

# 野村グローバルCB投信 (資源国通貨コース) 毎月分配型

## 運用報告書(全体版)

第140期(決算日2022年4月20日) 第141期(決算日2022年5月20日) 第142期(決算日2022年6月20日)  
第143期(決算日2022年7月20日) 第144期(決算日2022年8月22日) 第145期(決算日2022年9月20日)

作成対象期間(2022年3月23日～2022年9月20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	2010年7月22日から2025年9月22日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨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への投資を通じて、日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債(以下「グローバルCB」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目的として運用を行います。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス受益証券への投資を中心としますが、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	野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨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。
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス	グローバルCBを主要投資対象とします。
主な投資制限	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。
	野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	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。
	毎決算時に、原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なうことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合や安定分配とならない場合があります。なお、毎年3月および9月の決算時には、安定分配相当額に委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。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。「原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なう」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。	

## 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/>

## ○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 証 組 入 比	信 託 券 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分	込 配							
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	百万円
116期(2020年4月20日)	5,346	20	4.2	0.0	—	—	99.2	—	99.2	5,341
117期(2020年5月20日)	5,396	20	1.3	0.0	—	—	99.3	—	99.3	5,357
118期(2020年6月22日)	5,915	20	10.0	0.0	—	—	99.2	—	99.2	5,847
119期(2020年7月20日)	6,114	20	3.7	0.0	—	—	99.2	—	99.2	6,002
120期(2020年8月20日)	6,166	20	1.2	0.0	—	—	99.2	—	99.2	5,989
121期(2020年9月23日)	6,311	20	2.7	0.0	—	—	99.2	—	99.2	6,065
122期(2020年10月20日)	6,286	20	△ 0.1	0.0	—	—	99.3	—	99.3	5,940
123期(2020年11月20日)	6,589	20	5.1	0.0	—	—	99.0	—	99.0	6,155
124期(2020年12月21日)	7,225	20	10.0	0.0	—	—	99.3	—	99.3	6,665
125期(2021年1月20日)	7,268	20	0.9	0.0	—	—	99.1	—	99.1	6,619
126期(2021年2月22日)	7,726	20	6.6	0.0	—	—	99.2	—	99.2	6,885
127期(2021年3月22日)	7,433	20	△ 3.5	0.0	—	—	99.0	—	99.0	6,565
128期(2021年4月20日)	7,620	20	2.8	0.0	—	—	99.0	—	99.0	6,631
129期(2021年5月20日)	7,560	20	△ 0.5	0.0	—	—	99.3	—	99.3	6,513
130期(2021年6月21日)	7,980	20	5.8	0.0	—	—	99.3	—	99.3	6,788
131期(2021年7月20日)	7,668	20	△ 3.7	0.0	—	—	98.9	—	98.9	6,471
132期(2021年8月20日)	7,559	20	△ 1.2	0.0	—	—	99.0	—	99.0	6,333
133期(2021年9月21日)	7,954	20	5.5	0.0	—	—	99.0	—	99.0	6,560
134期(2021年10月20日)	8,130	20	2.5	0.0	—	—	99.3	—	99.3	6,604
135期(2021年11月22日)	7,933	20	△ 2.2	0.0	—	—	99.1	—	99.1	6,318
136期(2021年12月20日)	7,345	20	△ 7.2	0.0	—	—	99.1	—	99.1	5,792
137期(2022年1月20日)	7,330	20	0.1	0.0	—	—	99.0	—	99.0	5,748
138期(2022年2月21日)	7,438	20	1.7	0.0	—	—	99.3	—	99.3	5,765
139期(2022年3月22日)	7,622	20	2.7	0.0	—	—	99.2	—	99.2	5,902
140期(2022年4月20日)	8,444	20	11.0	0.0	—	—	99.0	—	99.0	6,450
141期(2022年5月20日)	7,258	20	△ 13.8	0.0	—	—	99.3	—	99.3	5,511
142期(2022年6月20日)	7,260	20	0.3	0.0	—	—	99.0	—	99.0	5,488
143期(2022年7月20日)	7,160	20	△ 1.1	0.0	—	—	99.2	—	99.2	5,388
144期(2022年8月22日)	7,657	20	7.2	0.0	—	—	98.8	—	98.8	5,734
145期(2022年9月20日)	7,510	20	△ 1.7	0.0	—	—	98.9	—	98.9	5,447

\* 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。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	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	騰 落 率			
第140期	(期 首) 2022年 3月22日	円 7,622	% -	% 0.0	% -	% 99.2	
	3月末	8,289	8.8	0.0	-	99.1	
	(期 末) 2022年 4月20日	8,464	11.0	0.0	-	99.0	
第141期	(期 首) 2022年 4月20日	8,444	-	0.0	-	99.0	
	4月末	7,702	△ 8.8	0.0	-	99.2	
	(期 末) 2022年 5月20日	7,278	△13.8	0.0	-	99.3	
第142期	(期 首) 2022年 5月20日	7,258	-	0.0	-	99.3	
	5月末	7,529	3.7	0.0	-	99.3	
	(期 末) 2022年 6月20日	7,280	0.3	0.0	-	99.0	
第143期	(期 首) 2022年 6月20日	7,260	-	0.0	-	99.0	
	6月末	7,267	0.1	0.0	-	99.2	
	(期 末) 2022年 7月20日	7,180	△ 1.1	0.0	-	99.2	
第144期	(期 首) 2022年 7月20日	7,160	-	0.0	-	99.2	
	7月末	7,393	3.3	0.0	-	99.3	
	(期 末) 2022年 8月22日	7,677	7.2	0.0	-	98.8	
第145期	(期 首) 2022年 8月22日	7,657	-	0.0	-	98.8	
	8月末	7,694	0.5	0.0	-	99.1	
	(期 末) 2022年 9月20日	7,530	△ 1.7	0.0	-	98.9	

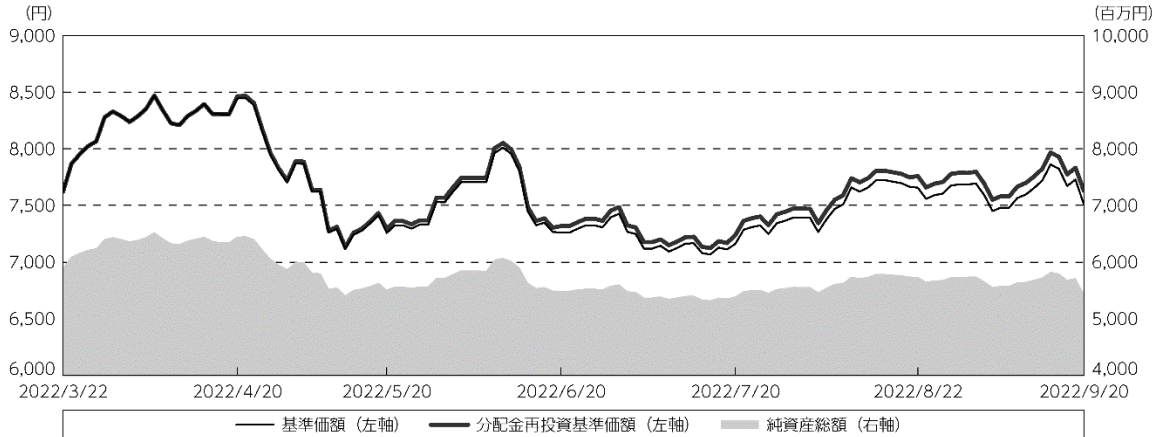
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第140期首：7,622円

第145期末：7,510円(既払分配金(税込み)：120円)

騰落率：0.1%(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(2022年3月22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

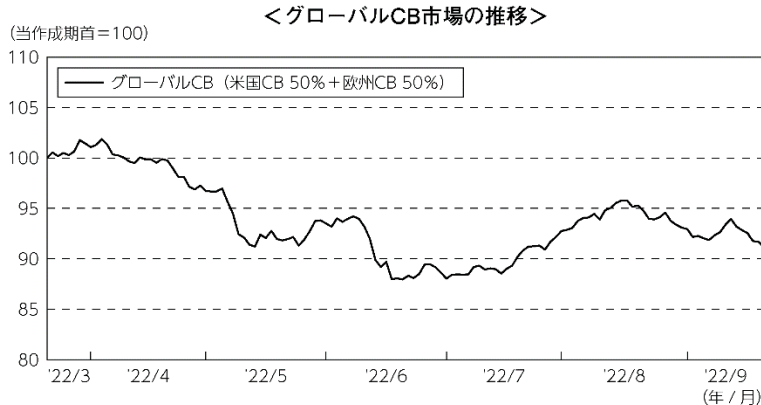
基準価額は、当作成期首7,622円から当作成期末には7,510円となりました。

- ・ 実質的に投資している日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債（グローバルCB）からのインカムゲイン（利子収入）
- ・ 実質的に投資している日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債（グローバルCB）からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 円／資源国通貨（ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット）の為替変動

