		市場価格	未実現評価損益	変動証拠金	
								資産	負債
受取[4]	3-Month Australian Bank Bill	4.000%	09/20/2025	AUD	35,400	$ 207	$ 58	$ 61	$ 0
受取	3-Month HKD-HIBOR	4.000%	12/21/2027	HKD	15,500	9	60	5	0
受取	3-Month HKD-HIBOR	4.500%	12/21/2027		9,000	(19)	36	9	0
支払	3-Month HKD-HIBOR	3.250%	03/15/2028		35,700	(162)	(154)	0	(23)
受取	3-Month HKD-HIBOR	3.750%	03/15/2028		57,600	102	17	36	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.260%	11/18/2027	ILS	6,300	8	10	7	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.638%	12/30/2027		7,500	(28)	(28)	8	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.485%	01/09/2028		19,600	21	15	0	(4)
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.845%	03/16/2028		7,300	29	6	0	(9)
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.590%	03/31/2028		6,000	6	6	0	(7)
受取	3-Month THOR	2.250%	03/15/2028	THB	64,200	17	(1)	0	(1)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.055%	11/14/2027	ZAR	17,800	18	14	2	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.900%	01/06/2028		15,100	(21)	(21)	0	(2)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.730%	01/09/2028		54,600	(97)	(108)	0	(7)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.705%	01/10/2028		18,400	(34)	(34)	0	(2)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.700%	01/20/2028		54,500	(100)	(85)	0	(5)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.205%	02/17/2028		52,000	44	44	6	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.430%	02/23/2028		80,500	31	31	9	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.120%	03/13/2028		23,700	26	9	2	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.510%	04/25/2028		71,400	19	19	8	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.350%	05/18/2028		46,000	(69)	(50)	5	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.185%	06/12/2028		24,000	25	(4)	0	(4)
支払[4]	6-Month Australian Bank Bill	4.500%	09/20/2033	AUD	7,900	29	(23)	0	(57)
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.476%	01/12/2028	CZK	53,100	42	(36)	11	0
受取	6-Month CZK-PRIBOR	5.215%	02/24/2028		201,900	(183)	(205)	38	0
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.510%	03/22/2028		80,100	(33)	4	0	(15)
支払	6-Month CZK-PRIBOR	5.070%	04/20/2028		128,300	110	102	0	(24)
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.695%	05/04/2028		50,000	8	21	0	(9)
受取	6-Month CZK-PRIBOR	3.340%	01/06/2032		33,200	119	(55)	11	0
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.220%	03/21/2033		46,800	(5)	9	0	(16)
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.420%	06/01/2033		1,700	2	0	0	(1)
受取[4]	6-Month EURIBOR	3.500%	09/20/2025	EUR	34,600	229	218	78	0
支払[4]	6-Month EURIBOR	3.000%	09/20/2033		6,900	11	(22)	0	(43)
支払[4]	6-Month EURIBOR	2.500%	09/20/2053		100	0	0	0	(1)
受取	6-Month HUF-BUBOR	9.900%	12/16/2027	HUF	358,900	(119)	(137)	2	0
受取	6-Month HUF-BUBOR	10.700%	12/22/2027		240,800	(104)	(108)	0	0
支払	6-Month HUF-BUBOR	11.140%	12/23/2027		479,400	235	83	9	0
受取	6-Month HUF-BUBOR	8.550%	01/24/2028		960,500	25	(82)	1	0
受取	6-Month HUF-BUBOR	9.510%	04/11/2028		421,400	(59)	(55)	0	(1)
支払	6-Month HUF-BUBOR	8.712%	04/28/2028		775,200	47	(13)	0	(1)
支払	6-Month HUF-BUBOR	8.740%	04/28/2028		1,399,400	89	89	2	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.600%	12/16/2027	PLN	1,200	14	19	0	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.120%	01/11/2028		4,700	(6)	0	2	0
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.430%	03/16/2028		7,800	(25)	(23)	0	(6)
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.540%	06/01/2028		17,000	93	18	8	0
支払	6-Month PLN-WIBOR	4.930%	06/29/2028		8,600	(6)	(6)	6	0
受取	7-Day China Fixing Repo Rate	2.750%	03/15/2028	CNY	39,200	(89)	(92)	0	(10)
支払	7-Day China Fixing Repo Rate	3.000%	03/15/2028		154,300	586	281	38	0
支払[4]	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.850%	09/20/2053	¥	2,310,000	361	(23)	0	(32)
支払[4]	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	1.200%	09/20/2053		540,000	139	(13)	0	(24)

