

# 野村ニュージーランド債券ファンド (年2回決算型)

## 運用報告書(全体版)

第14期(決算日2021年8月12日)

作成対象期間(2021年2月13日～2021年8月12日)

### 受益者のみなさまへ

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

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2014年9月10日から2024年8月13日までです。	
運用方針	ニュージーランド債券オープン マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主としてニュージーランドドル建ての公社債に投資し、インカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。	
主な投資対象	野村ニュージーランド債券ファンド(年2回決算型)	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	ニュージーランドドル建ての公社債(国際機関債、政府機関債、準政府債(州政府債)、国債、社債等)を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村ニュージーランド債券ファンド(年2回決算型)	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
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、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

## 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/>

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 分 配 金		騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	配 金	騰 落	率			
	円		円		%	%	%	百万円
10期(2019年8月13日)	10,389		10		△3.0	97.6	—	59
11期(2020年2月12日)	10,704		10		3.1	97.1	—	61
12期(2020年8月12日)	11,120		10		4.0	97.8	—	61
13期(2021年2月12日)	11,673		10		5.1	96.8	—	65
14期(2021年8月12日)	11,578		10		△0.7	96.6	—	60

\* 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。

\* 当ファンドはマザーファンドを通じ、ニュージーランドドル建ての公社債に投資しておりますが、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰 落	率			
(期 首)	円		%	%	%	%
2021年2月12日	11,673		—	96.8	—	—
2月末	11,621		△0.4	96.9	—	—
3月末	11,612		△0.5	95.8	—	—
4月末	11,935		2.2	97.8	—	—
5月末	11,824		1.3	96.9	—	—
6月末	11,583		△0.8	97.8	—	—
7月末	11,587		△0.7	97.3	—	—
(期 末)						
2021年8月12日	11,588		△0.7	96.6	—	—

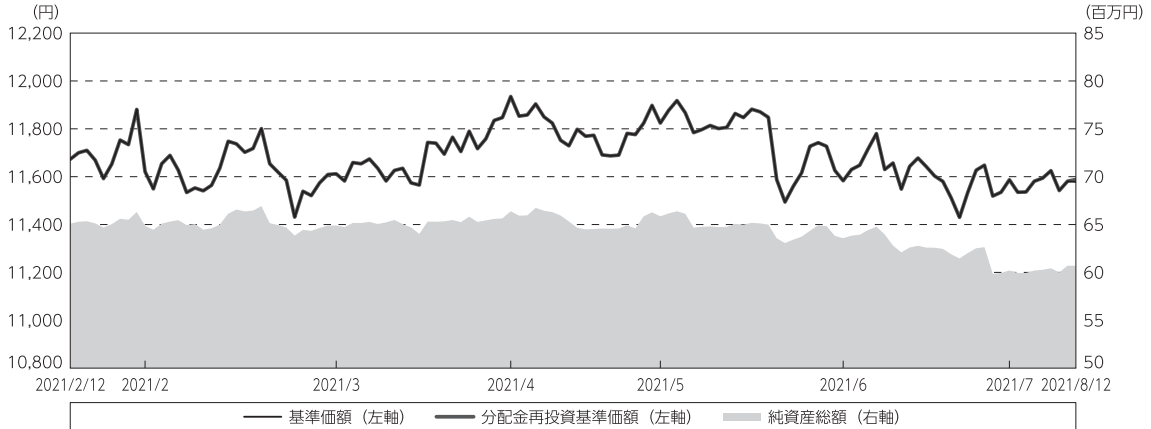
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：11,673円

期 末：11,578円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△0.7%（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（2021年2月12日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

（上昇要因）・債券保有による利息収入を得られたこと。

・ニュージーランドドルが対円で上昇（円安）したこと。

（下落要因）・保有する債券の価格が下落したこと。

## ○投資環境

ニュージーランドドルについては、新型コロナウイルスのワクチン接種が世界的に進行するなかで、ニュージーランドの良好な経済指標が確認されたことや、利上げ観測が高まったことなどから、ニュージーランドドルは対円で上昇となりました。

債券については、ニュージーランドの景気の回復が確認されるなかで、RBNZ（ニュージーランド準備銀行）の量的緩和プログラムの終了に伴う金融政策の縮小等を背景にニュージーランド国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

[ニュージーランド債券オープン マザーファンド]

