

# 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152期(決算日2023年4月20日) 第153期(決算日2023年5月22日) 第154期(決算日2023年6月20日)  
第155期(決算日2023年7月20日) 第156期(決算日2023年8月21日) 第157期(決算日2023年9月20日)

作成対象期間(2023年3月21日～2023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	み 期 騰 落 率							
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	百万円
128期(2021年4月20日)	7,620	20	2.8	0.0	—	99.0	6,631			
129期(2021年5月20日)	7,560	20	△ 0.5	0.0	—	99.3	6,513			
130期(2021年6月21日)	7,980	20	5.8	0.0	—	99.3	6,788			
131期(2021年7月20日)	7,668	20	△ 3.7	0.0	—	98.9	6,471			
132期(2021年8月20日)	7,559	20	△ 1.2	0.0	—	99.0	6,333			
133期(2021年9月21日)	7,954	20	5.5	0.0	—	99.0	6,560			
134期(2021年10月20日)	8,130	20	2.5	0.0	—	99.3	6,604			
135期(2021年11月22日)	7,933	20	△ 2.2	0.0	—	99.1	6,318			
136期(2021年12月20日)	7,345	20	△ 7.2	0.0	—	99.1	5,792			
137期(2022年1月20日)	7,330	20	0.1	0.0	—	99.0	5,748			
138期(2022年2月21日)	7,438	20	1.7	0.0	—	99.3	5,765			
139期(2022年3月22日)	7,622	20	2.7	0.0	—	99.2	5,902			
140期(2022年4月20日)	8,444	20	11.0	0.0	—	99.0	6,450			
141期(2022年5月20日)	7,258	20	△ 13.8	0.0	—	99.3	5,511			
142期(2022年6月20日)	7,260	20	0.3	0.0	—	99.0	5,488			
143期(2022年7月20日)	7,160	20	△ 1.1	0.0	—	99.2	5,388			
144期(2022年8月22日)	7,657	20	7.2	0.0	—	98.8	5,734			
145期(2022年9月20日)	7,510	20	△ 1.7	0.0	—	98.9	5,447			
146期(2022年10月20日)	7,281	20	△ 2.8	0.0	—	99.3	5,249			
147期(2022年11月21日)	7,252	20	△ 0.1	0.0	—	99.1	5,167			
148期(2022年12月20日)	7,016	20	△ 3.0	0.0	—	99.3	4,936			
149期(2023年1月20日)	6,923	20	△ 1.0	0.0	—	98.8	4,845			
150期(2023年2月20日)	7,254	20	5.1	0.0	—	99.2	5,019			
151期(2023年3月20日)	6,951	20	△ 3.9	0.0	—	99.0	4,770			
152期(2023年4月20日)	7,283	20	5.1	0.0	—	98.9	4,970			
153期(2023年5月22日)	7,293	20	0.4	0.0	—	98.6	4,944			
154期(2023年6月20日)	7,856	20	8.0	0.0	—	99.1	5,268			
155期(2023年7月20日)	7,858	20	0.3	0.0	—	99.3	5,221			
156期(2023年8月21日)	7,560	20	△ 3.5	0.0	—	98.9	4,993			
157期(2023年9月20日)	7,789	20	3.3	0.0	—	98.8	5,109			

\* 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	率			
第152期	(期 首) 2023年 3月20日	円 6,951	% -	% 0.0	% -	% 99.0	
	3月末	7,074	1.8	0.0	-	99.1	
	(期 末) 2023年 4月20日	7,303	5.1	0.0	-	98.9	
第153期	(期 首) 2023年 4月20日	7,283	-	0.0	-	98.9	
	4月末	7,105	△2.4	0.0	-	99.2	
	(期 末) 2023年 5月22日	7,313	0.4	0.0	-	98.6	
第154期	(期 首) 2023年 5月22日	7,293	-	0.0	-	98.6	
	5月末	7,241	△0.7	0.0	-	98.8	
	(期 末) 2023年 6月20日	7,876	8.0	0.0	-	99.1	
第155期	(期 首) 2023年 6月20日	7,856	-	0.0	-	99.1	
	6月末	7,848	△0.1	0.0	-	99.2	
	(期 末) 2023年 7月20日	7,878	0.3	0.0	-	99.3	
第156期	(期 首) 2023年 7月20日	7,858	-	0.0	-	99.3	
	7月末	7,854	△0.1	0.0	-	99.2	
	(期 末) 2023年 8月21日	7,580	△3.5	0.0	-	98.9	
第157期	(期 首) 2023年 8月21日	7,560	-	0.0	-	98.9	
	8月末	7,858	3.9	0.0	-	99.0	
	(期 末) 2023年 9月20日	7,809	3.3	0.0	-	98.8	

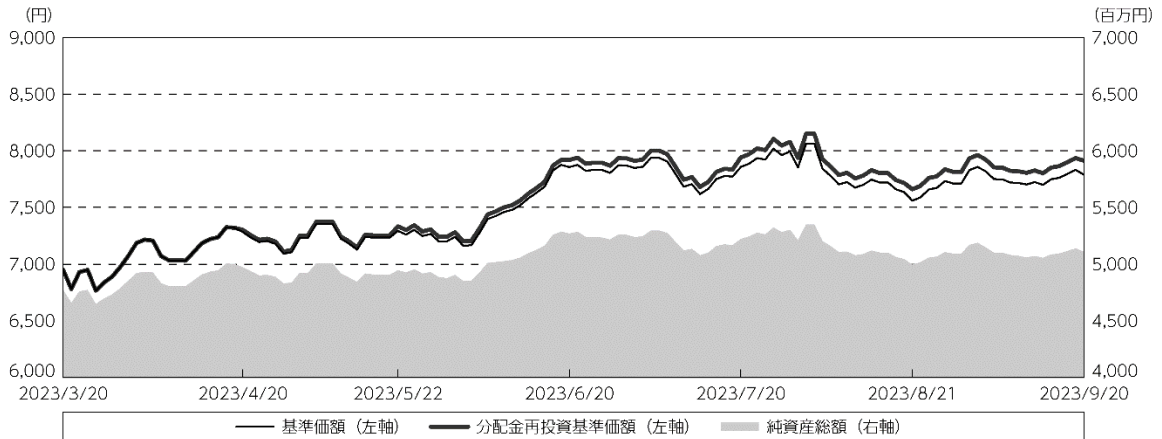
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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152期首：6,951円

第157期末：7,789円(既払分配金(税込み)：120円)

騰落率：13.8%(分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2023年3月20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