単位:千

変動金利支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本		市場価格	未実現評価損益	変動証拠金	
								資産	負債
受取	BRL-CDI-Compounded	10.295%	01/04/2027	BRL	14,200	55	(154)	0	(12)
受取	BRL-CDI-Compounded	11.451%	01/04/2027		7,200	(34)	(99)	0	(6)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.260%	01/04/2027		6,800	65	65	7	0
受取	BRL-CDI-Compounded	13.030%	01/04/2027		21,400	(287)	(287)	0	(21)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.530%	01/02/2029		12,200	(20)	(20)	0	(16)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.080%	01/02/2029		12,100	57	57	16	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.310%	01/02/2029		17,900	108	108	24	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.660%	01/02/2029		12,200	99	99	17	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.837%	01/02/2029		17,000	154	154	23	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.940%	01/02/2029		5,300	51	51	7	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.058%	01/02/2029		25,100	260	260	35	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.560%	01/02/2029		7,700	102	102	11	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.746%	01/02/2029		9,500	136	133	13	0
受取(4)	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.750%	09/20/2025	CAD	27,400	329	152	13	0
受取	Canadian Overnight Repo Rate Average	1.250%	03/15/2028	TWD	302,400	85	(3)	0	(3)
受取(4)	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.000%	09/20/2028	CAD	6,500	140	33	0	(23)
受取(4)	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.000%	09/20/2033		9,700	243	(28)	0	(31)
支払(4)	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.250%	09/20/2053		3,400	31	42	48	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.260%	12/16/2027	COP	6,264,000	(139)	(128)	0	(8)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.800%	12/27/2027		3,774,000	(70)	(74)	0	(4)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.770%	01/31/2028		3,627,500	(64)	(53)	0	(5)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.210%	02/10/2028		14,805,200	191	191	18	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.200%	03/01/2028		12,907,400	(293)	(325)	0	(16)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.050%	03/24/2028		6,886,000	89	89	8	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.600%	04/11/2028		8,197,300	59	59	10	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.106%	06/15/2028		5,462,000	25	26	6	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.730%	06/28/2028		5,168,500	7	0	6	0
支払	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	03/15/2028	INR	238,700	(8)	(37)	0	(5)
受取	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	03/15/2028		141,400	5	(24)	3	0
支払	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.500%	03/15/2028		525,200	50	(68)	0	(13)
受取(4)	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.000%	09/20/2028		243,400	33	16	6	0
支払	IBMEXID	8.445%	12/02/2027	MXN	4,900	(1)	(1)	0	0
受取	IBMEXID	9.215%	02/09/2028		47,900	(80)	(74)	3	0
受取	IBMEXID	9.135%	02/14/2028		24,000	(37)	(46)	2	0
支払	IBMEXID	8.438%	03/20/2028		64,300	3	3	0	(4)
受取	IBMEXID	8.700%	05/19/2028		49,000	(37)	(15)	3	0
支払	IBMEXID	8.207%	06/19/2028		61,400	(22)	(36)	0	(4)
支払	IBMEXID	8.250%	12/02/2032		17,200	10	8	1	0
受取	IBMEXID	8.800%	02/02/2033		23,100	(61)	(64)	0	(2)