## ○投資環境

### <グローバルCB市場>

グローバルCB市場の騰落は以下ようになりました。



(注) 各市場指数の騰落は、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。また、各市場指数は、米ドル建て指数を用いています。

グローバルCB：米国CBと欧州CBの市場指数を50：50で合成し日割りバランスしたと仮定し算出した指数、米国CB：トムソン・ロイター米国コンバーティブル・ボンド・インデックス、欧州CB：トムソン・ロイター欧州コンバーティブル・ボンド・インデックス（米ドルヘッジベース）

●©Thomson Reuters. All rights reserved. トムソン・ロイター・コンバーティブル・インデックス（Thomson Reuters Convertible Index）という名称、および関連するトムソン・ロイターのサブインデックスの名称（以下、総称して「トムソン・ロイター・インデックス」）は、ロイター・リミテッド（以下「トムソン・ロイター」という）の専有財産です。

トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスのベンチマークを使用し取得した結果や、特定の日にトムソン・ロイター・インデックスが示す数値や水準のいずれについても、明示または黙示を問わず、いかなる保証や表明も行ないません。また、トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスの算出方法の修正・変更につき保証を行わず、トムソン・ロイター・インデックスの算出、出版、配信を継続する義務を負わないものとします。

さらに、トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスや当該インデックスの計算・編集（当該インデックスに関連するまたは含まれる情報やデータを含みますが、それらに限りません）の正確性や完全性につき、明示または黙示を問わず、いかなる表明や保証も行ないません。

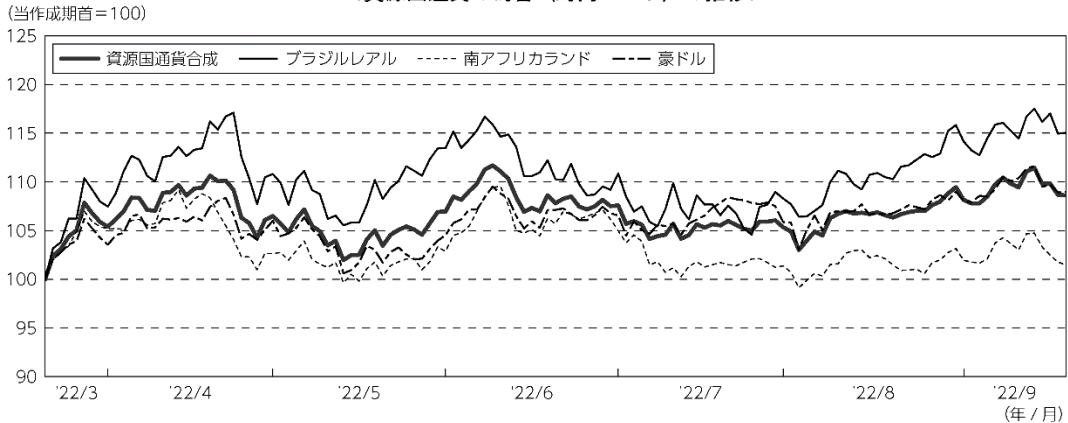
トムソン・ロイター・インデックスに係る規則および／またはガイドライン、トムソン・ロイター・インデックスおよび関連計算式の計算・編集のプロセスや基準、ベンチマークの構成やその他の関連要素は、通知を行なうことなく、トムソン・ロイターの裁量により、変更または改定される場合があります。

グローバルCB市場は、インフレ率上昇を背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）およびECB（欧州中央銀行）が積極的な利上げ姿勢を示したことを受けて当作成期を通じて値下がりとなりました。

## ＜為替レート＞

資源国通貨（ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨を等分投資し、日々リバランスを行なったと仮定したもの）の円に対する為替レートは以下のように推移いたしました。

＜資源国通貨の為替（対円レート）の推移＞



（注）為替レートは、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。  
また、為替市場の推移はBloombergのデータを用いて計算しています。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### 【野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）毎月分配型】

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス〕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〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス〕受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

### 【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス】

主要投資対象である〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンド〕のポートフォリオにおける信用格付け別比率については、当作成期末現在で、AAA格0.0%、AA格3.3%、A格8.5%、BBB格27.5%、BB格32.7%、B格15.5%、CCC格以下および無格付1.0%となりました。

\* 格付はS&P社あるいはムーディーズ社のいずれかの格付機関の低い方の格付によります。格付がない場合は副投資顧問会社が同等の信用度を有すると判断した格付によります。

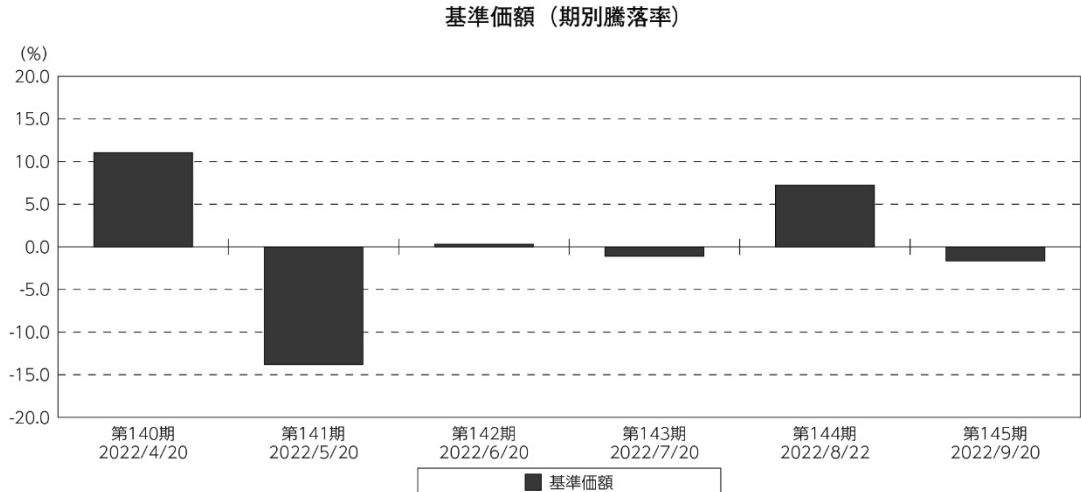
### 【野村マネー マザーファンド】

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、作成期間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

収益分配については、分配原資の範囲内で、原則として、利子・配当等収益等を中心に分配を行ないました。

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140期	第141期	第142期	第143期	第144期	第145期
	2022年3月23日～ 2022年4月20日	2022年4月21日～ 2022年5月20日	2022年5月21日～ 2022年6月20日	2022年6月21日～ 2022年7月20日	2022年7月21日～ 2022年8月22日	2022年8月23日～ 2022年9月20日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.236%	0.275%	0.275%	0.279%	0.261%	0.266%
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,979	3,995	4,012	4,029	4,051	4,069

(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

### 【野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）毎月分配型】

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス〕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〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス〕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。

### 【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・コンバーティブル・ボンドー資源国通貨クラス】

日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債を主要投資対象とします。米ドル建て以外の資産に投資を行なった場合は、各副投資顧問会社が当該資産について、原則として対米ドルで為替取引を行ないます。組入資産について、原則として、米ドルを売り、資源国通貨（ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット）を買う為替取引を行ないます。

転換社債への投資にあたっては、引き続き、高水準のインカムゲイン（利子収入）の確保とキャピタルゲイン（値上がり益）の獲得を目指し、ポートフォリオの地域別配分、格付別配分、業種別配分等に考慮したポートフォリオの構築を行なっていきます。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

### 【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。日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※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

(2022年3月23日～2022年9月20日)

項 目	第140期～第145期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 39	% 0.510	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(17)	(0.219)	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 ）	(21)	(0.274)	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 )	(0.016)	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	0	0.001	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 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	39	0.511	
作成期間の平均基準価額は、7,645円です。			