### <ファンドデュレーション>

RBNZが政策金利を据え置くなか、デュレーションを前作成期末から若干短期化しました。

当作成期末時点でのファンドのデュレーション<sup>(※)</sup>は、6.2年としています。

(※) デュレーションとは、債券の利回り変化に対する価格変化の感応度を表し、数値が大きいほど利回り変化に対する価格変化が大きくなります。ファンドデュレーションとは、債券デュレーション×債券組入比率で表されます。

### <セクター・アロケーション>

利回り水準・信用力を勘案して、高格付けの国際機関債や政府機関債、地方債を中心としたポートフォリオとしました。

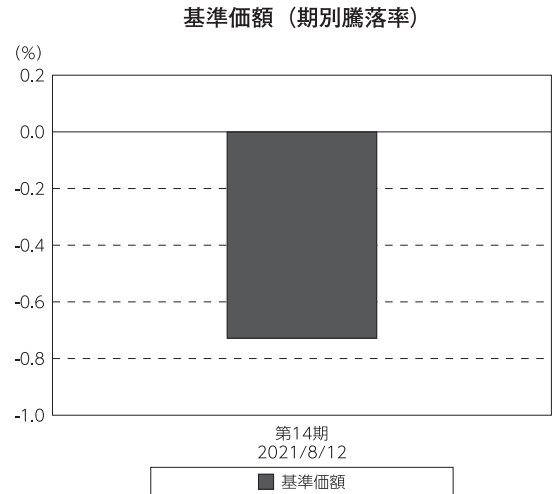
## [野村ニュージーランド債券ファンド（年2回決算型）]

主要投資対象であるニュージーランド債券オープン マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持し、マザーファンドの投資成果を享受するよう努めました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドはマザーファンドを通じ、ニュージーランドドル建ての公社債に投資しておりますが、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

分配金については、基準価額水準等を勘案し、決定いたしました。  
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いません。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第14期
	2021年2月13日～ 2021年8月12日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.086%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,640

(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

### [ニュージーランド債券オープン マザーファンド]

ニュージーランドドル建ての公社債（国際機関債、政府機関債、準政府債（州政府債）、国債、社債等）を主要投資対象とし、インカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。

#### ・投資戦略

##### <ファンドデュレーション>

グローバルな経済環境の変化やニュージーランドの政策金利見通しを見極めながらコントロールします。

##### <セクター・アロケーション>

利回り水準・信用力を勘案してアロケーションを決定します。足元の環境では、引き続き国際機関債や政府機関債、地方債を中心としたポートフォリオとする見込みです。

### [野村ニュージーランド債券ファンド（年2回決算型）]

主要投資対象であるニュージーランド債券オープン マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持し、マザーファンドの投資成果を享受するよう努めます。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年2月13日～2021年8月12日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 66	% 0.562	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(32)	(0.273)	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 ）	(32)	(0.273)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	( 2 )	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	1	0.007	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 1 )	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 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	67	0.569	
期中の平均基準価額は、11,693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。

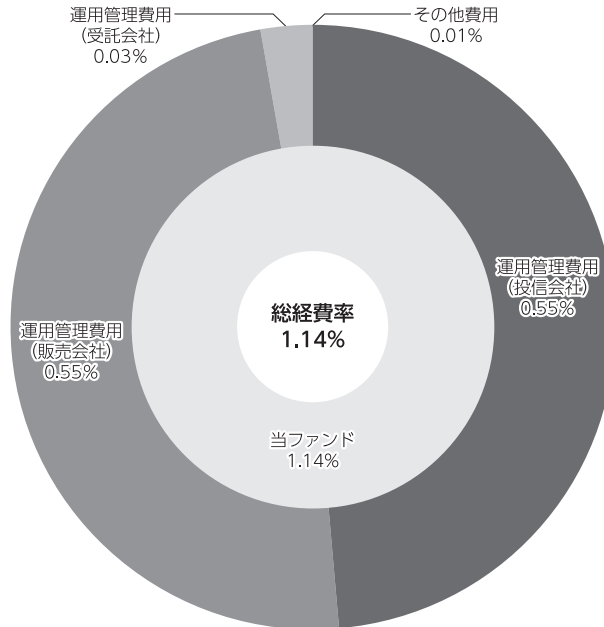
\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 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1.14%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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

(2021年2月13日～2021年8月12日)

## 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
ニュージーランド債券オープン マザーファンド	千口 4,332	千円 5,461	千口 7,650	千円 9,615

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年2月13日～2021年8月12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