単位:千

変動金利支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日		想定元本	市場価格	未実現評価損益	変動証拠金 資産	変動証拠金 負債
受取	IBMEXID	8.755%	02/03/2033		32,200	(79)	(112)	0	0
支払	IBMEXID	8.374%	03/14/2033	MXN	35,300	37	37	3	0
支払	IBMEXID	8.281%	03/28/2033		16,300	10	10	1	0
受取	IBMEXID	8.340%	04/21/2033		15,900	(15)	(17)	0	(3)
支払	IBMEXID	8.055%	06/13/2033		39,000	(7)	(21)	3	0
受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	2.665%	03/15/2028	KRW	3,962,500	113	24	0	(7)
支払	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	3.250%	03/15/2028		1,590,400	(14)	(23)	16	0
受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	3.500%	03/15/2028		2,199,600	1	31	0	(22)
支払	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	4.000%	03/15/2028		3,711,900	61	(37)	23	0
受取	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	3.000%	06/21/2028		3,226,500	57	7	7	0
受取[4]	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	09/20/2028	$	3,600	128	(1)	0	0
受取[4]	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	09/20/2033		1,400	58	5	0	(4)
受取[4]	Secured Overnight Financing Rate	3.000%	09/20/2053		800	23	(8)	0	(8)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.940%	02/17/2028	CLP	2,003,100	(15)	(15)	0	(3)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.370%	03/03/2028		889,300	(31)	(31)	0	(1)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.380%	03/03/2028		942,700	(33)	(33)	0	(1)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.320%	03/07/2028		1,767,200	(58)	(58)	0	(2)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.385%	03/07/2028		1,496,100	(54)	(41)	0	(1)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.830%	04/25/2028		6,711,700	106	47	0	(2)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.780%	05/31/2028		490,300	(11)	(11)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.798%	05/31/2028		1,952,300	(44)	(44)	0	(1)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.650%	06/01/2028		2,661,500	(39)	(39)	0	(1)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.237%	06/14/2028		4,867,800	(24)	(24)	3	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.158%	06/15/2028		1,278,000	(12)	(10)	0	0
受取	Singapore Overnight Index Average	2.750%	03/15/2028	SGD	12,400	256	114	39	0
受取	Singapore Overnight Index Average	3.000%	03/15/2028		5,400	67	35	17	0
受取[4]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.000%	09/20/2025	GBP	5,300	239	99	22	0
受取[4]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.500%	09/20/2033		12,900	1,043	200	126	0
支払[4]	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.250%	09/20/2053		2,100	(254)	33	0	(26)
受取	US CPI Urban Consumers NSA	0.000%	06/07/2033	$	1,500	(4)	(4)	0	(1)
						$ 4,281	$ 16	$ 904	$ (560)
スワップ契約合計						**$ 4,189**	**$ 222**	**$ 1,030**	**$ (560)**

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、特定のスワップ契約の条件に定義された信用事由が発生した場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本相当額を支払い参照債務もしくは参照インデックスを構成する原有価証券の引き渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本相当額から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原有価証券の回収額を控除した決済純額相当額を現金もしくは有価証券で支払う。

(2) 当該特定のスワップ契約の条件に定義された信用事由が発生した場合、ファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払を要求されるまたはクレジット・プロテクションの買い手として受け取る可能性がある潜在的最大金額

(3) 期末にスワップ契約の想定元本が決済/売却された場合、クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格および結果的価値は、支払い／履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブの予想債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した市場価格の絶対値での増加は、参照事業体の財務健全性の悪化を表し、債務不履行または契約の条件に定義されたその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。