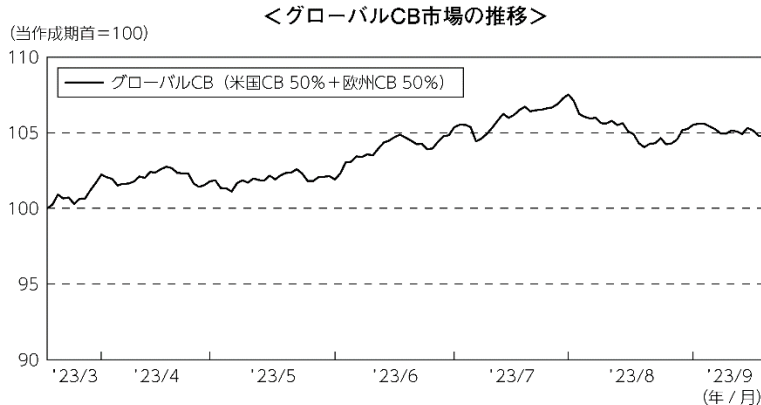
基準価額は、当作成期首6,951円から当作成期末には7,789円となりました。

- ・ 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市場の騰落は以下のようになりました。



(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。

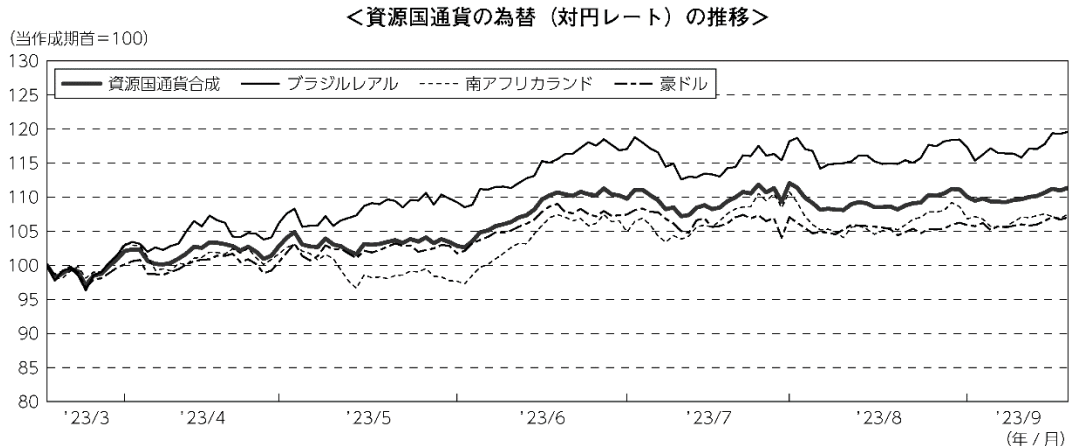
さらに、トムソン・ロイターは、トムソン・ロイター・インデックスや当該インデックスの計算・編集（当該インデックスに関連するまたは含まれる情報やデータを含みますが、それらに限りません）の正確性や完全性につき、明示または黙示を問わず、いかなる表明や保証も行いません。

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、米欧でのインフレ率の鈍化を背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）およびECB（欧州中央銀行）が利上げを一時停止するとの期待が高まり、当作成期を通じて値上がりとなりました。

## <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。



（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6.6%、A格10.1%、BBB格32.7%、BB格26.8%、B格10.7%、CCC格以下および無格付1.7%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。

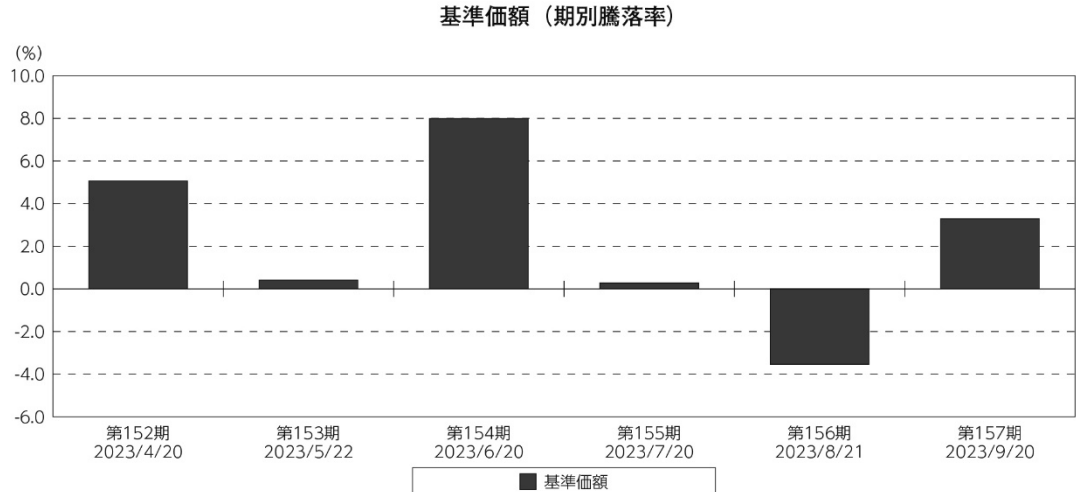
### [野村マネー マザーファンド]

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152期	第153期	第154期	第155期	第156期	第157期
	2023年3月21日～ 2023年4月20日	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.274%	20 0.273%	20 0.254%	20 0.254%	20 0.264%	20 0.256%
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	4,202	4,219	4,243	4,261	4,278	4,301

(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

(2023年3月21日～2023年9月20日)

項 目	第152期～第157期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 39	% 0.514	(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)	(0.221)	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)	(0.276)	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 )	(0.017)	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	0.515	
作成期間の平均基準価額は、7,496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。

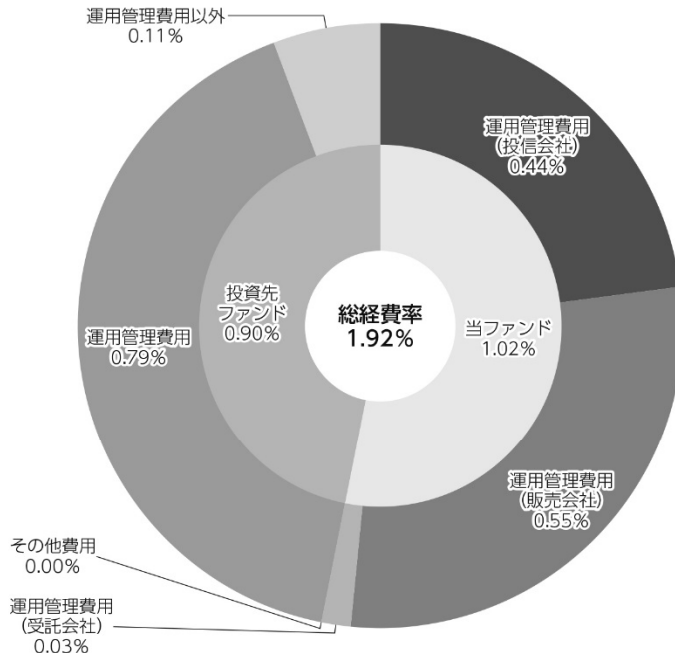
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