\* 作成期間の費用（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。

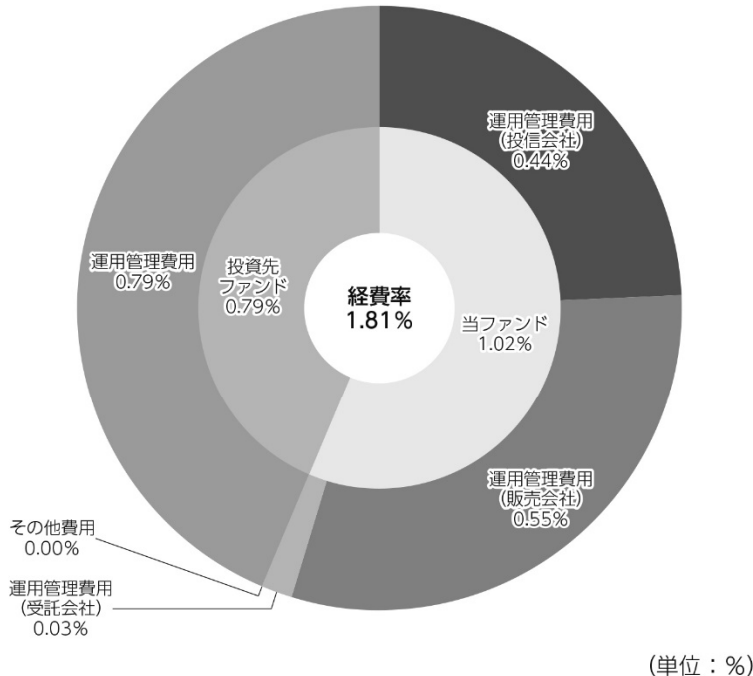
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## (参考情報)

## ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.81%です。



経費率(①+②)	1.81
①当ファンドの費用の比率	1.02
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.79

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2022年3月23日～2022年9月20日)

## 投資信託証券

銘柄		第140期～第145期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド-グローバル・コンパティブル・ボンド-資源国通貨クラス	口 —	千円 —	口 58,053	千円 314,926

\*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

(2022年3月23日～2022年9月20日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）毎月分配型&gt;

該当事項はございません。

&lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区分	第140期～第145期					
	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 6,159	百万円 30	% 0.5	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。

## ○組入資産の明細

(2022年9月20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	第139期末		第145期末	
	口数	口数	評価額	比率
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド-グローバル・コンパティブル・ボンド-資源国通貨クラス	口 1,097,745	口 1,039,692	千円 5,389,763	% 98.9
合計	1,097,745	1,039,692	5,389,763	98.9

\*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	第139期末	第145期末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 984	千口 984	千円 1,004

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年9月20日現在)

項 目	第145期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 5,389,763	% 96.5
野村マネー マザーファンド	1,004	0.0
コール・ローン等、その他	196,931	3.5
投資信託財産総額	5,587,698	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

項 目	第140期末	第141期末	第142期末	第143期末	第144期末	第145期末
	2022年4月20日現在	2022年5月20日現在	2022年6月20日現在	2022年7月20日現在	2022年8月22日現在	2022年9月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	6,504,415,338	5,539,449,684	5,510,587,298	5,417,532,168	5,756,680,738	5,587,698,968
コール・ローン等	76,332,847	68,541,781	76,171,231	71,446,747	71,007,715	71,370,321
投資信託受益証券(評価額)	6,386,605,092	5,469,903,768	5,433,411,932	5,345,081,286	5,663,567,298	5,389,763,328
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,004,135	1,004,135	1,004,135	1,004,135	1,004,135	1,004,135
未収入金	40,473,264	—	—	—	21,101,590	125,561,184
(B) 負債	53,958,674	28,317,952	21,730,685	28,900,849	22,073,516	140,070,456
未払収益分配金	15,277,401	15,186,234	15,120,005	15,051,430	14,978,745	14,506,945
未払解約金	33,527,387	8,160,818	1,636,722	9,268,150	1,887,296	120,931,574
未払信託報酬	5,142,809	4,960,219	4,963,255	4,571,423	5,196,293	4,621,912
未払利息	25	23	41	29	19	95
その他未払費用	11,052	10,658	10,662	9,817	11,163	9,930
(C) 純資産総額(A-B)	6,450,456,664	5,511,131,732	5,488,856,613	5,388,631,319	5,734,607,222	5,447,628,512
元本	7,638,700,778	7,593,117,186	7,560,002,954	7,525,715,158	7,489,372,989	7,253,472,567
次期繰越損益金	△1,188,244,114	△2,081,985,454	△2,071,146,341	△2,137,083,839	△1,754,765,767	△1,805,844,055
(D) 受益権総口数	7,638,700,778口	7,593,117,186口	7,560,002,954口	7,525,715,158口	7,489,372,989口	7,253,472,567口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,444円	7,258円	7,260円	7,160円	7,657円	7,510円

(注) 第140期首元本額は7,743,401,639円、第140～145期中追加設定元本額は18,864,880円、第140～145期中一部解約元本額は508,793,952円、1口当たり純資産額は、第140期0.8444円、第141期0.7258円、第142期0.7260円、第143期0.7160円、第144期0.7657円、第145期0.7510円です。

## ○損益の状況

項 目	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期	第145期
	2022年3月23日～ 2022年4月20日	2022年4月21日～ 2022年5月20日	2022年5月21日～ 2022年6月20日	2022年6月21日～ 2022年7月20日	2022年7月21日～ 2022年8月22日	2022年8月23日～ 2022年9月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	32,462,324	32,357,032	32,352,425	32,255,167	32,171,194	31,300,564
受取配当金	32,462,684	32,357,608	32,353,256	32,255,967	32,171,685	31,302,404
支払利息	△ 360	△ 576	△ 831	△ 800	△ 491	△ 1,840
(B) 有価証券売買損益	615,970,650	△ 913,137,825	△ 10,575,414	△ 88,031,019	359,926,318	△ 119,039,913
売買益	622,868,968	3,561,145	2,287,455	358,472	361,051,420	627,999
売買損	△ 6,898,318	△ 916,698,970	△ 12,862,869	△ 88,389,491	△ 1,125,102	△ 119,667,912
(C) 信託報酬等	△ 5,153,861	△ 4,970,877	△ 4,973,917	△ 4,581,240	△ 5,207,456	△ 4,631,842
(D) 当期損益金(A+B+C)	643,279,113	△ 885,751,670	16,803,094	△ 60,357,092	386,890,056	△ 92,371,191
(E) 前期繰越損益金	△1,849,411,038	△1,213,538,196	△2,104,257,202	△2,092,104,752	△2,155,967,104	△1,726,632,684
(F) 追加信託差損益金	33,165,212	32,490,646	31,427,772	30,429,435	29,290,026	27,666,765
(配当等相当額)	( 720,585,445)	( 717,185,470)	( 715,074,290)	( 712,774,703)	( 710,402,967)	( 688,939,459)
(売買損益相当額)	(△ 687,420,233)	(△ 684,694,824)	(△ 683,646,518)	(△ 682,345,268)	(△ 681,112,941)	(△ 661,272,694)
(G) 計(D+E+F)	△1,172,966,713	△2,066,799,220	△2,056,026,336	△2,122,032,409	△1,739,787,022	△1,791,337,110
(H) 収益分配金	△ 15,277,401	△ 15,186,234	△ 15,120,005	△ 15,051,430	△ 14,978,745	△ 14,506,945
繰越損益金(G+H)	△1,188,244,114	△2,081,985,454	△2,071,146,341	△2,137,083,839	△1,754,765,767	△1,805,844,055
追加信託差損益金	33,165,212	32,490,646	31,427,772	30,429,435	29,290,026	27,666,765
(配当等相当額)	( 720,585,445)	( 717,185,470)	( 715,074,290)	( 712,774,703)	( 710,402,967)	( 688,939,459)
(売買損益相当額)	(△ 687,420,233)	(△ 684,694,824)	(△ 683,646,518)	(△ 682,345,268)	(△ 681,112,941)	(△ 661,272,694)
分配準備積立金	2,319,464,247	2,317,031,574	2,318,240,897	2,319,483,504	2,324,057,938	2,262,632,249
繰越損益金	△3,540,873,573	△4,431,507,674	△4,420,815,010	△4,486,996,778	△4,108,113,731	△4,096,143,069

\* 損益の状況の中で(B) 有価証券売買損益は各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(2022年3月23日～2022年9月20日)は以下の通りです。