(2021年8月12日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ニュージーランド債券オープン マザーファンド	千口 51,676	千口 48,358	千円 60,356

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年8月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ニュージーランド債券オープン マザーファンド	千円 60,356	% 98.8
コール・ローン等、その他	748	1.2
投資信託財産総額	61,104	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*ニュージーランド債券オープン マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,034,125千円）の投資信託財産総額（2,047,627千円）に対する比率は99.3%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1ニュージーランドドル=77.68円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年8月12日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	61,104,313
コール・ローン等	747,754
ニュージーランド債券オープン マザーファンド(評価額)	60,356,559
(B) 負債	414,862
未払収益分配金	52,418
未払解約金	16
未払信託報酬	361,820
その他未払費用	608
(C) 純資産総額(A-B)	60,689,451
元本	52,418,832
次期繰越損益金	8,270,619
(D) 受益権総口数	52,418,832口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,578円

(注) 期首元本額は55,773,512円、期中追加設定元本額は6,449,325円、期中一部解約元本額は9,804,005円、1口当たり純資産額は1,1578円です。

## ○損益の状況（2021年2月13日～2021年8月12日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 7
支払利息	△ 7
(B) 有価証券売買損益	△ 104,706
売買益	63,106
売買損	△ 167,812
(C) 信託報酬等	△ 362,428
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 467,141
(E) 前期繰越損益金	5,910,477
(F) 追加信託差損益金	2,879,701
(配当等相当額)	( 5,124,547)
(売買損益相当額)	(△2,244,846)
(G) 計(D+E+F)	8,323,037
(H) 収益分配金	△ 52,418
次期繰越損益金(G+H)	8,270,619
追加信託差損益金	2,879,701
(配当等相当額)	( 5,134,022)
(売買損益相当額)	(△2,254,321)
分配準備積立金	8,707,537
繰越損益金	△3,316,619

\* 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（2021年2月13日～2021年8月12日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年2月13日～ 2021年8月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	486,922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	5,134,022円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	8,273,033円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	13,893,977円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,650円
g. 分配金	52,418円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

## ○分配金のお知らせ

---

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2021年8月12日現在）

## ＜ニュージーランド債券オープン マザーファンド＞

下記は、ニュージーランド債券オープン マザーファンド全体(1,636,385千口)の内容です。

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル	千円	%	%	%	%	%
ニュージーランド	24,500	25,548	1,984,569	97.2	—	72.8	24.3	—
合 計	24,500	25,548	1,984,569	97.2	—	72.8	24.3	—

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。  
 \* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ニュージーランド		%	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル	千円		
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5	1,500	1,745	135,605	2027/4/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0	2,000	2,198	170,779	2029/4/20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5	1,400	1,372	106,628	2031/5/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.75	1,500	1,341	104,227	2041/5/15	
地方債証券	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	4.5	3,400	3,885	301,811	2027/4/15	
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	3.5	2,700	3,015	234,246	2033/4/14	
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	2.0	1,000	920	71,502	2037/4/15	
特殊債券 (除く金融債)	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.5	2,000	2,109	163,842	2024/5/30	
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1.125	2,000	1,889	146,776	2028/2/10	
	INTL BK RECON & DEVELOP	2.5	1,500	1,540	119,655	2024/1/24	
	INTL BK RECON & DEVELOP	0.625	3,000	2,777	215,718	2027/9/24	
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5.375	2,500	2,752	213,775	2024/4/23	
合 計					1,984,569		

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。  
 \* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

# ニュージーランド債券オープン マザーファンド

## 運用報告書

第7期（決算日2021年2月12日）

作成対象期間（2020年2月13日～2021年2月12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	ニュージーランドドル建ての公社債（国際機関債、政府機関債、準政府債（州政府債）、国債、社債等）を主要投資対象とし、インカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。 投資する公社債は、原則として、投資時点においてBBB一格相当以上の格付け（投資適格格付け）を有する公社債、または同等の信用度を有すると判断される公社債とします。
主な投資対象	ニュージーランドドル建ての公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は、転換社債を転換したもの等に限る、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。

**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

<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	債券率	債先物比率	債券率	純資産額
		騰落	中率					
3期(2017年2月13日)	円		%	%	%			百万円
	10,895		12.1	97.8	—			4,138
4期(2018年2月13日)	11,035		1.3	97.4	—			3,404
5期(2019年2月12日)	11,172		1.2	97.4	—			2,716
6期(2020年2月12日)	11,311		1.2	97.9	—			2,433
7期(2021年2月12日)	12,500		10.5	97.5	—			2,215

