

【受益者の皆様へ】

2015年9月1日

野村アセットマネジメント株式会社

## 「バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06」の 組み入れに関するお知らせ

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

2015年6月29日に設定しました「バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06」(以下、ファンド)が投資する円建て外国投資信託※において組み入れが概ね完了しましたことをごお知らせいたします。

- ファンドが投資する円建て外国投資信託※の組入比率(2015年8月25日時点) : 95.9%

※ノムラ・グローバル・マネージャー・セレクト・バンクローン・ファンド-日本円為替ヘッジクラス

- ファンドのポートフォリオの平均最終利回り(為替ヘッジ前)(2015年8月25日時点) : 5.4%  
(為替ヘッジ後)(2015年8月25日時点) : 5.1%

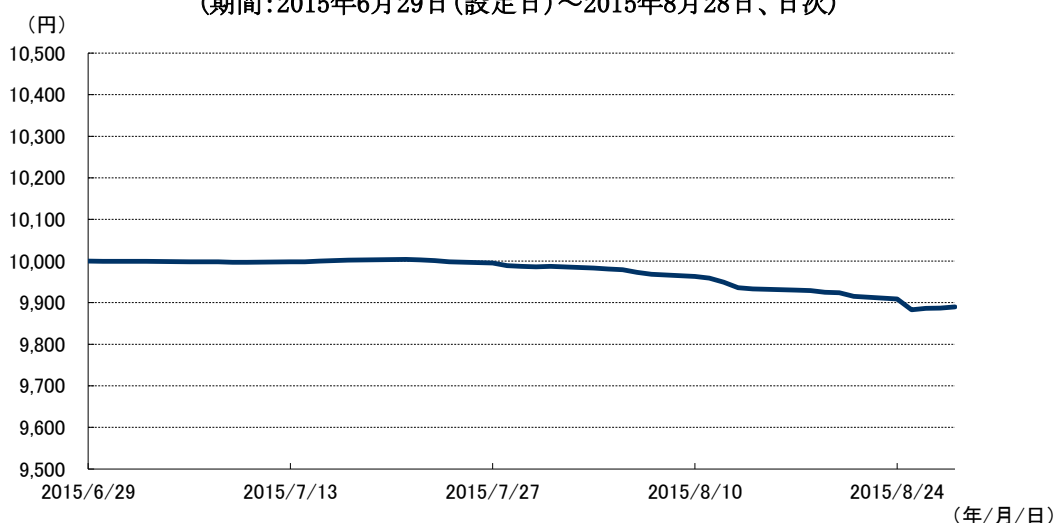
・平均最終利回り(為替ヘッジ前)は、ファンドの組入ローン等の最終利回りを、その組入比率で加重平均したものです。  
平均最終利回り(為替ヘッジ後)は、平均最終利回り(為替ヘッジ前)に為替ヘッジコスト/プレミアムを反映したものです。

- (ご参考)設定後のバンクローン市場について

2015年6月29日の設定日以降8月にかけて、バンクローン市場は軟調に推移したものの、足元では値を戻しつつあります。ファンド設定直後の7月にギリシャの債務問題や中国株式市場の下落等によるセンチメントの悪化を受けて世界の株式市場が弱含む局面もありましたが、バンクローン市場は底堅く推移しました。しかしながら、8月以降は米国の利上げが意識されるなか、中国人民元の切り下げに端を発した中国経済を含むグローバル経済の先行き不透明感に対する懸念や原油価格等商品市況の下落を受けて、リスク回避的な動きにより、バンクローン市場は下落しました。8月下旬に世界的に株式市場が反発するなど投資家のリスク回避的な動きが和らぐなか、バンクローンの価格は足元では値を戻しつつあります。現在のバンクローン市場は良好な投資機会と捉えており、今後の市場動向を見極めながら割安な銘柄に投資を行なう予定です。

### 基準価額の推移

(期間:2015年6月29日(設定日)~2015年8月28日、日次)



上記は過去の運用実績であり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

今後とも「バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06」をご愛顧賜りますよう宜しくお願いいたします。

以上

当資料は、ファンドの運用実績に関する情報提供を目的として野村アセットマネジメントが作成した資料で、投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。当資料中の記載事項は、当資料作成時点のものであり、事前の連絡なしに変更されることがあります。なお、当資料中のいかなる内容も将来の投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、バンクローン等に実質的に投資します(また、外貨建資産に投資しますので、この他に為替変動リスクもあります。)ので、基準価額は変動します。したがって、元金が保証されているものではありません。ファンドに生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。