\* 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）

### ○総経費率

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総経費率（年率）は1.92%です。



(単位：%)

総経費率(①+②+③)	1.92
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
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11

(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、売買委託手数料およ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、当ファンドが組み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3月21日～2023年9月20日)

## 投資信託証券

銘柄		第152期～第157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・コンバーティブル・ボンド-資源国通貨クラス	口 —	千円 —	口 33,558	千円 171,358

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年3月21日～2023年9月20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151期末	第157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・コンバーティブル・ボンド-資源国通貨クラス	口 999,624	口 966,066	千円 5,048,660	% 98.8
	合計	999,624	966,066	5,048,660	98.8

\*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151期末	第157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 1,003

\*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9月20日現在)

項 目	第157期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,048,660	98.5
野村マネー マザーファンド	1,003	0.0
コール・ローン等、その他	77,926	1.5
投資信託財産総額	5,127,589	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152期末	第153期末	第154期末	第155期末	第156期末	第157期末
	2023年4月20日現在	2023年5月22日現在	2023年6月20日現在	2023年7月20日現在	2023年8月21日現在	2023年9月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,993,599,698	4,971,155,147	5,294,486,056	5,246,736,160	5,012,985,215	5,127,589,186
コール・ローン等	76,315,583	92,657,617	49,603,639	59,576,656	75,590,839	77,924,529
投資信託受益証券(評価額)	4,916,280,177	4,877,493,592	5,220,994,758	5,186,155,664	4,936,390,536	5,048,660,916
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,938	1,003,938	1,003,938	1,003,840	1,003,840	1,003,741
未収入金	—	—	22,883,721	—	—	—
(B) 負債	22,851,492	26,592,624	26,045,717	25,465,518	19,756,747	18,142,939
未払収益分配金	13,649,604	13,559,171	13,412,347	13,289,304	13,209,333	13,119,136
未払解約金	4,993,516	8,620,207	8,555,752	7,786,685	1,892,604	731,132
未払信託報酬	4,199,327	4,403,691	4,068,793	4,380,035	4,644,725	4,283,332
未払利息	25	96	86	85	109	138
その他未払費用	9,020	9,459	8,739	9,409	9,976	9,201
(C) 純資産総額(A-B)	4,970,748,206	4,944,562,523	5,268,440,339	5,221,270,642	4,993,228,468	5,109,446,247
元本	6,824,802,008	6,779,585,996	6,706,173,828	6,644,652,349	6,604,666,807	6,559,568,338
次期繰越損益金	△1,854,053,802	△1,835,023,473	△1,437,733,489	△1,423,381,707	△1,611,438,339	△1,450,122,091
(D) 受益権総口数	6,824,802,008口	6,779,585,996口	6,706,173,828口	6,644,652,349口	6,604,666,807口	6,559,568,338口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,283円	7,293円	7,856円	7,858円	7,560円	7,789円

(注) 第152期首元本額は6,863,434,042円、第152～157期中追加設定元本額は19,187,818円、第152～157期中一部解約元本額は323,053,522円、1口当たり純資産額は、第152期0.7283円、第153期0.7293円、第154期0.7856円、第155期0.7858円、第156期0.7560円、第157期0.7789円です。

## ○損益の状況

項 目	第152期	第153期	第154期	第155期	第156期	第157期
	2023年3月21日～ 2023年4月20日	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	29,822,886	29,745,996	29,440,748	29,305,759	29,095,349	29,090,183
受取配当金	29,823,486	29,748,165	29,443,730	29,307,827	29,098,485	29,092,794
受取利息	4	-	-	-	-	-
支払利息	△ 604	△ 2,169	△ 2,982	△ 2,068	△ 3,136	△ 2,611
(B) 有価証券売買損益	214,892,777	△ 5,127,468	365,310,128	△ 10,610,494	△ 207,950,487	138,531,071
売買益	215,634,602	372,356	366,502,259	385,757	566,410	139,451,254
売買損	△ 741,825	△ 5,499,824	△ 1,192,131	△ 10,996,251	△ 208,516,897	△ 920,183
(C) 信託報酬等	△ 4,208,347	△ 4,413,150	△ 4,077,532	△ 4,389,444	△ 4,654,701	△ 4,292,533
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	240,507,316	20,205,378	390,673,344	14,305,821	△ 183,509,839	163,328,721
(E) 前期繰越損益金	△2,100,000,241	△1,859,758,856	△1,832,027,406	△1,440,643,363	△1,430,240,491	△1,615,011,195
(F) 追加信託差損益金	19,088,727	18,089,176	17,032,920	16,245,139	15,521,324	14,679,519
(配当等相当額)	( 655,851,243)	( 652,537,020)	( 646,496,262)	( 641,520,062)	( 638,611,644)	( 635,240,137)
(売買損益相当額)	(△ 636,762,516)	(△ 634,447,844)	(△ 629,463,342)	(△ 625,274,923)	(△ 623,090,320)	(△ 620,560,618)
(G) 計(D+E+F)	△1,840,404,198	△1,821,464,302	△1,424,321,142	△1,410,092,403	△1,598,229,006	△1,437,002,955
(H) 収益分配金	△ 13,649,604	△ 13,559,171	△ 13,412,347	△ 13,289,304	△ 13,209,333	△ 13,119,136
次期繰越損益金(G+H)	△1,854,053,802	△1,835,023,473	△1,437,733,489	△1,423,381,707	△1,611,438,339	△1,450,122,091
追加信託差損益金	19,088,727	18,089,176	17,032,920	16,245,139	15,521,324	14,679,519
(配当等相当額)	( 655,851,243)	( 652,537,020)	( 646,496,262)	( 641,520,062)	( 638,611,644)	( 635,240,137)
(売買損益相当額)	(△ 636,762,516)	(△ 634,447,844)	(△ 629,463,342)	(△ 625,274,923)	(△ 623,090,320)	(△ 620,560,618)
分配準備積立金	2,212,143,352	2,208,330,971	2,199,275,997	2,189,918,257	2,187,116,634	2,186,522,938
繰越損益金	△4,085,285,881	△4,061,443,620	△3,654,042,406	△3,629,545,103	△3,814,076,297	△3,651,324,548

\* 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(2023年3月21日～2023年9月20日)は以下の通りです。

項 目	第152期	第153期	第154期	第155期	第156期	第157期
	2023年3月21日～ 2023年4月20日	2023年4月21日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月20日	2023年6月21日～ 2023年7月20日	2023年7月21日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月20日
a. 配当等収益(経費控除後)	29,310,009円	25,332,960円	29,136,634円	24,916,338円	24,440,689円	28,345,413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	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	655,851,243円	652,537,020円	646,496,262円	641,520,062円	638,611,644円	635,240,137円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,196,482,947円	2,196,557,182円	2,183,551,710円	2,178,291,223円	2,175,885,278円	2,171,296,661円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,881,644,199円	2,874,427,162円	2,859,184,606円	2,844,727,623円	2,838,937,611円	2,834,882,211円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	4,222円	4,239円	4,263円	4,281円	4,298円	4,321円
g. 分配金	13,649,604円	13,559,171円	13,412,347円	13,289,304円	13,209,333円	13,119,136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152期	第153期	第154期	第155期	第156期	第157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