(4) この金融商品の効力発生日は先日付である。

◎店頭金融デリバティブ商品

2023年6月30日現在

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
BOA	07/2023	PLN	529	$	128	$ 0	$ (2)
BOA	07/2023	TRY	2,761		123	18	0
BOA	07/2023	$	96	CZK	2,071	0	(1)
BOA	07/2023		69	PLN	288	2	0
BOA	07/2023		9	TRY	205	0	(1)
BOA	08/2023	AUD	5,976	$	4,039	57	0
BOA	08/2023	CAD	4,858		3,632	0	(41)
BOA	08/2023	EUR	1,544		1,679	0	(9)
BOA	08/2023	JPY	385,385		2,795	106	0
BOA	08/2023		1,104,700		7,968	273	0
BOA	08/2023	NZD	3,616		2,293	78	0
BOA	08/2023	SEK	18,812		1,830	84	0
BOA	08/2023	$	74	AUD	108	0	(2)
BOA	08/2023		139	CAD	184	1	0
BOA	08/2023		106	EUR	98	1	0
BOA	08/2023		223	GBP	178	4	0
BOA	08/2023		107	JPY	14,700	0	(5)
BOA	09/2023	HKD	4,005	$	513	1	0
BOA	09/2023	IDR	9,033,000		600	0	0
BOA	09/2023	KRW	720,412		569	20	0
BOA	09/2023	TWD	43,121		1,420	33	0
BOA	09/2023	$	3	INR	239	0	0
BOA	11/2023		963	ILS	3,509	0	(11)
BPS	07/2023	BRL	6,996	$	1,452	1	0
BPS	07/2023	COP	393		0	0	0
BPS	07/2023	PLN	610		143	0	(7)
BPS	07/2023	SGD	78		59	1	0
BPS	07/2023	$	1,425	BRL	6,996	26	0
BPS	07/2023		0	COP	393	0	0
BPS	07/2023		900	CZK	19,357	0	(12)
BPS	07/2023		644	MXN	11,082	1	0
BPS	07/2023		127	PLN	535	4	0
BPS	07/2023		4	TRY	90	0	(1)
BPS	08/2023	AUD	1,579	$	1,074	22	0
BPS	08/2023	CAD	5		4	0	0
BPS	08/2023	CHF	2,113		2,392	20	0
BPS	08/2023	CNH	27,711		3,973	151	0
BPS	08/2023	SEK	985		92	1	0
BPS	08/2023	TWD	21,583		707	14	0
BPS	08/2023	$	345	AUD	507	0	(7)
BPS	08/2023		156	CAD	206	0	0
BPS	08/2023		5,230	CHF	4,690	36	0
BPS	08/2023		590	EUR	543	4	0
BPS	08/2023		4	HUF	1,272	0	0
BPS	08/2023		18	JPY	2,500	0	0
BPS	08/2023		5	TWD	139	0	0

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
BPS	09/2023	AUD	1,300	$	861	0	(7)
BPS	09/2023	BRL	1,990		400	0	(7)
BPS	09/2023	CLP	339,055		415	0	(4)
BPS	09/2023	JPY	209,109		1,500	35	0
BPS	09/2023	PEN	4,062		1,100	0	(14)
BPS	09/2023	PLN	3,829		900	0	(39)
BPS	09/2023	RON	4,177		900	0	(17)
BPS	09/2023	SEK	4,782		442	0	(2)
BPS	09/2023	$	2,444	AUD	3,600	0	(43)
BPS	09/2023		500	BRL	2,468	4	0
BPS	09/2023		3,850	CAD	5,124	27	0
BPS	09/2023		0	COP	393	0	0
BPS	09/2023		1,920	EUR	1,750	0	(3)
BPS	09/2023		4,576	GBP	3,563	0	(46)
BPS	09/2023		880	HUF	303,154	0	(10)
BPS	09/2023		2,010	ILS	7,158	0	(75)
BPS	09/2023		3,200	KRW	4,117,524	0	(62)
BPS	09/2023		1,866	NZD	3,000	0	(29)
BPS	09/2023		500	PLN	2,044	1	0
BPS	09/2023		1,116	RON	5,066	0	(4)
BPS	09/2023		2,455	THB	84,125	0	(64)
BPS	09/2023		1,401	ZAR	26,143	0	(28)
BPS	12/2023	MXN	37,000	$	2,075	0	(17)
BRC	07/2023	CZK	19,829		897	0	(13)
BRC	07/2023	JPY	330,000		2,551	263	0
BRC	07/2023	MYR	19,112		4,166	63	0
BRC	07/2023	PLN	360		86	0	(3)
BRC	07/2023	SGD	96		72	1	0
BRC	07/2023	$	57	CZK	1,221	0	(1)
BRC	07/2023		1,061	PLN	4,400	21	0
BRC	07/2023		150	RON	691	2	0
BRC	08/2023	COP	7,636,115	$	1,792	0	(12)
BRC	08/2023	EUR	501		538	0	(10)
BRC	08/2023	GBP	1,029		1,291	0	(17)
BRC	08/2023	JPY	415,398		3,139	245	0
BRC	08/2023	$	182	CNH	1,297	0	(3)
BRC	08/2023		36	EUR	33	0	0
BRC	08/2023		418	GBP	331	3	0
BRC	08/2023		7	HUF	2,435	0	0
BRC	08/2023	ZAR	1,310	$	71	2	0
BRC	09/2023	ILS	9,265		2,590	86	0
BRC	09/2023	SGD	1,666		1,248	13	0
BRC	09/2023	$	50	HKD	392	0	0
BRC	09/2023		1,200	KRW	1,554,600	0	(15)
BSS	08/2023		11	EUR	10	0	0
CBK	07/2023	RON	2,944	$	651	4	0
CBK	07/2023	TRY	643		27	2	0
CBK	07/2023		494		22	3	0
CBK	07/2023	$	1,259	CLP	1,019,125	10	0
CBK	07/2023		696		563,659	4	0
CBK	07/2023		793	CZK	17,083	0	(9)
CBK	07/2023		6,400	INR	525,344	0	(2)