項 目	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期	第145期
	2022年3月23日～ 2022年4月20日	2022年4月21日～ 2022年5月20日	2022年5月21日～ 2022年6月20日	2022年6月21日～ 2022年7月20日	2022年7月21日～ 2022年8月22日	2022年8月23日～ 2022年9月20日
a. 配当等収益(経費控除後)	32,204,374円	27,386,474円	27,378,880円	27,674,273円	31,744,479円	26,669,061円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	720,585,445円	717,185,470円	715,074,290円	712,774,703円	710,402,967円	688,939,459円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,302,537,274円	2,304,831,334円	2,305,982,022円	2,306,860,661円	2,307,292,204円	2,250,470,133円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	3,055,327,093円	3,049,403,278円	3,048,435,192円	3,047,309,637円	3,049,439,650円	2,966,078,653円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	3,999円	4,015円	4,032円	4,049円	4,071円	4,089円
g. 分配金	15,277,401円	15,186,234円	15,120,005円	15,051,430円	14,978,745円	14,506,945円
h. 分配金(1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

## ○分配金のお知らせ

	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期	第145期
1万口当たり分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20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。

# Nomura Multi Managers Fund—Global Convertible Bond

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド グローバル・コンバーティブル・ボンド

2021年9月20日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託
投 資 目 的	<ul style="list-style-type: none"> <li>◆日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債(「グローバルCB」といいます)を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目的として運用を行ないます。</li> <li>◆「ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド—グローバル・コンバーティブル・ボンド」には、為替取引手法の異なる3つのクラス(日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)があります。</li> </ul>
投 資 態 度	<ul style="list-style-type: none"> <li>●投資対象資産を、転換先の株式およびREITの主要取引市場や発行通貨等から、各副投資顧問会社の判断により、「米国」、「欧州その他」に分類します。</li> <li>●「米国」および「欧州その他」に属する資産への投資比率は、各々50%を中心に40%～60%程度の範囲内とします。</li> <li>●銘柄選択にあたっては、最終利回り*が分類先の地域の市場平均を上回る転換社債を中心に選定します。 ※購入時点で、償還期日(売却権利が付与されている場合は権利行使日)まで当該転換社債を保有した場合の最終利回りをいいます。</li> <li>●米ドル建て以外の外貨建資産に投資を行なった場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行ないます。 ファンドには3つのクラス(日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、米ドルを売り、各クラスの通貨(日本円クラス:円、資源国通貨クラス:ブラジルレアル/豪ドル/南アフリカランド、アジア通貨クラス:中国元/インドルピー/インドネシアルピア)を買う為替取引を行なうことで、各通貨への投資効果を追求します。</li> <li>●運用の効率化を図るために株式先物や債券先物に投資する場合があります。</li> <li>●一時的な防衛的措置として、短期金融市場商品に投資する場合があります。</li> <li>●転換社債以外の債券および優先証券へ投資を行なう場合があります。</li> <li>●株式およびREITへの直接投資は行なわないことを基本とします。株式およびREITへの投資は優先証券のうち株券または新株引受権証券の性質を有するものまたは転換社債を転換および新株予約権を行使したもののならびに社債権者割当等により取得したものに限りします。</li> <li>●通常的环境下では、株式およびREITへの転換は行なわないことを基本とします。</li> <li>●投資顧問会社が、グローバルCBの運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。</li> <li>●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、グローバルCBの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。</li> <li>●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。</li> </ul>
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
管 理 事 務 代 行 会 社	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー
保 管 銀 行	

◇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しております。

◇掲載している組入資産の明細および計算書等は、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド—グローバル・コンバーティブル・ボンドの年次報告書から抜粋・邦訳したものです。

## 純資産計算書

2021年9月20日現在

(金額は米ドル表示)

資産		
投資有価証券時価		94,166,015
(取得原価: 81,603,260米ドル)		
現金預金等		9,400,215
外国為替先渡し契約に係る評価損益		521,233
発行未収金		18,555
ブローカーからの未収金		264,840
未収収益		184,768
		<hr/>
資産合計		104,555,626
		<hr/>
負債		
銀行当座借越		270,000
買戻未払金		285,169
ブローカーへの未払金		480,318
未払費用		245,287
未払利息		49
		<hr/>
負債合計		1,280,823
		<hr/>
純資産総額		103,274,803
		<hr/> <hr/>

受益証券一口当たり情報:

	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス (円)	10,941	112,680	1,232,854,996
アジア通貨クラス (円)	8,679	379,030	3,289,666,604
資源国通貨クラス (円)	5,636	1,212,298	6,832,554,813



## 運用計算書

2021年9月20日に終了する計測期間  
(金額は米ドル表示)

収益	
債券利息（源泉徴収税控除後）	991,745
受取配当金等（源泉徴収税控除後）	466,490
雑収益	293
収益合計	<u>1,458,528</u>
費用	
投資顧問報酬	695,495
事務管理代行報酬	82,744
保管費用	31,351
銀行口座に係る支払利息	2,357
取引銀行報酬	12,532
銀行手数料	34,680
受託報酬	20,703
法務報酬	970
立替費用	10,340
専門家報酬	28,509
印刷出版手数料	6,061
雑費用	197
費用合計	<u>925,939</u>
純投資損益	<u>532,589</u>
投資有価証券売買に係る損益	10,384,468
オプション契約に係る損益	(42,396)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	7,159,629
当期実現純損益	<u>17,501,701</u>
投資有価証券評価損益の増減	6,784,039
オプション契約に係る評価損益の増減	104,657
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	<u>(2,543,102)</u>
当期評価差損益	<u>4,345,594</u>
運用の結果による純資産の増減額	<u><u>22,379,884</u></u>

純資産変動計算書  
2021年9月20日に終了する計測期間  
(金額は米ドル表示)

期首純資産総額	97,859,068
純投資損益	532,589
当期実現純損益	17,501,701
当期評価差損益	4,345,594
運用の結果による純資産の増減額	22,379,884
受益証券の発行手取金	1,366,549
受益証券の買戻支払金	(11,040,929)
	(9,674,380)
受益者への支払分配金	(7,289,769)
期末純資産総額	103,274,803

発行済受益証券数の変動表  
2021年9月20日に終了する計測期間  
(未監査)

日本円クラス	
期首受益証券数	117,081
発行受益証券数	5,341
買戻受益証券数	(9,742)
期末発行済受益証券数	112,680
アジア通貨クラス	
期首受益証券数	387,520
発行受益証券数	7,469
買戻受益証券数	(15,959)
期末発行済受益証券数	379,030
資源国通貨クラス	
期首受益証券数	1,388,887
発行受益証券数	5,790
買戻受益証券数	(182,379)
期末発行済受益証券数	1,212,298

## 統計情報

2021年9月20日現在  
(未監査)

	2021	2020	2019
期末純資産総額 (米ドル)	103,274,803	97,859,068	111,927,752
日本円クラス (円)			
期末純資産総額	1,232,854,996	1,114,054,206	1,210,275,387
期末1口当たり純資産価格	10,941	9,515	9,460
アジア通貨クラス (円)			
期末純資産総額	3,289,666,604	2,765,403,691	3,012,436,006
期末1口当たり純資産価格	8,679	7,136	7,536
資源国通貨クラス (円)			
期末純資産総額	6,832,554,813	6,355,134,183	7,858,218,726
期末1口当たり純資産価格	5,636	4,576	5,192

組入資産明細  
2021年9月20日現在  
(金額は米ドル表示)