2022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書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

2022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		59,866,314
(取得原価：71,802,681米ドル)		
現金預金等		8,649,382
発行未収金		28,677
ブローカーからの未収金		212,478
未収収益		133,780
現金および現金同等物に係る利息		7,713
資産合計		<u>68,898,344</u>
負債		
外国為替先渡し契約に係る評価損失		797,263
買戻未払金		875,174
ブローカーへの未払金		200,740
未払費用		174,917
負債合計		<u>2,048,094</u>
純資産総額		<u><u>66,850,250</u></u>

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)	8,156	109,321	891,626,787
アジア通貨クラス (円)	7,867	381,295	2,999,823,664
資源国通貨クラス (円)	5,201	1,095,829	5,699,560,125



## 運用計算書

2022年9月20日に終了する計測期間

(金額は米ドル表示)

収益	
銀行口座利息	33,433
債券利息 (源泉徴収税控除後)	624,409
受取配当金等 (源泉徴収税控除後)	161,187
雑収益	139
収益合計	819,168
費用	
投資顧問報酬	563,722
事務管理代行報酬	67,320
保管費用	25,561
取引銀行報酬	16,000
銀行手数料	25,560
受託報酬	16,843
法務報酬	4,839
立替費用	8,412
専門家報酬	28,400
印刷出版手数料	5,842
雑費用	197
費用合計	762,696
純投資損益	56,472
投資有価証券売買に係る損益	373,559
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	218,044
当期実現純損益	591,603
投資有価証券評価損益の増減	(24,499,122)
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(1,318,496)
当期評価差損益	(25,817,618)
運用の結果による純資産の増減額	(25,169,543)

純資産変動計算書  
2022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	103,274,803
純投資損益	56,472
当期実現純損益	591,603
当期評価差損益	(25,817,618)
運用の結果による純資産の増減額	(25,169,543)
受益証券の発行手取金	350,917
受益証券の買戻支払金	(5,659,965)
	(5,309,048)
受益者への支払分配金	(5,945,962)
期末純資産総額	66,850,250

発行済受益証券数の変動表  
2022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	112,680
発行受益証券数	879
買戻受益証券数	(4,238)
期末発行済受益証券数	109,321
アジア通貨クラス	
期首受益証券数	379,030
発行受益証券数	3,766
買戻受益証券数	(1,501)
期末発行済受益証券数	381,295
資源国通貨クラス	
期首受益証券数	1,212,298
発行受益証券数	1,548
買戻受益証券数	(118,017)
期末発行済受益証券数	1,095,829

## 統計情報

2022年9月20日現在  
(未監査)

	2022	2021	2020
期末純資産総額 (米ドル)	66,850,250	103,274,803	97,859,068
日本円クラス (円)			
期末純資産総額	891,626,787	1,232,854,996	1,114,054,206
期末1口当たり純資産価格	8,156	10,941	9,515
アジア通貨クラス (円)			
期末純資産総額	2,999,823,664	3,289,666,604	2,765,403,691
期末1口当たり純資産価格	7,867	8,679	7,136
資源国通貨クラス (円)			
期末純資産総額	5,699,560,125	6,832,554,813	6,355,134,183
期末1口当たり純資産価格	5,201	5,636	4,576

組入資産明細  
2022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	400,000	SEVEN GROUP HOL CV 2.2000% 05/03/25	318,037	262,351	0.39
AUD	300,000	DEXUS FINANCE CV 2.3000% 19/06/26	212,083	191,967	0.29
			530,120	454,318	0.68
		合計： オーストラリア	530,120	454,318	0.68
<b>オーストリア</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	500,000	AMS-OSRAM AG CV 2.1250% 03/11/27	590,187	340,581	0.51
			590,187	340,581	0.51
		合計： オーストリア	590,187	340,581	0.51
<b>ベルギー</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	300,000	SAGERPAR CV 0% 01/04/26	362,162	278,466	0.42
EUR	400,000	MITHRA PHARMA CV 4.2500% 17/12/25	517,488	276,218	0.41
			879,650	554,684	0.83
		合計： ベルギー	879,650	554,684	0.83
<b>バミューダ諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	JAZZ INVT I LTD CV 2.0000% 15/06/26	478,279	448,844	0.66
USD	400,000	BW OFFSHORE LTD CV 2.5000% 12/11/24	354,267	347,648	0.52
USD	200,000	BORR DRILLING CV 3.8750% 23/05/23	201,017	191,666	0.29
USD	600,000	AFRICAN MINERALS CV 8.5% 10/02/17	610,068	6,000	0.01
			1,643,631	994,158	1.48
<b>その他債券</b>					
HKD	2,000,000	REXLOT HLDG CV 4.5% 17/04/19	81,421	11,092	0.02
			81,421	11,092	0.02
		合計： バミューダ諸島	1,725,052	1,005,250	1.50
<b>英領ヴァージン諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
HKD	4,000,000	SAIL VANTAGE LTD CV 0% 13/01/27	466,131	391,770	0.58
USD	200,000	PB ISSUER #5 LT CV 3.0000% 10/12/25	194,000	353,500	0.53
HKD	2,000,000	CHINA CONCH VEN CV 0% 05/09/23	278,382	271,610	0.41
USD	200,000	UNIVERSE TREK CV 2.5000% 08/07/25	214,807	195,000	0.29
USD	200,000	UNIVERSE TREK CV 0% 15/06/26	204,100	174,250	0.26
			1,357,420	1,386,130	2.07
<b>その他債券</b>					
HKD	4,000,000	CRYSTAL IDEA GR CV 2.2500% 31/10/22	282,830	224,218	0.34
			282,830	224,218	0.34
		合計： 英領ヴァージン諸島	1,640,250	1,610,348	2.41