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
CBK	07/2023		3,309	PHP	180,529	0	(46)
CBK	07/2023		35	PLN	142	0	0
CBK	08/2023	CLP	975,143	$	1,212	3	0
CBK	08/2023	EUR	392		424	0	(5)
CBK	08/2023	GBP	512		645	0	(7)
CBK	08/2023	JPY	214,615		1,557	59	0
CBK	08/2023	TWD	75,531		2,467	41	0
CBK	08/2023	$	20	AUD	31	0	0
CBK	08/2023		397	CLP	324,766	5	0
CBK	08/2023		2,615		2,166,885	75	0
CBK	08/2023		295	EUR	274	5	0
CBK	08/2023		6,578	GBP	5,199	34	0
CBK	08/2023		222	JPY	30,400	0	(10)
CBK	08/2023	$	21	SEK	225	0	(1)
CBK	09/2023	IDR	35,365	$	2	0	0
CBK	09/2023	MXN	10,441		600	0	0
CBK	09/2023	SEK	4,639		429	0	(2)
CBK	09/2023	$	8	COP	35,884	0	0
CBK	09/2023		1,766	IDR	26,281,059	0	(21)
CBK	09/2023		5	KRW	7,062	0	0
CBK	09/2023		1,540	NOK	16,186	0	(25)
CBK	10/2023		89	CLP	72,644	1	0
CBK	11/2023	ILS	3,439	$	998	65	0
CBK	04/2024		3,509		969	10	0
FAR	07/2023	$	2	CLP	1,518	0	0
GRE	08/2023	GBP	160	$	202	0	(1)
GRE	08/2023	$	107	EUR	100	2	0
GRE	08/2023		224	GBP	180	5	0
GRE	08/2023		9	SEK	95	0	0
JPM	07/2023	SGD	1,316	$	996	23	0
JPM	07/2023	TRY	724		30	3	0
JPM	07/2023		343		14	1	0
JPM	07/2023	$	216	PHP	11,814	0	(3)
JPM	07/2023		87	PLN	363	2	0
JPM	07/2023		42	TRY	956	0	(5)
JPM	08/2023	CAD	2,959	$	2,212	0	(26)
JPM	08/2023	CHF	1,932		2,197	27	0
JPM	08/2023	CNH	17,950		2,598	121	0
JPM	08/2023	EUR	67		74	1	0
JPM	08/2023	JPY	332,288		2,501	187	0
JPM	08/2023	NOK	14,122		1,331	11	0
JPM	08/2023	$	294	EUR	270	1	0
JPM	08/2023		259	GBP	205	1	0
JPM	08/2023		5	HUF	1,637	0	0
JPM	08/2023		66	JPY	8,900	0	(4)
JPM	08/2023		1,173	NZD	1,900	0	(9)
JPM	09/2023	BRL	54	$	11	0	0
JPM	09/2023	CHF	3,415		3,800	0	(48)
JPM	09/2023	HKD	1,120		144	0	0
JPM	09/2023	IDR	17,838,000		1,200	15	0
JPM	09/2023	ILS	5,741		1,616	65	0
JPM	09/2023	INR	276,183		3,348	0	(9)