\*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、ニュージーランドドル建ての公社債に投資しておりますが、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

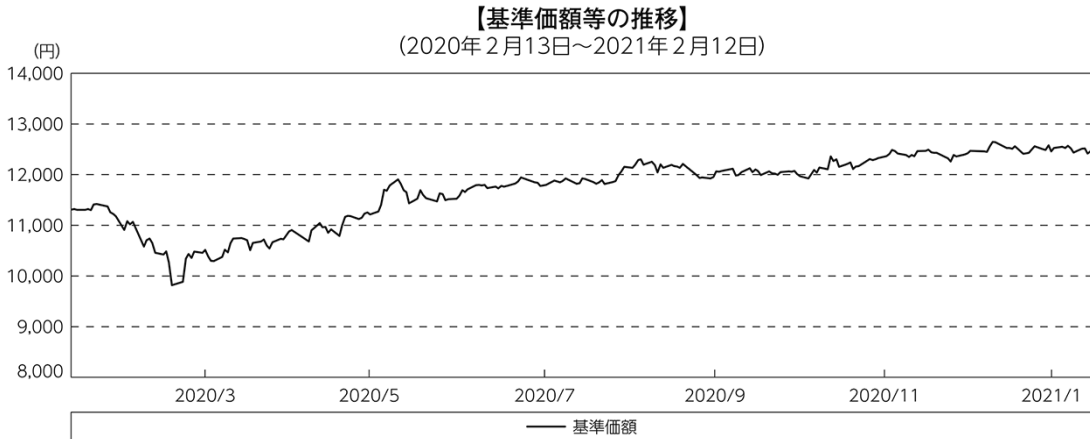
年月日	基準	価額		債組入比率	債券率	債先物比率	債券率
		騰落	率				
(期首) 2020年2月12日	円		%	%	%		%
	11,311		—	97.9	—		—
2月末	11,175	△	1.2	97.1	—		—
3月末	10,516	△	7.0	95.9	—		—
4月末	10,882	△	3.8	97.4	—		—
5月末	11,214	△	0.9	98.7	—		—
6月末	11,582		2.4	98.6	—		—
7月末	11,794		4.3	97.5	—		—
8月末	12,134		7.3	96.5	—		—
9月末	12,064		6.7	97.4	—		—
10月末	11,966		5.8	97.4	—		—
11月末	12,362		9.3	98.7	—		—
12月末	12,468		10.2	97.6	—		—
2021年1月末	12,527		10.8	97.5	—		—
(期末) 2021年2月12日	12,500		10.5	97.5	—		—

\*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

基準価額は、期首の11,311円から期末12,500円となりました。

(上昇要因)

- ・債券保有による利息収入を得られたこと。
- ・ニュージーランドドルが対円で上昇（円安）したこと。

### ○当ファンドのポートフォリオ <ファンドデュレーション>

RBNZ（ニュージーランド準備銀行）が新型コロナウイルスの感染拡大を受けて金融緩和を進めるなか、デュレーションを前期末から長期化しました。期末時点でのファンドのデュレーション<sup>(※)</sup>は、6.6年としています。

(※) デュレーションとは、債券の利回り変化に対する価格変化の感応度を表し、数値が大きいほど利回り変化に対する価格変化が大きくなります。ファンドデュレーションとは、債券デュレーション×債券組入比率で表されます。

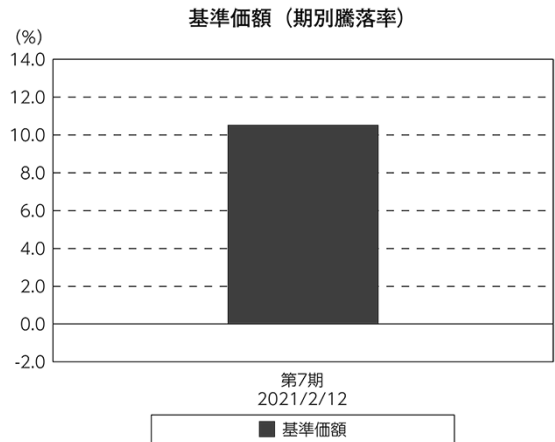
### <セクター・アロケーション>

利回り水準・信用力を勘案して、高格付けの国際機関債や政府機関債、地方債を中心としたポートフォリオとしました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、ニュージーランドドル建ての公社債に投資しておりますが、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