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	682,000	AIR CANADA CV 4.0000% 01/07/25	986,236	818,803	1.23
USD	819,000	SHOPIFY INC CV 0.1250% 01/11/25	948,403	683,715	1.02
			<u>1,934,639</u>	<u>1,502,518</u>	<u>2.25</u>
		合計： カナダ	<u>1,934,639</u>	<u>1,502,518</u>	<u>2.25</u>
<b>ケイマン諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	276,000	SEA LTD CV 1.0000% 01/12/24	598,370	354,724	0.53
HKD	2,000,000	CATHAY PAC FIN CV 2.7500% 05/02/26	268,659	281,878	0.42
USD	400,000	MICROPORT SCIENT CV 0% 11/06/26	296,000	277,872	0.42
HKD	2,000,000	ZHONGSHENG CV 0% 21/05/25	258,047	275,814	0.41
USD	300,000	HANSOH PHAR CV 0% 22/01/26	280,125	275,250	0.41
HKD	2,000,000	KINGSOFT CORP CV 0.6250% 29/04/25	512,905	261,800	0.39
USD	200,000	CN HONGQIAO LTD CV 5.2500% 25/01/26	200,080	242,250	0.36
HKD	2,000,000	ZHOY HEI YA INT CV 1.0000% 05/11/25	257,237	239,506	0.36
USD	200,000	CHINA OVRES FIN CV 0% 05/01/23	226,355	238,250	0.36
USD	300,000	MEITUAN CV 0% 27/04/28	277,857	235,350	0.35
USD	200,000	POSEIDON FIN 1 CV 0% 01/02/25	200,393	202,024	0.30
USD	177,000	SEA LTD CV 2.3750% 01/12/25	236,597	183,855	0.28
			<u>3,612,625</u>	<u>3,068,573</u>	<u>4.59</u>
		合計： ケイマン諸島	<u>3,612,625</u>	<u>3,068,573</u>	<u>4.59</u>
<b>中国</b>					
<b>転換社債</b>					
HKD	2,000,000	ANGANG STEEL CV 0% 25/05/23	258,357	252,882	0.38
			<u>258,357</u>	<u>252,882</u>	<u>0.38</u>
		合計： 中国	<u>258,357</u>	<u>252,882</u>	<u>0.38</u>
<b>キプロス</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	OZON HOLDINGS CV 1.8750% 24/02/26	400,000	92,040	0.14
			<u>400,000</u>	<u>92,040</u>	<u>0.14</u>
		合計： キプロス	<u>400,000</u>	<u>92,040</u>	<u>0.14</u>
<b>フランス</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	CARREFOUR SA CV 0% 27/03/24	409,188	377,968	0.56
EUR	300,000	ORPAR CV 0% 20/06/24 RCO	378,053	371,588	0.56
--	4,301	ORPEA CV 0.3750% 17/05/27	616,658	355,904	0.53
EUR	400,000	BIGBEN INTERACT CV 1.1250% 19/02/26	479,904	329,896	0.49
--	5,000	FNAC DARTY SA CV 0.2500% 23/03/27	456,597	328,431	0.49
--	2,100	SAFRAN SA CV 0% 01/04/28 SAF	371,285	327,636	0.49
EUR	300,000	BNP PARIBAS CV 0% 13/05/25 .	343,634	324,235	0.49
--	5,200	NEXITY CV 0.2500% 02/03/25	417,017	317,293	0.47
--	2,200	ENGIE CV 0% 02/06/24	218,473	256,652	0.38
EUR	200,000	ARCHER OBLIGAT CV 0% 31/03/23 KER	340,215	252,548	0.38
--	5,500	NEOEN SAS CV 1.8750% 07/10/24 NEOE	269,645	232,020	0.35
--	2,100	WORLDLINE SA CV 0% 30/07/25	316,758	221,679	0.33
EUR	200,000	NEOEN SAS CV 2.8750% 14/09/27 .	197,630	207,729	0.31
--	4,000	MAISONS DU MOND CV 0.1250% 06/12/23	166,614	184,709	0.28
			<u>4,981,671</u>	<u>4,088,288</u>	<u>6.11</u>
<b>変動金利債</b>					
EUR	9,800	KORIAN SA CV FRN 08/03/70	505,541	324,597	0.49
			<u>505,541</u>	<u>324,597</u>	<u>0.49</u>
		合計： フランス	<u>5,487,212</u>	<u>4,412,885</u>	<u>6.60</u>