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
JPM	09/2023	JPY	185,497		1,300	1	0
JPM	09/2023	PHP	112,986		2,009	0	(30)
JPM	09/2023	SEK	4,640		429	0	(2)
JPM	09/2023	THB	155,069		4,467	60	0
JPM	09/2023	$	482	AUD	700	0	(15)
JPM	09/2023		500	CLP	407,700	3	0
JPM	09/2023		620	HUF	213,393	0	(8)
JPM	09/2023		390	ILS	1,405	0	(11)
JPM	09/2023		700	KRW	887,110	0	(24)
JPM	09/2023		600	MXN	10,619	10	0
JPM	09/2023		560	NOK	5,874	0	(10)
JPM	09/2023		4,304	PEN	15,847	41	0
JPM	09/2023		900	PHP	50,139	5	0
JPM	09/2023		0	THB	9	0	0
JPM	09/2023		1,599	ZAR	29,742	0	(37)
MBC	07/2023	SGD	42	$	32	1	0
MBC	07/2023	$	13	SGD	17	0	0
MBC	08/2023	EUR	344	$	372	0	(5)
MBC	08/2023	TWD	2,632		86	2	0
MBC	08/2023	$	3,429	CAD	4,555	15	0
MBC	08/2023		572	EUR	530	8	0
MBC	08/2023		160	GBP	125	0	(1)
MBC	08/2023		25	ZAR	478	1	0
MBC	08/2023		23		445	1	0
MBC	09/2023	KRW	1,335,435	$	1,047	29	0
MBC	09/2023	$	61	HKD	474	0	0
MBC	09/2023	ZAR	2,082	$	111	2	0
MYI	07/2023	IDR	10,107,387		676	2	0
MYI	07/2023	INR	525,440		6,400	1	0
MYI	07/2023	MXN	764		45	0	0
MYI	07/2023	MYR	6,371		1,384	16	0
MYI	07/2023	TRY	373		15	1	0
MYI	07/2023		951		39	2	0
MYI	07/2023	$	63	CZK	1,345	0	(1)
MYI	07/2023		673	IDR	10,107,387	2	0
MYI	07/2023		413	JPY	59,700	0	0
MYI	07/2023		2,107	MYR	9,704	0	(24)
MYI	07/2023		18	PLN	78	1	0
MYI	07/2023		14	TRY	372	0	0
MYI	08/2023	CAD	346	$	260	0	(1)
MYI	08/2023	NOK	13,695		1,293	13	0
MYI	08/2023	TWD	18,567		612	16	0
MYI	08/2023	$	165	CAD	219	1	0
MYI	08/2023		436	EUR	400	2	0
MYI	08/2023		115	JPY	16,000	0	(3)
MYI	08/2023		51	SEK	555	0	0
MYI	08/2023		45	ZAR	865	1	0
MYI	08/2023		38		748	1	0
MYI	09/2023	BRL	1,968	$	400	0	(2)
MYI	09/2023	INR	76,400		926	0	(2)
MYI	09/2023	KRW	1,500,815		1,173	29	0
MYI	09/2023	THB	69,930		2,012	25	0

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
MYI	09/2023	TRY	734		27	0	0
MYI	09/2023	$	2,350	CAD	3,105	0	0
MYI	09/2023		676	IDR	10,116,174	0	(4)
MYI	09/2023		7,020	INR	577,529	0	0
MYI	09/2023		500	MXN	8,742	2	0
RBC	07/2023		6,639		127,736	796	0
RBC	08/2023	GBP	1,887	$	2,385	0	(15)
RBC	08/2023	$	11	CAD	15	0	0
RBC	08/2023		10	EUR	9	0	0
RBC	08/2023		159	GBP	126	1	0
RBC	08/2023		231	MXN	3,998	0	0
RBC	09/2023		500	JPY	68,566	0	(20)
SCX	07/2023	CZK	824	$	37	0	(1)
SCX	07/2023	TRY	642		28	3	0
SCX	08/2023	AUD	147		96	0	(2)
SCX	08/2023	CNH	9,605		1,396	71	0
SCX	08/2023	GBP	203		256	0	(2)
SCX	08/2023	NOK	85		8	0	0
SCX	08/2023	NZD	1,284		801	15	0
SCX	08/2023	SEK	18,470		1,733	20	0
SCX	08/2023	$	88	AUD	131	0	(1)
SCX	08/2023		55	GBP	44	1	0
SCX	09/2023	INR	221,219	$	2,686	0	(3)
SCX	09/2023	THB	62,096		1,797	32	0
SCX	09/2023	TWD	55,826		1,831	35	0
SCX	09/2023	$	6,080	INR	500,025	0	(2)
SOG	07/2023	PLN	411	$	96	0	(6)
SOG	07/2023	SGD	49		37	1	0
SOG	08/2023	$	40	ZAR	728	0	(1)
SOG	09/2023		1,080	IDR	16,075,029	0	(13)
SSB	07/2023	BRL	7,003	$	1,465	13	0
SSB	07/2023	CLP	1,022,106		1,272	0	0
SSB	07/2023	COP	23,178,877		5,545	0	(6)
SSB	07/2023	$	1,453	BRL	7,003	0	(1)
SSB	07/2023		5,545	COP	23,349,668	10	0
SSB	07/2023		5,224		23,178,877	326	0
SSB	08/2023		1,272	CLP	1,025,058	0	(1)
SSB	09/2023	CLP	395,518	$	485	0	(3)
SSB	09/2023	$	5,247	BRL	26,254	133	0
TOR	07/2023	COP	103,651	$	25	0	0
TOR	07/2023		102,813		25	0	0
TOR	07/2023	$	25	COP	102,813	0	0
TOR	08/2023		127	GBP	100	1	0
TOR	08/2023		1,987	HUF	695,798	22	0
UAG	07/2023	TRY	4,648	$	202	25	0
UAG	07/2023	$	9	CZK	197	0	0
UAG	07/2023		204	TRY	4,643	0	(27)
UAG	08/2023	EUR	1,023	$	1,118	0	0
UAG	08/2023	GBP	493		623	0	(4)
UAG	08/2023	HUF	8,026		23	0	0
UAG	08/2023	JPY	350,000		2,582	147	0
UAG	08/2023	$	38	GBP	30	0	0