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
<b>オーストラリア</b>					
<b>転換社債</b>					
AUD	600,000	SEVEN GROUP HOL CV 2.2000% 05/03/25	477,056	463,737	0.45
AUD	300,000	DEXUS FINANCE CV 2.3000% 19/06/26	212,083	221,156	0.21
		合計： オーストラリア	689,139	684,893	0.66
			689,139	684,893	0.66
<b>オーストリア</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	400,000	AMS AG CV 2.1250% 03/11/27	515,212	460,686	0.45
EUR	300,000	IMMOFINANZ CV 1.5000% 24/01/24 IIAA	391,366	381,867	0.37
		合計： オーストリア	906,578	842,553	0.82
			906,578	842,553	0.82
<b>新株予約権</b>					
--	300,000	CA IMM ANLAGEN	0	0	0.00
		合計： オーストリア	0	0	0.00
			0	0	0.00
			906,578	842,553	0.82
			906,578	842,553	0.82
<b>ベルギー</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	400,000	SAGERPAR CV 0% 01/04/26	482,882	478,336	0.46
EUR	400,000	MITHRA PHARMA CV 4.2500% 17/12/25	517,488	471,371	0.46
EUR	200,000	FIELDLINK CV 3.75% 22/12/21 GREE	217,096	237,275	0.23
		合計： ベルギー	1,217,466	1,186,982	1.15
			1,217,466	1,186,982	1.15
<b>バミューダ諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	600,000	BW OFFSHORE LTD CV 2.5000% 12/11/24	531,400	525,210	0.51
USD	400,000	BORR DRILLING CV 3.8750% 23/05/23	402,033	160,000	0.15
USD	600,000	AFRICAN MINERALS CV 8.5% 10/02/17	610,068	6,000	0.01
		合計： バミューダ諸島	1,543,501	691,210	0.67
			1,543,501	691,210	0.67
<b>その他債券</b>					
HKD	2,000,000	REXLOT HLDG CV 4.5% 17/04/19	81,421	3,729	0.00
		合計： バミューダ諸島	81,421	3,729	0.00
			1,624,922	694,939	0.67
			1,624,922	694,939	0.67
<b>英領ヴァージン諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	600,000	MAIL RU GR CV 1.6250% 01/10/25 MAIL	594,000	567,366	0.54
USD	400,000	CP FOODS CAPITA CV 0.5000% 18/06/25	404,700	412,600	0.40
USD	200,000	PB ISSUER #5 LT CV 3.0000% 10/12/25	194,000	409,250	0.40
HKD	2,000,000	CHINA CONCH VEN CV 0% 05/09/23	278,382	285,879	0.28
USD	200,000	UNIVERSE TREK CV 2.5000% 08/07/25	214,807	243,000	0.24
USD	200,000	UNIVERSE TREK CV 0% 15/06/26	204,100	200,124	0.19
		合計： 英領ヴァージン諸島	1,889,989	2,118,219	2.05
			1,889,989	2,118,219	2.05

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
<b>カナダ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	1,069,000	SHOPIFY INC CV 0.1250% 01/11/25	1,237,903	1,371,997	1.33
			<u>1,237,903</u>	<u>1,371,997</u>	<u>1.33</u>
		合計： カナダ	<u>1,237,903</u>	<u>1,371,997</u>	<u>1.33</u>
<b>ケイマン諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	326,000	SEA LTD CV 1.0000% 01/12/24	706,770	2,201,371	2.14
USD	400,000	BOSIDENG INTERN CV 1.0000% 17/12/24	373,205	602,501	0.58
HKD	4,000,000	ZHOY HEI YA INT CV 1.0000% 05/11/25	514,475	516,479	0.50
USD	500,000	MEITUAN CV 0% 27/04/28	506,824	476,250	0.46
USD	500,000	HANSOH PHAR CV 0% 22/01/26	466,875	445,625	0.43
USD	400,000	GOLDENSEP INVES CV 1.0000% 28/09/21	389,000	394,500	0.38
USD	500,000	TEQU MAYFLOWER CV 0% 02/03/26	451,160	387,500	0.38
HKD	2,000,000	ZHONGSHENG CV 0% 21/05/25	258,047	376,461	0.36
USD	200,000	CN HONGQIAO LTD CV 5.2500% 25/01/26	200,080	336,250	0.33
HKD	2,000,000	KINGSOFT CORP CV 0.6250% 29/04/25	512,905	293,588	0.28
USD	200,000	CHINA OVRES FIN CV 0% 05/01/23	215,810	234,500	0.23
USD	200,000	POSEIDON FIN 1 CV 0% 01/02/25	200,393	221,346	0.21
USD	71,000	FARFETCH LTD CV 3.7500% 01/05/27	195,605	188,117	0.18
			<u>4,991,149</u>	<u>6,674,488</u>	<u>6.46</u>
		合計： ケイマン諸島	<u>4,991,149</u>	<u>6,674,488</u>	<u>6.46</u>
<b>中国</b>					
<b>転換社債</b>					
HKD	2,000,000	ANGANG STEEL CV 0% 25/05/23	258,357	277,219	0.27
			<u>258,357</u>	<u>277,219</u>	<u>0.27</u>
		合計： 中国	<u>258,357</u>	<u>277,219</u>	<u>0.27</u>
<b>キプロス</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	OZON HOLDING PL CV 1.8750% 24/02/26	400,000	381,508	0.37
			<u>400,000</u>	<u>381,508</u>	<u>0.37</u>
		合計： キプロス	<u>400,000</u>	<u>381,508</u>	<u>0.37</u>
<b>フランス</b>					
<b>転換社債</b>					
--	6,200	NEXITY CV 0.2500% 02/03/25	497,214	500,175	0.47
--	2,829	ORPEA CV 0.3750% 17/05/27	470,661	488,453	0.47
--	5,039	ENGIE CV 0% 02/06/24	500,402	480,359	0.47
--	5,000	FNAC DARTY SA CV 0.2500% 23/03/27	484,770	475,468	0.46
--	2,921	SAFRAN SA CV 0.8750% 15/05/27 SAF	503,056	459,685	0.45
EUR	28,000	ELEC DE FRANCE CV 0% 14/09/24 EDF	518,192	458,318	0.44
EUR	300,000	ORPAR CV 0% 20/06/24 RCO	378,053	422,871	0.41
USD	400,000	MICHELIN CV 0% 10/01/22 MLFP	420,440	418,724	0.41
USD	400,000	MICHELIN CV 0% 10/11/23 MLFP	363,724	407,004	0.39

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
USD	400,000	CARREFOUR SA CV 0% 27/03/24	409,187	401,976	0.39
EUR	400,000	BIGBEN INTERACT CV 1.1250% 19/02/26	479,904	398,664	0.39
--	7,846	NEOEN SAS CV 1.8750% 07/10/24 NEOE	387,082	373,071	0.36
--	5,500	MAISONS DU MOND CV 0.1250% 06/12/23	229,095	307,990	0.30
--	2,100	WORLDLINE SA CV 0% 30/07/25	316,758	295,594	0.29
			5,958,538	5,888,352	5.70
<b>変動金利債</b>					
EUR	9,028	KORIAN SA CV FRN 08/03/70	473,175	462,697	0.44
EUR	4,336	QUADIENT SAS CV FRN 16/12/69 NEO	262,860	294,491	0.29
			736,035	757,188	0.73
		合計： フランス	6,694,573	6,645,540	6.43
<b>ドイツ</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	400,000	DELIVERY HERO A CV 1.5000% 15/01/28	471,463	508,153	0.50
EUR	400,000	LEG IMMOBILIEN CV 0.4000% 30/06/28	476,649	503,025	0.49
EUR	400,000	DT LUFTHANS CV 2.0000% 17/11/25 LHA	513,774	488,587	0.47
EUR	400,000	MBT SYSTEMS CV 3.5000% 08/07/27	473,960	485,121	0.47
EUR	400,000	RAG STIFTUNG CV 0% 02/10/24 EVK	493,377	476,344	0.46
EUR	400,000	DELIVERY HERO CV 2.1250% 10/03/29 B	475,100	463,276	0.45
EUR	500,000	MORPHOSYS A CV 0.6250% 16/10/25 MOR	574,966	462,659	0.45
EUR	300,000	ZALANDO SE CV 0.6250% 06/08/27 B	389,722	447,187	0.43
EUR	200,000	CONSUS REAL CV 4.0000% 29/11/22 CCI	229,889	230,199	0.22
			4,098,900	4,064,551	3.94
		合計： ドイツ	4,098,900	4,064,551	3.94
<b>香港</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	500,000	XIAOMI BEST TIME CV 0% 17/12/27	560,250	519,375	0.50
			560,250	519,375	0.50
		合計： 香港	560,250	519,375	0.50
<b>インド</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	BHARTI AIR CV 1.5000% 17/02/25 REGS	431,350	569,500	0.55
			431,350	569,500	0.55
		合計： インド	431,350	569,500	0.55
<b>イタリア</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	400,000	DIASORIN CV 0% 05/05/28 DIA	483,041	545,496	0.53
EUR	400,000	SNAM SPA 0% 20/03/22	477,936	500,915	0.49
EUR	400,000	NEXI CV 0% 24/02/28 .	453,485	478,561	0.46
			1,414,462	1,524,972	1.48
		合計： イタリア	1,414,462	1,524,972	1.48
<b>ジャージー</b>					
<b>転換社債</b>					
GBP	300,000	PHP FIN JERS CV 2.8750% 15/07/25	403,664	489,295	0.48
GBP	400,000	CORNWALL JERSEY CV 0.7500% 16/04/26	553,502	488,826	0.47