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>ドイツ</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	600,000	LEG IMMOBILIEN CV 0.4000% 30/06/28	669,029	470,309	0.70
EUR	500,000	MORPHOSYS A CV 0.6250% 16/10/25 MOR	574,966	348,300	0.52
EUR	500,000	DELIVERY HERO A CV 1.5000% 15/01/28	536,353	339,095	0.51
EUR	500,000	DELIVERY HERO CV 2.1250% 10/03/29 B	558,499	321,237	0.48
EUR	400,000	TAG IMMO AG CV 0.6250% 27/08/26	408,239	304,242	0.46
EUR	400,000	ZALANDO SE CV 0.6250% 06/08/27 B	492,539	296,141	0.44
EUR	300,000	MBT SYSTEMS CV 3.5000% 08/07/27	355,470	291,475	0.44
EUR	300,000	DT LUFTHANS CV 2.0000% 17/11/25 LHA	385,330	283,152	0.42
EUR	300,000	RAG STIFTUNG CV 0% 02/10/24 EVK	359,103	279,512	0.42
EUR	200,000	DUERR AG CV 0.7500% 15/01/26 DUE	207,536	181,021	0.27
			<u>4,547,064</u>	<u>3,114,484</u>	<u>4.66</u>
		合計： ドイツ	<u>4,547,064</u>	<u>3,114,484</u>	<u>4.66</u>
<b>香港</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	LENOVO GROUP LT CV 2.5000% 26/08/29	400,000	377,448	0.56
			<u>400,000</u>	<u>377,448</u>	<u>0.56</u>
		合計： 香港	<u>400,000</u>	<u>377,448</u>	<u>0.56</u>
<b>インド</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	200,000	BHARTI AIR CV 1.5000% 17/02/25 REGS	239,888	271,750	0.41
			<u>239,888</u>	<u>271,750</u>	<u>0.41</u>
		合計： インド	<u>239,888</u>	<u>271,750</u>	<u>0.41</u>
<b>アイルランド</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	300,000	GLANBIA COOP SO CV 1.8750% 27/01/27	334,235	277,152	0.41
			<u>334,235</u>	<u>277,152</u>	<u>0.41</u>
		合計： アイルランド	<u>334,235</u>	<u>277,152</u>	<u>0.41</u>
<b>イスラエル</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	320,000	CYBERARK SOFTWARE CV 0% 15/11/24	347,633	373,658	0.56
			<u>347,633</u>	<u>373,658</u>	<u>0.56</u>
		合計： イスラエル	<u>347,633</u>	<u>373,658</u>	<u>0.56</u>
<b>イタリア</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	400,000	DIASORIN CV 0% 05/05/28 DIA	462,344	341,890	0.51
EUR	400,000	NEXI CV 0% 24/02/28 .	453,485	287,086	0.43
EUR	200,000	PRYSMIAN SPA CV 0% 02/02/26 PRY	201,611	195,788	0.29
			<u>1,117,440</u>	<u>824,764</u>	<u>1.23</u>
		合計： イタリア	<u>1,117,440</u>	<u>824,764</u>	<u>1.23</u>
<b>ジャージー</b>					
<b>転換社債</b>					
GBP	400,000	CORNWALL JERSEY CV 0.7500% 16/04/26	519,154	283,037	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 (%)
USD	200,000	SIRIUS MINRLS CV 5.0000% 23/05/27	292,800	279,398	0.42
GBP	200,000	PHP FIN JERS CV 2.8750% 15/07/25	269,110	226,968	0.34
GBP	200,000	DERWENT CAP 3 CV 1.5000% 12/06/25	255,141	206,497	0.31
USD	400,000	NMC HEALTH CV 1.8750% 30/04/25	389,373	100,000	0.15
			1,725,578	1,095,900	1.64
<b>その他債券</b>					
GBP	500,000	INTU JERSEY TWO CV 0.0000% 01/11/22	627,934	104,775	0.16
			627,934	104,775	0.16
		合計： ジャージー	2,353,512	1,200,675	1.80
		<b>ルクセンブルグ</b>			
<b>転換社債</b>					
EUR	300,000	LAGFIN CV 2.0000% 02/07/25	367,435	319,401	0.48
GBP	400,000	IWG INT HLDG CV 0.5000% 09/12/27	484,229	313,367	0.47
EUR	400,000	GLOBAL FASHION CV 1.2500% 15/03/28	468,190	282,241	0.42
HKD	2,000,000	CITIGROUP GLOB L CV 0% 25/07/24 960	288,647	246,513	0.37
EUR	200,000	OLIVER CAPITAL CV 0% 29/12/23 GIA	247,121	198,442	0.30
EUR	200,000	EUROPEAN T CV 4.0000% 21/09/21 SMCP	218,395	154,756	0.23
			2,074,017	1,514,720	2.27
		合計： ルクセンブルグ	2,074,017	1,514,720	2.27
		<b>マルタ</b>			
<b>転換社債</b>					
GBP	300,000	BRAIT PLC CV 6.5000% 04/12/24	347,733	303,205	0.45
			347,733	303,205	0.45
		合計： マルタ	347,733	303,205	0.45
		<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	312,348	0.47
			400,000	312,348	0.47
		合計： モーリシャス	400,000	312,348	0.47
		<b>オランダ</b>			
<b>転換社債</b>					
USD	600,000	STMICROELECTRON CV 0% 04/08/27 B	731,542	627,089	0.95
EUR	465,000	BNP PARIBAS ISS CV 0% 13/12/24 000A	597,354	494,304	0.74
EUR	400,000	MONDELEZ INTL CV 0% 20/09/24 MDLZ	481,705	403,648	0.60
USD	400,000	ELM BV FOR CV 3.2500% 13/06/24 SREN	420,974	401,500	0.60
CHF	400,000	DUFY ONE BV CV 0.7500% 30/03/26	427,942	323,549	0.48
EUR	400,000	JUST EAT TAKEA CV 1.2500% 30/04/26	490,276	311,832	0.47
EUR	300,000	AMERICA MOVIL BV CV 0% 02/03/24	382,490	308,782	0.46
CHF	291,000	ZUR ROSE FINANC CV 6.8750% 15/09/26	305,640	303,484	0.45
EUR	300,000	TAKEAWAY.COM N CV 2.2500% 25/01/24	477,945	283,907	0.42
EUR	300,000	BASIC-FIT CV 1.5000% 17/06/28 BFIT	364,965	273,839	0.41
USD	200,000	QIAGEN NV CV 1.0000% 13/11/24	219,165	212,382	0.32
EUR	200,000	COSMO PHARMA NV CV 2.5000% 05/12/23	220,128	189,513	0.28
EUR	200,000	PHARMING NV CV 3.0000% 21/01/25	216,134	180,867	0.27
EUR	200,000	SHOP APOTHEKE CV 0% 21/01/28 SAE	242,950	131,316	0.20
			5,579,210	4,446,012	6.65
<b>変動金利債</b>					
EUR	300,000	ENCAVIS FINANCE CV FRN 24/05/70	338,760	315,350	0.47
			338,760	315,350	0.47
		合計： オランダ	5,917,970	4,761,362	7.12

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>ニュージーランド</b>					
転換社債					
USD	400,000	XERO INVMNTS LTD CV 0% 02/12/25	405,200	323,500	0.48
			405,200	323,500	0.48
		合計： ニュージーランド	405,200	323,500	0.48
<b>韓国</b>					
転換社債					
EUR	300,000	POSCO CV 0% 01/09/26	356,745	280,072	0.42
			356,745	280,072	0.42
		合計： 韓国	356,745	280,072	0.42
<b>シンガポール</b>					
転換社債					
EUR	200,000	SGX TREASURY CV 0% 01/03/24	246,367	201,557	0.30
SGD	250,000	KEPPEL REIT CV 1.9000% 10/04/24	183,259	171,604	0.26
			429,626	373,161	0.56
		合計： シンガポール	429,626	373,161	0.56
<b>スペイン</b>					
転換社債					
EUR	400,000	CELLNEX TE CV 1.5000% 16/01/26 CLNX	699,894	464,561	0.69
EUR	300,000	SACYR SA CV 3.7500% 25/04/24	330,723	311,806	0.47
EUR	300,000	CO ECONOMI CV 1.0000% 01/12/23 EBRO	363,848	291,631	0.44
			1,394,465	1,067,998	1.60
		合計： スペイン	1,394,465	1,067,998	1.60
<b>スウェーデン</b>					
転換社債					
EUR	300,000	GEELY SWEDEN FIN CV 0% 19/06/24	465,521	326,693	0.49
			465,521	326,693	0.49
		合計： スウェーデン	465,521	326,693	0.49
<b>スイス</b>					
転換社債					
CHF	400,000	CEMBRA MONEY BAN CV 0% 09/07/26	460,657	372,079	0.56
CHF	400,000	IDORSIA LTD CV 2.1250% 04/08/28	437,254	299,159	0.45
CHF	300,000	SWISS PRIM CV 0.3250% 16/01/25 SPSN	317,410	295,949	0.44
CHF	240,000	SIKA AG CV 0.1500% 05/06/25	343,517	295,681	0.44
CHF	168,750	SANTHERA PHA CV 7.5000% 17/08/24	236,650	125,680	0.19
			1,795,488	1,388,548	2.08
		合計： スイス	1,795,488	1,388,548	2.08
<b>アラブ首長国連邦</b>					
転換社債					
USD	600,000	ABU DHABI NAT CV 0.7000% 04/06/24	599,430	560,040	0.84
			599,430	560,040	0.84
		合計： アラブ首長国連邦	599,430	560,040	0.84