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
UAG	08/2023		55	ZAR	1,099	3	0
UAG	08/2023	ZAR	59,352	$	3,091	0	(37)
UAG	09/2023	ILS	7,695		2,149	70	0
UAG	09/2023	$	1,084	RON	4,923	0	(3)
						$ 4,530	$ (1,205)

●(JPY-Hedged)-Retailの外国為替先渡し契約

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨		未実現評価損益 資産	未実現評価損益 負債
BOA	07/2023	JPY	2,729,516	$	18,904	$ 19	$ 0
BOA	07/2023	$	20,755	JPY	2,884,938	0	(795)
BOA	08/2023		18,389		2,646,671	7	0
BPS	07/2023	JPY	2,657,887	$	18,389	0	0
BPS	07/2023	$	20,446	JPY	2,841,980	0	(783)
BPS	08/2023		18,389		2,646,671	7	0
CBK	07/2023	JPY	110,699	$	783	17	0
CBK	07/2023	$	540	JPY	77,317	0	(5)
JPM	07/2023	JPY	942,402	$	6,590	70	0
JPM	08/2023	$	6,590	JPY	938,397	0	(67)
MBC	07/2023	JPY	23,657	$	165	1	0
MYI	07/2023		6,601		48	2	0
MYI	07/2023	$	236	JPY	34,048	0	0
SCX	07/2023	JPY	1,667,007	$	11,534	0	0
SCX	07/2023	$	16,901	JPY	2,349,234	0	(647)
SCX	08/2023		11,534		1,659,972	5	0
						$ 128	$ (2,297)
外国為替先渡し契約合計						**$ 4,658**	**$ (3,502)**

●スワップ契約

金利スワップ

単位:千

取引相手	変動金利支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	支払/(受取)プレミアム	未実現評価損益	スワップ契約(時価) 資産	スワップ契約(時価) 負債
BOA	支払	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	12/21/2027	MYR 20,700	$ 6	$ 12	$ 18	$ 0
BOA	支払	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	03/15/2028	8,100	4	(16)	0	(12)
BOA	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	03/15/2028	7,400	4	7	11	0
BOA	支払	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	03/15/2028	10,600	18	(8)	10	0
BOA	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	03/15/2028	35,800	(13)	(19)	0	(32)
SCX	支払	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	03/15/2028	21,500	47	(28)	19	0
						$ 66	$ (52)	$ 58	$ (44)

トータル・リターン・スワップ

単位：千

取引相手	支払/受取[1]	参照債務	株式数または受益証券口数	借入金利	支払い頻度	想定元本		満期日	支払/(受取)プレミアム	未実現評価損益	スワップ契約(時価) 資産	スワップ契約(時価) 負債
MEI	受取	BOVESPA Index	67	0.000%	Maturity	BRL	8,083	08/16/2023	$ 0	$ (11)	$ 0	$ (11)
MEI	受取	KOSPI2 Index	11,250,000	0.000%	Maturity	KRW	3,884,636	09/14/2023	0	(41)	0	(41)
MEI	支払	Thailand Equity Index	95,800	0.000%	Maturity	THB	86,388	09/28/2023	0	(34)	0	(34)
									$ 0	$ (86)	$ 0	$ (86)
スワップ契約合計									**$ 66**	**$ (138)**	**$ 58**	**$ (130)**