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
GBP	300,000	DERWENT CAP 3 CV 1.5000% 12/06/25	382,712	426,022	0.41
USD	200,000	SIRIUS MINRLS CV 5.0000% 23/05/27 .	292,800	305,000	0.30
GBP	500,000	INTU JERSEY LTD CV 2.875% 01/11/22	627,934	155,154	0.15
USD	400,000	NMC HEALTH CV 1.8750% 30/04/25	389,373	93,000	0.09
			<u>2,649,985</u>	<u>1,957,297</u>	<u>1.90</u>
		合計： ジャージー	<u>2,649,985</u>	<u>1,957,297</u>	<u>1.90</u>
		<b>ルクセンブルグ</b>			
<b>転換社債</b>					
HKD	4,000,000	CITIGROUP GLOB L CV 0% 28/05/24 388	544,957	572,427	0.55
HKD	4,000,000	CITIGROUP GLOB L CV 0% 25/07/24 960	577,294	522,934	0.51
EUR	400,000	CITIGROUP G CV 0.5000% 04/08/23 TKA	505,739	517,138	0.50
EUR	400,000	GLOBAL FASHION CV 1.2500% 15/03/28	482,220	460,187	0.45
EUR	400,000	VIC PROPERTIES CV 3.0000% 28/05/25	373,083	452,064	0.44
EUR	300,000	LAGFIN CV 2.0000% 02/07/25	367,435	447,480	0.43
EUR	400,000	CORESTATE CV 1.3750% 28/11/22 CCAP	448,893	429,696	0.42
GBP	300,000	IWG GROUP CV 0.5000% 09/12/27	404,024	390,977	0.38
EUR	200,000	OLIVER CAPITAL CV 0% 29/12/23 G1A	247,121	266,092	0.26
EUR	200,000	KLOECKNER & CO CV 2% 08/09/23 KCO	225,992	250,281	0.24
EUR	200,000	EUROPEAN T CV 4.0000% 21/09/21 SMCP	218,395	200,660	0.19
			<u>4,395,153</u>	<u>4,509,936</u>	<u>4.37</u>
		合計： ルクセンブルグ	<u>4,395,153</u>	<u>4,509,936</u>	<u>4.37</u>
		<b>マレーシア</b>			
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	CERAH CAPITAL CV 0% 08/08/24	384,500	398,448	0.39
			<u>384,500</u>	<u>398,448</u>	<u>0.39</u>
		合計： マレーシア	<u>384,500</u>	<u>398,448</u>	<u>0.39</u>
		<b>マルタ</b>			
<b>転換社債</b>					
GBP	400,000	BRAIT PLC CV 6.5000% 04/12/24	463,644	465,105	0.45
			<u>463,644</u>	<u>465,105</u>	<u>0.45</u>
		合計： マルタ	<u>463,644</u>	<u>465,105</u>	<u>0.45</u>
		<b>モーリシャス</b>			
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	HTA GROUP LTD CV 2.8750% 18/03/27	400,000	447,380	0.43
			<u>400,000</u>	<u>447,380</u>	<u>0.43</u>
		合計： モーリシャス	<u>400,000</u>	<u>447,380</u>	<u>0.43</u>
		<b>オランダ</b>			
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	YANDEX NV CV 0.7500% 03/03/25	444,800	559,716	0.53
USD	400,000	QIAGEN NV CV 1.0000% 13/11/24	438,330	508,400	0.49
EUR	400,000	AMERICA MOVIL BV CV 0% 02/03/24	509,986	489,769	0.47
EUR	400,000	BASIC-FIT CV 1.5000% 17/06/28 BFIT	486,620	484,267	0.47
EUR	400,000	MONDELEZ INTL CV 0% 20/09/24 MDLZ	481,705	475,515	0.46
EUR	400,000	JUST EAT TAKEA CV 1.2500% 30/04/26	490,276	474,248	0.46
EUR	300,000	TAKEAWAY.COM N CV 2.2500% 25/01/24	536,108	439,152	0.43

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
USD	400,000	ELM BV FOR CV 3.2500% 13/06/24 SREN	416,963	430,420	0.42
EUR	300,000	PHARMING NV CV 3.0000% 21/01/25	324,200	294,775	0.29
EUR	200,000	SHOP APOTHEKE CV 0% 21/01/28 SAE	242,950	236,507	0.23
EUR	200,000	COSMO PHARMA NV CV 2.5000% 05/12/23	220,128	228,763	0.22
			4,592,066	4,621,532	4.47
<b>変動金利債</b>					
EUR	100,000	ENCAVIS FINANCE CV FRN 13/03/70	364,982	244,100	0.24
			364,982	244,100	0.24
		合計： オランダ	4,957,048	4,865,632	4.71
<b>ニュージーランド</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	XERO INVMNTS LTD CV 0% 02/12/25	405,200	411,748	0.40
			405,200	411,748	0.40
		合計： ニュージーランド	405,200	411,748	0.40
<b>韓国</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	400,000	POSCO CV 0% 01/09/26	475,661	495,336	0.48
			475,661	495,336	0.48
		合計： 韓国	475,661	495,336	0.48
<b>シンガポール</b>					
<b>転換社債</b>					
SGD	500,000	KEPPEL REIT CV 1.9000% 10/04/24	366,518	370,610	0.36
EUR	200,000	SGX TREASURY CV 0% 01/03/24	246,367	240,357	0.23
			612,885	610,967	0.59
		合計： シンガポール	612,885	610,967	0.59
<b>スペイン</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	300,000	CELLNEX TE CV 1.5000% 16/01/26 CLNX	570,662	698,393	0.68
EUR	400,000	SACYR SA CV 3.7500% 25/04/24	440,965	496,814	0.48
EUR	400,000	CO ECONOMI CV 1.0000% 01/12/23 EBRO	485,130	467,981	0.45
EUR	300,000	AMADEUS IT GROU CV 1.5000% 09/04/25	487,991	451,082	0.44
EUR	300,000	ENCE ENRGA CV 1.2500% 05/03/23 ENC	324,102	342,506	0.33
			2,308,850	2,456,776	2.38
		合計： スペイン	2,308,850	2,456,776	2.38
<b>スウェーデン</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	300,000	GEELY SWEDEN FIN CV 0% 19/06/24	465,521	440,889	0.43
			465,521	440,889	0.43
		合計： スウェーデン	465,521	440,889	0.43
<b>スイス</b>					
<b>転換社債</b>					
CHF	600,000	IDORSIA LTD CV 2.1250% 04/08/28	655,881	650,334	0.63
CHF	260,000	SIKA AG CV 0.1500% 05/06/25	346,345	477,698	0.46
CHF	400,000	SWISS PRIM CV 0.3250% 16/01/25 SPSN	427,607	436,420	0.42



ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
CHF	400,000	CEMBRA MONEY BAN CV 0% 09/07/26	460,658	423,938	0.41
CHF	290,000	IMPLENIA AG CV 0.5% 30/06/22 IMPN	301,319	310,329	0.30
CHF	168,750	SANTHERA PHA CV 7.5000% 17/08/24	236,650	182,029	0.18
			2,428,460	2,480,748	2.40
		合計： スイス	2,428,460	2,480,748	2.40
<b>アラブ首長国連邦</b>					
転換社債					
USD	800,000	ABU DHABI NAT CV 0.7000% 04/06/24	800,000	798,400	0.77
			800,000	798,400	0.77
		合計： アラブ首長国連邦	800,000	798,400	0.77
<b>イギリス</b>					
転換社債					
GBP	400,000	JET2 PLC CV 1.6250% 10/06/26	560,345	555,253	0.53
GBP	400,000	TRAINLINE PLC CV 1.0000% 14/01/26	526,856	501,106	0.49
GBP	200,000	CAPITAL & COUNT CV 2.0000% 30/03/26	264,643	289,387	0.28
GBP	221,000	STOBART FIN CV 2.7500% 08/05/24	288,151	237,717	0.23
			1,639,995	1,583,463	1.53
		合計： イギリス	1,639,995	1,583,463	1.53
<b>アメリカ</b>					
転換社債					
USD	833,000	MICROCHIP TECH CV 1.6250% 15/02/27	853,854	1,991,829	1.94
USD	1,210,000	BURLINGTON STOR CV 2.2500% 15/04/25	1,522,947	1,832,280	1.77
USD	736,000	ON SEMICON CV 1.6250% 15/10/23 144A	815,886	1,734,664	1.68
USD	399,000	MERCADOLIBRE IN CV 2.0000% 15/08/28	949,024	1,702,102	1.65
USD	620,000	MONGODB INC CV 0.2500% 15/01/26	766,373	1,514,548	1.47
USD	1,003,000	SOUTHWEST AIR CV 1.2500% 01/05/25	1,333,239	1,450,198	1.40
USD	593,000	LIBERTY INTER CV 1.75% 30/09/46 144	665,426	1,330,247	1.29
USD	1,303,000	RINGCENTRAL INC CV 0% 01/03/25	1,392,187	1,320,630	1.28
USD	374,000	SNAP INC CV 0.7500% 01/08/26	375,908	1,219,767	1.18
USD	805,000	OKTA INC CV 0.1250% 01/09/25	907,668	1,200,577	1.16
USD	813,000	BOOKING HLDS IN CV 0.7500% 01/05/25	1,109,724	1,192,289	1.15
USD	806,000	LIVE NATION ENT CV 2.5000% 15/03/23	828,097	1,122,516	1.09
USD	303,000	CLOUDFLARE CV 0.7500% 15/05/25	366,552	1,068,381	1.03
USD	747,000	INSULET CORP CV 0.3750% 01/09/26	795,692	1,052,911	1.02
USD	852,000	DEXCOM INC CV 0.2500% 15/11/25	899,924	1,014,596	0.98
USD	805,000	SQUARE INC CV 0.2500% 01/11/27	948,825	971,965	0.94
USD	592,000	COUPA SOFTWARE CV 0.1250% 15/06/25	745,837	968,719	0.94
USD	428,000	ZILLOW GRP CV 1.3750% 01/09/26	743,105	949,154	0.92
USD	506,000	WORKDAY INC CV 0.2500% 01/10/22	557,665	926,430	0.90
USD	577,000	CHEGG INC CV 0.1250% 15/03/25	846,854	921,140	0.89
USD	530,000	DATADOG INC CV 0.1250% 15/06/25	673,204	887,671	0.86
USD	247,000	SQUARE INC CV 0.5000% 15/05/23	267,694	810,301	0.78
USD	418,000	ZSCALER INC CV 0.1250% 01/07/25	468,160	787,324	0.76
USD	549,000	FIVE9 INC CV 0.5000% 01/06/25	779,108	786,810	0.76
USD	698,000	EXACT SCIENCES CV 0.3750% 01/03/28	784,326	776,560	0.75
USD	660,000	GUARDANT HEALTH CV 0% 15/11/27	720,131	774,556	0.75
USD	288,000	REPLIGEN CORP CV 0.3750% 15/07/24	533,370	768,623	0.74
USD	643,000	TELADOC HEALTH CV 1.2500% 01/06/27	815,866	670,373	0.65

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

通貨	数量/ 額面価格 <sup>(1)</sup>	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率 (%)
USD	123,000	SERVICENOW INC CV 0% 01/06/22	441,555	594,796	0.58
USD	529,000	DROPBOX CV 0% 01/03/26	539,159	566,723	0.55
USD	280,000	IAC FINANCECO 3 CV 2.0000% 15/01/30	336,957	558,471	0.54
USD	144,000	DOCUSIGN INC CV 0.5000% 15/09/23	273,976	555,765	0.54
USD	396,000	UPSTART HLDS CV 0.2500% 15/08/26	500,030	523,108	0.51
EUR	300,000	JP MORGAN CHASE CV 0% 18/09/22	463,966	520,109	0.50
USD	475,000	JP MORGAN CHASE CV 0.1250% 01/01/23	579,559	491,198	0.48
USD	437,000	CLOUDFLARE CV 0% 15/08/26	441,407	446,076	0.43
USD	386,000	LIVE NATION ENT CV 2.0000% 15/02/25	326,350	434,408	0.42
USD	271,000	EXACT SCIENCES CV 1.0000% 15/01/25	441,181	410,741	0.40
USD	196,000	TWITTER INC CV 0.2500% 15/06/24	251,566	252,607	0.24
USD	73,000	DEXCOM INC CV 0.7500% 01/12/23	236,155	248,230	0.24
USD	200,000	GLENCORE FDG LL CV 0% 27/03/25 GLEN	179,039	195,534	0.19
USD	168,000	ZYNGA INC CV 0.2500% 01/06/24	229,740	193,091	0.19
			27,707,286	37,738,018	36.54
<b>優先証券</b>					
--	1,308	BROADCOM IN CV PFD 8.0000% 30/09/22	1,388,290	2,067,058	2.01
--	819	DANAHER COR CV PFD 4.7500% 15/04/22	1,142,739	1,776,264	1.72
--	9,888	AVANTOR INC CV PFD 6.2500% 15/05/22	998,162	1,305,908	1.26
--	8,331	STANLEY BLA CV PFD 5.2500% 15/11/22	935,914	931,989	0.90
--	10,194	KKR & CO IN CV PFD 6.0000% 15/09/23	628,929	867,917	0.84
			5,094,034	6,949,136	6.73
		合計： アメリカ	32,801,320	44,687,154	43.27
		<b>組入資産合計</b>	<b>81,603,260</b>	<b>94,166,015</b>	<b>91.18</b>

<sup>(1)</sup> 額面価格は発行通貨建て表示

財務書類に関する注記  
2021年9月20日現在

## 注記1 - 外国為替先渡し契約

2021年9月20日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
BRL	34,239,015	USD	6,391,000	2021年10月4日	105,036
BRL	23,440,217	USD	4,359,000	2021年10月4日	88,222
BRL	17,600,219	USD	3,270,000	2021年10月4日	69,222
USD	3,310	JPY	364,020	2021年9月30日	0
USD	12,045	JPY	1,324,335	2021年9月30日	(1)
ZAR	13,925,619	USD	967,426	2021年9月30日	(14,033)
ZAR	76,351,146	USD	5,026,500	2021年9月30日	200,750
AUD	20,568,945	USD	14,879,379	2021年9月30日	171,792
JPY	680,634,611	USD	6,180,241	2021年10月15日	11,594
USD	80,072	BRL	414,863	2021年10月4日	1,362
USD	52,727	ZAR	755,725	2021年9月30日	988
USD	47,796	ZAR	685,605	2021年10月15日	960
USD	47,796	ZAR	684,124	2021年9月30日	959
USD	52,727	AUD	71,164	2021年9月30日	653
USD	105,454	BRL	552,464	2021年10月4日	637
USD	95,592	BRL	501,951	2021年10月4日	359
USD	40,036	ZAR	581,230	2021年9月30日	243
USD	8,924	ZAR	128,516	2021年10月15日	145
USD	8,924	ZAR	128,249	2021年9月30日	144
USD	17,848	BRL	93,507	2021年10月4日	108
USD	40,036	AUD	54,603	2021年9月30日	80
USD	47,796	AUD	65,216	2021年10月15日	71
USD	47,796	AUD	65,222	2021年9月30日	70
USD	8,924	AUD	12,116	2021年10月15日	58
USD	8,924	AUD	12,117	2021年9月30日	58
USD	2,718	ZAR	38,959	2021年9月30日	51
USD	2,061	BRL	10,685	2021年10月4日	34
USD	2,718	AUD	3,668	2021年9月30日	34
USD	5,436	BRL	28,481	2021年10月4日	33
USD	1,030	AUD	1,387	2021年9月30日	16
USD	1,030	ZAR	14,890	2021年9月30日	11
JPY	670,000	USD	6,129	2021年9月30日	(35)
JPY	670,000	USD	6,130	2021年10月15日	(35)
JPY	438,596,602	USD	3,998,082	2021年9月30日	(8,603)

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・コンバーティブル・ボンド

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
BRL	36,275,020	USD	6,895,683	2021年10月4日	(13,364)
AUD	7,110,159	USD	5,232,904	2021年10月15日	(29,740)
ZAR	212,994,980	USD	14,789,120	2021年10月15日	(238,728)
USD	23,306,733	EUR	19,700,000	2021年10月15日	101,761
USD	2,525,968	CHF	2,300,000	2021年11月18日	39,650
IDR	136,407,140,037	USD	9,515,670	2021年10月25日	35,304
INR	694,988,346	USD	9,399,291	2021年10月25日	16,188
CNY	61,977,113	USD	9,519,562	2021年12月17日	15,102
USD	165,167	EUR	140,000	2021年9月24日	329
USD	270,808	EUR	230,000	2021年10月15日	(112)
USD	368,680	SGD	500,000	2021年11月18日	(2,803)
USD	3,402,473	HKD	26,500,000	2021年11月18日	(2,866)
USD	716,012	AUD	990,000	2021年11月18日	(8,568)
USD	4,019,440	GBP	2,930,000	2021年11月18日	(21,903)
					<b>521,233</b>