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>イギリス</b>					
<b>転換社債</b>					
GBP	300,000	TRAINLINE PLC CV 1.0000% 14/01/26	395,142	297,110	0.44
GBP	300,000	JET2 PLC CV 1.6250% 10/06/26	413,665	279,302	0.42
GBP	200,000	CAPITAL & COUNT CV 2.0000% 30/03/26	264,643	194,936	0.29
GBP	100,000	STOBART FIN CV 2.7500% 08/05/24	130,385	79,067	0.12
			1,203,835	850,415	1.27
		合計： イギリス	1,203,835	850,415	1.27
<b>アメリカ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	434,000	ON SEMICON CV 1.6250% 15/10/23 144A	481,106	1,449,403	2.16
USD	949,000	SOUTHWEST AIR CV 1.2500% 01/05/25	1,261,459	1,189,210	1.78
USD	594,000	MICROCHIP TECH CV 1.6250% 15/02/27	608,871	1,109,740	1.66
USD	1,004,000	BURLINGTON STOR CV 2.2500% 15/04/25	1,263,669	1,036,067	1.55
USD	984,000	FORD MOTOR CO CV 0% 15/03/26	1,114,329	1,008,235	1.51
USD	747,000	INSULET CORP CV 0.3750% 01/09/26	795,692	951,386	1.42
USD	687,000	BOOKING HLDS IN CV 0.7500% 01/05/25	944,276	899,111	1.34
USD	399,000	MERCADOLIBRE IN CV 2.0000% 15/08/28	949,024	870,642	1.30
USD	634,000	LIVE NATION ENT CV 2.5000% 15/03/23	651,381	844,108	1.26
USD	391,000	REPLIGEN CORP CV 0.3750% 15/07/24	729,889	757,254	1.13
USD	377,000	PALO ALTO NET CV 0.7500% 01/07/23	764,129	743,595	1.11
USD	300,000	PIONEER NATURAL CV 0.2500% 15/05/25	625,102	685,374	1.03
USD	593,000	LIBERTY INTER CV 1.75% 30/09/46 144	665,426	659,280	0.99
USD	530,000	DATADOG INC CV 0.1250% 15/06/25	673,204	654,815	0.98
USD	525,000	MONGODB INC CV 0.2500% 15/01/26	648,945	637,371	0.95
USD	722,000	OKTA INC CV 0.1250% 01/09/25	814,083	617,993	0.92
USD	647,000	FIVE9 INC CV 0.5000% 01/06/25	886,418	615,796	0.92
USD	396,000	PENN NATL GAMIN CV 2.7500% 15/05/26	796,161	614,640	0.92
USD	418,000	ZSCALER INC CV 0.1250% 01/07/25	468,160	559,167	0.84
USD	638,000	AIRBNB INC CV 0% 15/03/26	617,252	546,298	0.82
USD	608,000	CHEGG INC CV 0.1250% 15/03/25	836,892	535,483	0.80
USD	494,000	ARES CAPITAL CO CV 4.6250% 01/03/24	573,417	527,123	0.79
USD	592,000	COUPA SOFTWARE CV 0.1250% 15/06/25	745,837	523,269	0.78
USD	530,000	IAC FINANCECO 3 CV 2.0000% 15/01/30	734,709	515,393	0.77
USD	575,000	LYFT INC CV 1.5000% 15/05/25	725,838	515,173	0.77
USD	628,000	CLOUDFLARE CV 0% 15/08/26	673,630	512,861	0.77
USD	428,000	ZILLOW GRP CV 1.3750% 01/09/26	743,105	447,029	0.67
USD	205,000	DEXCOM INC CV 0.7500% 01/12/23	578,125	438,630	0.66
USD	419,000	DROPBOX CV 0% 01/03/26	427,047	379,218	0.57
USD	212,000	CLOUDFLARE CV 0.7500% 15/05/25	328,172	371,958	0.56
USD	371,000	SQUARE INC CV 0.1250% 01/03/25	440,377	355,382	0.53
USD	374,000	SNAP INC CV 0.7500% 01/08/26	375,908	343,117	0.51
USD	314,000	AKAMAI TECH CV 0.1250% 01/05/25	358,274	336,881	0.50
USD	402,000	SPLUNK INC CV 1.1250% 15/06/27	335,670	335,179	0.50
USD	465,000	COINBASE GLOBAL CV 0.5000% 01/06/26	324,431	314,779	0.47
EUR	300,000	JPMORGANCHASEFIN CV 0% 14/01/25	364,082	310,019	0.46
USD	253,000	BILL.COM CV 0% 01/12/25	426,228	292,223	0.44
USD	301,000	DEXCOM INC CV 0.2500% 15/11/25	317,931	290,822	0.44
USD	247,000	SQUARE INC CV 0.5000% 15/05/23	267,694	262,047	0.39
USD	271,000	EXACT SCIENCES CV 1.0000% 15/01/25	441,181	252,048	0.38

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	200,000	GLENCORE FDG LL CV 0% 27/03/25 GLEN	179,039	213,600	0.32
			25,956,163	24,521,719	36.67
<b>優先証券</b>					
--	1,000	DANAHER COR CV PFD 5.0000% 15/04/23	1,470,988	1,467,930	2.21
--	12,522	KKR & CO IN CV PFD 6.0000% 15/09/23	844,900	756,579	1.13
--	5,789	BOSTON SCIE CV PFD 5.5000% 01/06/23	633,762	611,666	0.91
--	6,904	STANLEY BLA CV PFD 5.2500% 15/11/22	775,603	375,094	0.56
--	6,794	BECTON DICK CV PFD 6.0000% 01/06/23	333,371	337,254	0.50
			4,058,624	3,548,523	5.31
		合計： アメリカ	30,014,787	28,070,242	41.98
		<b>組入資産合計</b>	<b>71,802,681</b>	<b>59,866,314</b>	<b>89.55</b>