[1] 受取は、ファンドが対象となる参照資産から生まれたプラスのネット・リターンに係る支払いを受けること意味する。ファンドは、当該対象となる参照資産から生まれたマイナスのネット・リターンに係る支払いを行なう。支払は、ファンドが対象となる参照資産から生まれたマイナスのネット・リターンに係る支払いを受けることを意味する。ファンドは、当該対象となる参照資産から生まれたプラスのネット・リターンに係る支払いを行なう。

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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	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。

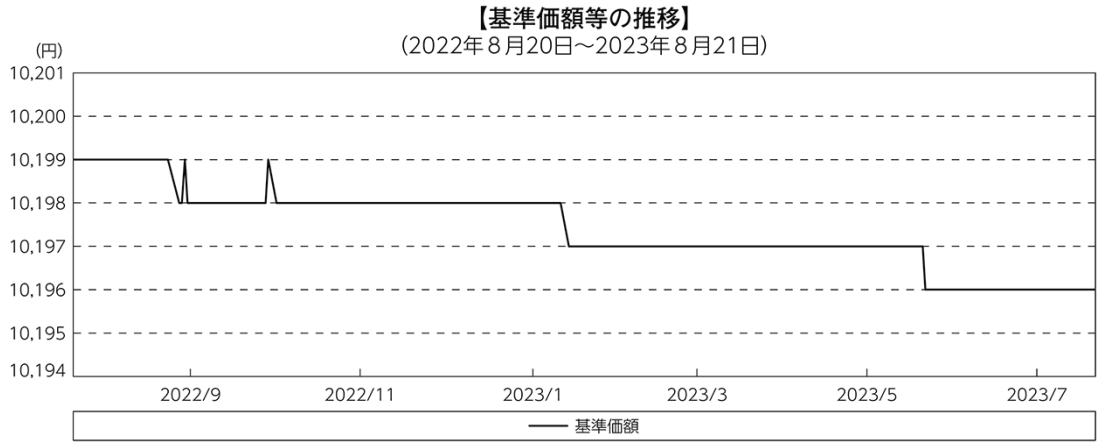
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
(期　首)	円	%	%	%
2022年８月19日	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。

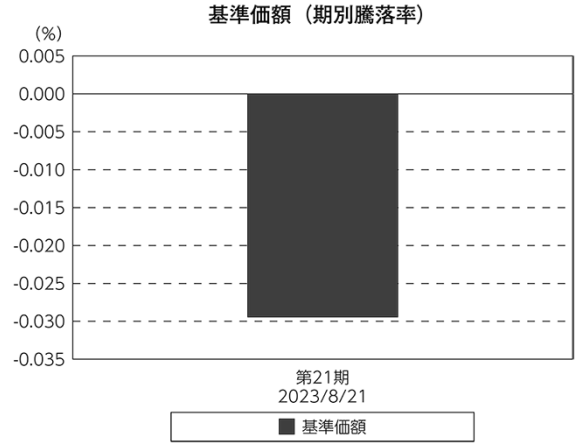
○当ファンドのポートフォリオ

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留意ください。

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
		千円	千円
国内	地方債証券	4,557,523	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ＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	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
	千円	%
公社債	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(マネープール・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)K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・ゴールドンBDC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50(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(マネープール・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（ブラジルレアルコース）毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（円コース）年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資（円コース）年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）年2回決算型	983,672
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・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（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608

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（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信（中国元コース）年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信（毎月分配型）	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（円コース）毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（円コース）年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）毎月分配型	982,029
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（ブラジルレアルコース）毎月分配型	398,357
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）年2回決算型	373,897
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型	123,377
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（ブラジルレアルコース）年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型	98,261

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
野村テンプルトン・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
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98,078
ウエリントン・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）のむラップ・ファンド（普通型）	98,001
（年6%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信（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テンプルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプルトン・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

○お知らせ

該当事項はございません。