金額は四捨五入されている。1未満の価額はゼロとして開示されている。

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年8月19日）

作成対象期間（2021年8月20日～2022年8月19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	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	中率			
	円		%	%	%	百万円
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
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

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

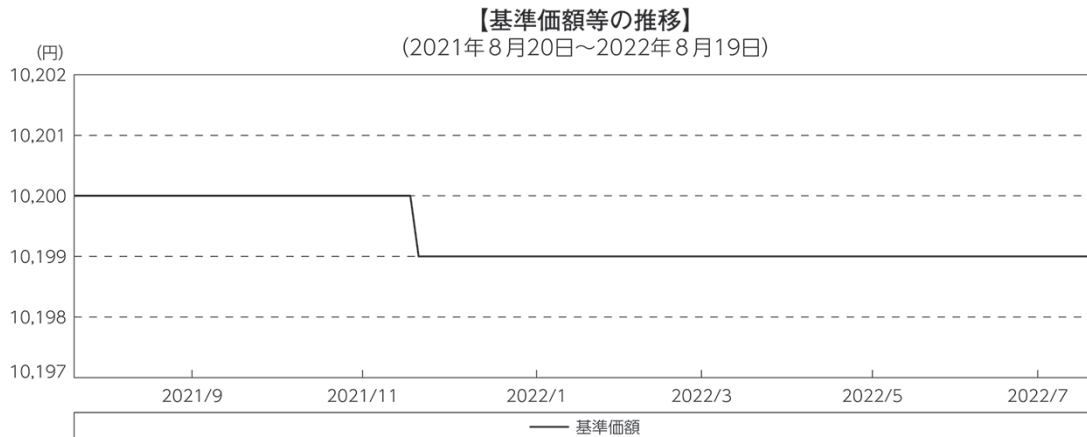
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2021年8月19日	円 10,200		% —	% 60.1	% —
8月末	10,200		0.0	56.8	—
9月末	10,200		0.0	55.1	—
10月末	10,200		0.0	51.6	—
11月末	10,200		0.0	54.5	—
12月末	10,199		△0.0	52.1	—
2022年1月末	10,199		△0.0	57.1	—
2月末	10,199		△0.0	57.5	—
3月末	10,199		△0.0	59.5	—
4月末	10,199		△0.0	60.1	—
5月末	10,199		△0.0	62.0	—
6月末	10,199		△0.0	55.6	—
7月末	10,199		△0.0	53.7	—
(期末) 2022年8月19日	10,199		△0.0	57.5	—

\*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

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

### ○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症による厳しい状況が緩和される中で、消費や雇用環境などには持ち直しの動きが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年12月には、2022年3月末が期限となっていた「新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム」について中小企業向けに部分的な延長を決定しました。

TDB(国庫短期証券)3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね-0.1%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は0~-0.05%程度で推移しました。

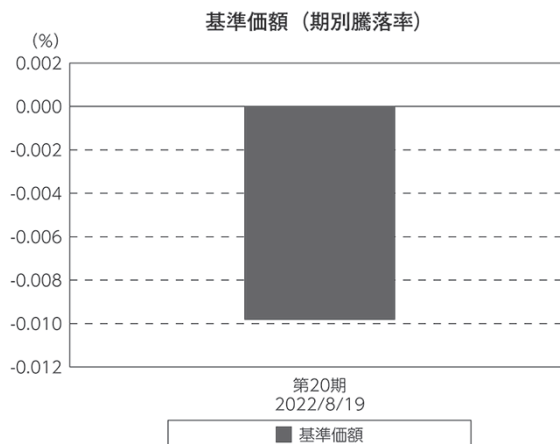
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

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

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



## ○1万口当たりの費用明細

(2021年8月20日～2022年8月19日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2021年8月20日～2022年8月19日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 4,055,682	千円 — (4,600,000)
	特殊債券	7,031,417	— (6,457,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	2,136,048	— (3,130,000)

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

\*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

(2021年8月20日～2022年8月19日)

## 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
公社債	百万円 13,223	百万円 30	% 0.2	百万円 —	百万円 —	% —

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証券株式会社です。

(2022年8月19日現在)

## ○組入資産の明細

## 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	750,000 ( 750,000)	750,520 ( 750,520)	9.6 ( 9.6)	— (—)	— (—)	— (—)	9.6 ( 9.6)
特殊債券 (除く金融債)	2,430,000 (2,430,000)	2,431,889 (2,431,889)	31.0 (31.0)	— (—)	— (—)	— (—)	31.0 (31.0)
金融債券	530,000 ( 530,000)	530,049 ( 530,049)	6.8 ( 6.8)	— (—)	— (—)	— (—)	6.8 ( 6.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	800,000 ( 800,000)	800,923 ( 800,923)	10.2 (10.2)	— (—)	— (—)	— (—)	10.2 (10.2)
合 計	4,510,000 (4,510,000)	4,513,382 (4,513,382)	57.5 (57.5)	— (—)	— (—)	— (—)	57.5 (57.5)

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末	
		額 面 金 額	評 価 額
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円
東京都 公募第711回	0.82	300,000	300,218
福岡県 公募平成24年度第4回	0.84	50,000	50,007
千葉県 公募平成24年度第5回	0.82	100,000	100,074
共同発行市場地方債 公募第114回	0.82	300,000	300,220
小 計		750,000	750,520
<b>特殊債券(除く金融債)</b>			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第96回	0.796	300,000	300,221
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	2.28	150,000	150,305
地方公共団体金融機構債券 第40回	0.825	110,000	110,101
地方公共団体金融機構債券 第41回	0.801	100,000	100,146
地方公共団体金融機構債券 第42回	0.801	40,000	40,086
日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債	0.825	300,000	300,456
都市再生債券 財投機関債第68回	0.854	200,000	200,159
都市再生債券 財投機関債第71回	0.767	200,000	200,131
日本学生支援債券 財投機関債第60回	0.001	300,000	300,000
日本学生支援債券 財投機関債第61回	0.001	100,000	100,000
国際協力機構債券 第14回財投機関債	0.825	300,000	300,221
東日本高速道路 第48回	0.09	100,000	100,032
西日本高速道路 第37回	0.09	130,000	130,016
西日本高速道路 第38回	0.09	100,000	100,010
小 計		2,430,000	2,431,889
<b>金融債券</b>			
商工債券 利付第811回い号	0.17	30,000	30,018
しんきん中金債券 利付第333回	0.09	200,000	200,011
商工債券 利付(3年)第236回	0.02	300,000	300,019
小 計		530,000	530,049
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>			
伊藤忠商事 第67回社債間限定同順位特約付	0.964	100,000	100,052
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	100,408
三井不動産 第46回社債間限定同順位特約付	0.964	200,000	200,063
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	300,000	300,205
電源開発 第35回社債間限定同順位特約付	1.126	100,000	100,193
小 計		800,000	800,923
合 計		4,510,000	4,513,382

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,513,382	57.5
コール・ローン等、その他	3,340,370	42.5
投資信託財産総額	7,853,752	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月19日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	7,853,752,692
コール・ローン等	3,326,621,034
公社債(評価額)	4,513,382,357
未収利息	7,215,305
前払費用	6,533,996
(B) 負債	3,470,854
未払解約金	3,470,000
未払利息	854
(C) 純資産総額(A-B)	7,850,281,838
元本	7,697,164,972
次期繰越損益金	153,116,866
(D) 受益権総口数	7,697,164,972口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,199円

(注) 期首元本額は8,979,256,768円、期中追加設定元本額は3,202,453,404円、期中一部解約元本額は4,484,545,200円、1口当たり純資産額は1.0199円です。

## ○損益の状況 (2021年8月20日～2022年8月19日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	23,315,784
受取利息	23,990,043
支払利息	△ 674,259
(B) 有価証券売買損益	△ 24,456,523
売買損	△ 24,456,523
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,140,739
(D) 前期繰越損益金	179,893,174
(E) 追加信託差損益金	63,852,596
(F) 解約差損益金	△ 89,488,165
(G) 計(C+D+E+F)	153,116,866
次期繰越損益金(G)	153,116,866

\*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)	1,997,050,289
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)	1,941,761,887
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)	1,503,668,510
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
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	441,709,194
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家販売制限付)	188,174,367
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	128,372,175
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
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
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
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

ファンド名	当期末 元本額
	円
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(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
野村テンプレートン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンプレートン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプレートン・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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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(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
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CD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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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
グローバル・ストック D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(米ドルコース)毎月分配型	398,357
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	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
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
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(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(通貨セレクトコース)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
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
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・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(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054
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
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(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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。