<sup>(1)</sup> 額面価格は発行通貨建てで表示

財務書類に関する注記  
2022年9月20日現在

## 注記 - 外国為替先渡し契約

2022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)
USD	9,146	JPY	1,294,920	2022年9月30日	111
USD	2,383	JPY	337,455	2022年9月30日	29
JPY	593,243,885	USD	4,139,396	2022年10月17日	7,024
USD	145,921	ZAR	2,559,035	2022年10月17日	1,422
USD	145,921	ZAR	2,554,924	2022年9月30日	1,417
USD	37,731	ZAR	649,783	2022年9月30日	980
USD	34,479	ZAR	593,782	2022年9月30日	895
USD	145,921	AUD	216,308	2022年10月17日	531
USD	145,921	AUD	216,379	2022年9月30日	531
USD	37,731	AUD	55,781	2022年9月30日	250
USD	34,479	AUD	50,974	2022年9月30日	228
USD	1,981	ZAR	34,122	2022年9月30日	51
USD	1,981	AUD	2,929	2022年9月30日	13
USD	3,962	BRL	20,621	2022年10月4日	(10)
JPY	2,060,000	USD	14,417	2022年10月17日	(19)
JPY	2,060,000	USD	14,392	2022年9月30日	(19)
USD	68,958	BRL	358,843	2022年10月4日	(177)
USD	75,462	BRL	392,687	2022年10月4日	(194)
USD	291,843	BRL	1,519,316	2022年10月4日	(875)
AUD	3,182,399	USD	2,144,398	2022年10月17日	(5,370)
BRL	37,318,351	USD	7,219,169	2022年10月4日	(29,244)
BRL	37,318,351	USD	7,244,411	2022年10月4日	(54,487)
ZAR	56,436,911	USD	3,298,938	2022年9月30日	(106,899)
JPY	351,135,748	USD	2,577,858	2022年9月30日	(127,901)
ZAR	179,249,895	USD	10,302,582	2022年10月17日	(180,969)
AUD	16,620,045	USD	11,507,549	2022年9月30日	(340,095)
USD	2,401,842	GBP	2,000,000	2022年10月13日	108,690
INR	564,304,773	USD	7,039,027	2022年10月14日	26,337
USD	604,538	AUD	880,000	2022年10月13日	13,096
EUR	570,000	USD	565,156	2022年10月6日	7,667
USD	122,192	GBP	100,000	2022年10月13日	7,534
USD	2,323,379	HKD	18,200,000	2022年10月13日	3,525
USD	122,504	EUR	120,000	2022年10月6日	1,910
USD	177,218	SGD	247,000	2022年10月13日	1,728
EUR	200,000	USD	199,675	2022年10月6日	1,315
USD	313,236	CHF	300,000	2022年10月13日	987

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)
EUR	230,000	USD	230,427	2022年10月 6 日	712
EUR	100,000	USD	99,996	2022年10月 6 日	499
USD	14,520	SGD	20,000	2022年10月13日	311
USD	127,671	HKD	1,000,000	2022年10月13日	207
USD	165,867	HKD	1,300,000	2022年10月13日	163
USD	101,996	HKD	800,000	2022年10月13日	25
USD	180,081	EUR	180,000	2022年10月 6 日	(810)
USD	1,779,103	CHF	1,720,000	2022年10月13日	(11,127)
IDR	104,389,833,608	USD	6,978,396	2022年10月14日	(14,532)
CNY	46,974,880	USD	6,747,907	2022年12月16日	(19,185)
USD	16,086,211	EUR	16,100,000	2022年10月 6 日	(93,538)
					<b>(797,263)</b>

# 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	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	落中率			
	円		%	%	%	百万円
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159
20期(2022年8月19日)	10,199		△0.0	57.5	—	7,850
21期(2023年8月21日)	10,196		△0.0	5.7	—	6,733

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

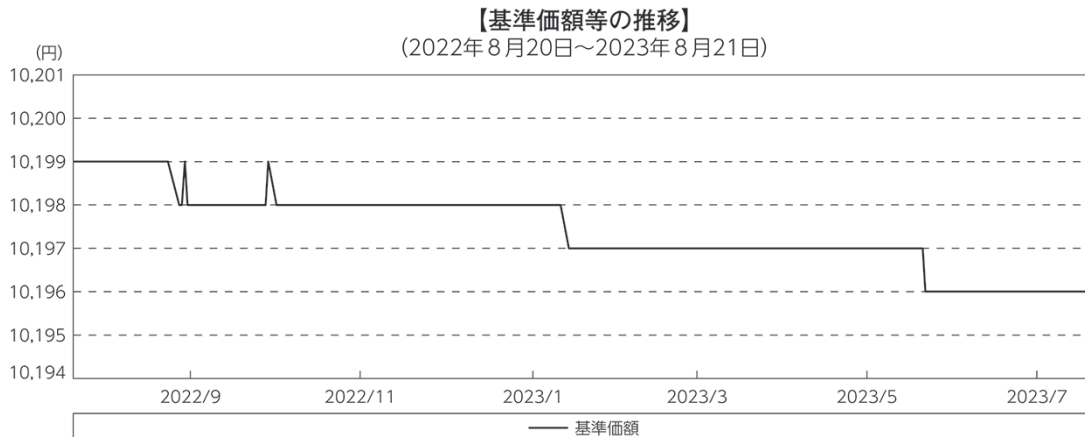
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰	落率			
(期首) 2022年8月19日	円 10,199		% —	% 57.5	% —	% —
8月末	10,199		0.0	58.4	—	—
9月末	10,198		△0.0	48.5	—	—
10月末	10,198		△0.0	44.4	—	—
11月末	10,198		△0.0	34.4	—	—
12月末	10,198		△0.0	20.7	—	—
2023年1月末	10,198		△0.0	16.4	—	—
2月末	10,197		△0.0	25.4	—	—
3月末	10,197		△0.0	22.8	—	—
4月末	10,197		△0.0	26.2	—	—
5月末	10,197		△0.0	14.3	—	—
6月末	10,196		△0.0	9.1	—	—
7月末	10,196		△0.0	4.3	—	—
(期末) 2023年8月21日	10,196		△0.0	5.7	—	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



### ○基準価額の主な変動要因

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

### ○投資環境

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

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

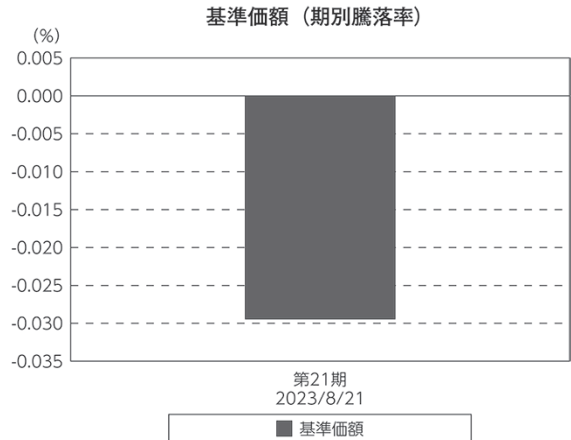
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



## ○1万口当たりの費用明細

(2022年8月20日～2023年8月21日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2022年8月20日～2023年8月21日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 4,557,523	千円 503,685 (4,569,320)
	特殊債券	2,284,885	— (5,187,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	300,407	— (1,000,000)

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年8月20日～2023年8月21日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2023年8月21日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満	%
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		償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	額	額	
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)R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DCファンド(高野ヘッジあり)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
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信(毎月分配型)	982,608
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297
グローバル・ストック Bコース	979,528
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	626,503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	398,357
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	373,897
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	123,377
グローバル・ストック Dコース	116,529
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)毎月分配型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源通貨コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98,078
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース	98,078
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース	98,059
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース	98,059
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
マイライフ・エール(資産成長型)	98,049
マイライフ・エール(年2%目標払出型)	98,049
マイライフ・エール(年6%目標払出型)	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・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(インドルピアコース)年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	13,042
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド(米ドル売り円買い)(野村SMA・EW向け)	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォークス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォークス株式 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。