ニュージーランドドル建ての公社債（国際機関債、政府機関債、準政府債（州政府債）、国債、社債等）を主要投資対象とし、インカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。

### ・投資戦略

#### <ファンドデュレーション>

グローバルな経済環境の変化やニュージーランドの政策金利見通しを見極めながらコントロールします。

#### <セクター・アロケーション>

利回り水準・信用力を勘案してアロケーションを決定します。足元の環境では、引き続き国際機関債や政府機関債、地方債を中心としたポートフォリオとする見込みです。

今後とも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

(2020年2月13日～2021年2月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.015	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.015)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、11,723円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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。

○ 売買及び取引の状況

(2020年2月13日～2021年2月12日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
			千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル
外 国	ニュージーランド	国債証券	5,455	4,586
		地方債証券	1,008	2,357
		特殊債券	4,992	9,868

\*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。

○ 利害関係人との取引状況等

(2020年2月13日～2021年2月12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

(2021年2月12日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 26,100	千ニュージーランドドル 28,573	千円 2,161,281	% 97.5	% -	% 74.9	% 22.7	% -
合 計	26,100	28,573	2,161,281	97.5	-	74.9	22.7	-

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 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。

(B) 外国(外貨建)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
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ニュージーランド		%	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル	千円	
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5	1,500	1,831	138,511	2027/4/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0	2,000	2,295	173,628	2029/4/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5	1,400	1,426	107,894	2031/5/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.75	1,500	1,397	105,712	2041/5/15
地方債証券	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	4.5	5,000	6,003	454,087	2027/4/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	3.5	2,700	3,161	239,104	2033/4/14
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	2.0	1,000	953	72,120	2037/4/15
特殊債券 (除く金融債)	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.5	2,000	2,185	165,333	2024/5/30
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1.125	2,000	1,970	149,025	2028/2/10
	INTL BK RECON & DEVELOP	2.5	1,500	1,586	119,993	2024/1/24
	INTL BK RECON & DEVELOP	0.625	3,000	2,889	218,590	2027/9/24
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5.375	2,500	2,872	217,275	2024/4/23
合 計					2,161,281	

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年2月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 2,161,281	% 97.3
コール・ローン等、その他	59,762	2.7
投資信託財産総額	2,221,043	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産(2,194,300千円)の投資信託財産総額(2,221,043千円)に対する比率は98.8%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1ニュージーランドドル=75.64円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年2月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,221,043,549
コール・ローン等	42,423,459
公社債(評価額)	2,161,281,118
未収利息	17,338,972
(B) 負債	5,170,006
未払解約金	5,170,000
未払利息	6
(C) 純資産総額(A-B)	2,215,873,543
元本	1,772,715,216
次期繰越損益金	443,158,327
(D) 受益権総口数	1,772,715,216口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,500円

(注) 期首元本額は2,151,627,037円、期中追加設定元本額は93,995,479円、期中一部解約元本額は472,907,300円、1口当たり純資産額は1,2500円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

・ニュージーランド債券オープン<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	786,349,179円
・ニュージーランド債券オープン<為替アクティブヘッジ>(毎月分配型)	348,104,100円
・ニュージーランド債券オープン<為替ヘッジなし>(年2回決算型)	272,474,104円
・ニュージーランド債券オープン<為替アクティブヘッジ>(年2回決算型)	191,781,770円
・野村ニュージーランド債券ファンド(毎月分配型)	122,329,751円
・野村ニュージーランド債券ファンド(年2回決算型)	51,676,312円

## ○損益の状況 (2020年2月13日～2021年2月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	76,303,079
受取利息	76,306,975
支払利息	△ 3,896
(B) 有価証券売買損益	151,190,538
売買益	193,305,545
売買損	△ 42,115,007
(C) 保管費用等	△ 342,276
(D) 当期損益金(A+B+C)	227,151,341
(E) 前期繰越損益金	282,036,465
(F) 追加信託差損益金	10,457,521
(G) 解約差損益金	△ 76,487,000
(H) 計(D+E+F+G)	443,158,327
次期繰越損益金(H)	443,158,327

\*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(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。

\*損益の状況の中で(G)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。

## ○お知らせ

該当事項はございません。