

# 野村グローバルCB投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型

## 運用報告書(全体版)

第56期 (決算日2015年4月20日) 第57期 (決算日2015年5月20日) 第58期 (決算日2015年6月22日)  
第59期 (決算日2015年7月21日) 第60期 (決算日2015年8月20日) 第61期 (決算日2015年9月24日)

作成対象期間 (2015年3月21日～2015年9月24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2020年9月23日(当初、2015年9月24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・ポンドーアジア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・ポンドーアジア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 (アジア通貨コース) 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・ポンドーアジア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・ポンド ーアジア通貨クラス	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 (アジア通貨コース) 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。 外貨建て資産への直接投資は行いません。
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であ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

東京都中央区日本橋1-12-1



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 (分配落)	価 額			純 資 産 額
		税 分	込 配	み 期 金 騰 落 率	
	円	円	円	%	百万円
32期(2013年4月22日)	9,557	50		4.4	9,514
33期(2013年5月20日)	10,179	50		7.0	9,321
34期(2013年6月20日)	9,048	50		△10.6	7,834
35期(2013年7月22日)	9,597	50		6.6	7,786
36期(2013年8月20日)	9,106	50		△4.6	7,123
37期(2013年9月20日)	9,295	50		2.6	6,955
38期(2013年10月21日)	9,336	50		1.0	6,690
39期(2013年11月20日)	9,503	50		2.3	6,501
40期(2013年12月20日)	9,768	50		3.3	6,411
41期(2014年1月20日)	10,111	50		4.0	6,517
42期(2014年2月20日)	10,046	50		△0.1	6,299
43期(2014年3月20日)	10,159	50		1.6	5,610
44期(2014年4月21日)	10,130	50		0.2	5,458
45期(2014年5月20日)	10,230	50		1.5	5,376
46期(2014年6月20日)	10,208	50		0.3	5,177
47期(2014年7月22日)	10,190	50		0.3	5,074
48期(2014年8月20日)	10,294	50		1.5	5,009
49期(2014年9月22日)	10,849	50		5.9	5,158
50期(2014年10月20日)	10,068	50		△6.7	4,732
51期(2014年11月20日)	11,465	50		14.4	5,289
52期(2014年12月22日)	11,351	50		△0.6	5,161
53期(2015年1月20日)	11,101	50		△1.8	5,024
54期(2015年2月20日)	11,556	50		4.5	5,172
55期(2015年3月20日)	11,790	50		2.5	5,279
56期(2015年4月20日)	11,856	50		1.0	5,278
57期(2015年5月20日)	11,886	50		0.7	5,300
58期(2015年6月22日)	12,013	50		1.5	5,345
59期(2015年7月21日)	12,040	50		0.6	5,311
60期(2015年8月20日)	11,474	50		△4.3	5,020
61期(2015年9月24日)	10,712	50		△6.2	4,574

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

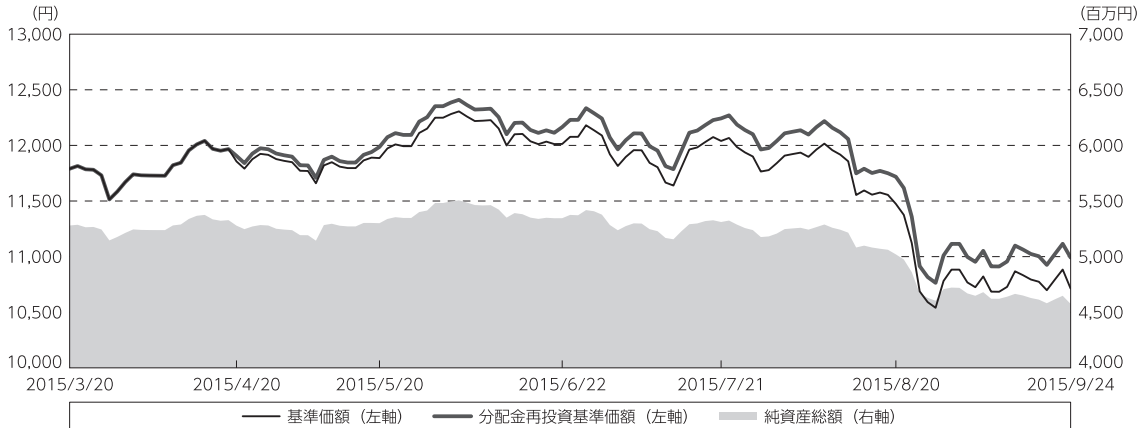
## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	
			騰	落 率
第56期	(期 首) 2015年 3月20日	円 11,790		% —
	3月末	11,670		△1.0
	(期 末) 2015年 4月20日	11,906		1.0
第57期	(期 首) 2015年 4月20日	11,856		—
	4月末	11,849		△0.1
	(期 末) 2015年 5月20日	11,936		0.7
第58期	(期 首) 2015年 5月20日	11,886		—
	5月末	12,249		3.1
	(期 末) 2015年 6月22日	12,063		1.5
第59期	(期 首) 2015年 6月22日	12,013		—
	6月末	11,920		△0.8
	(期 末) 2015年 7月21日	12,090		0.6
第60期	(期 首) 2015年 7月21日	12,040		—
	7月末	11,908		△1.1
	(期 末) 2015年 8月20日	11,524		△4.3
第61期	(期 首) 2015年 8月20日	11,474		—
	8月末	10,883		△5.2
	(期 末) 2015年 9月24日	10,762		△6.2

\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第56期首：11,790円

第61期末：10,712円 (既払分配金(税込み)：300円)

騰落率：△6.8% (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(2015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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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11,790円から当作成期末には10,712円となりました。

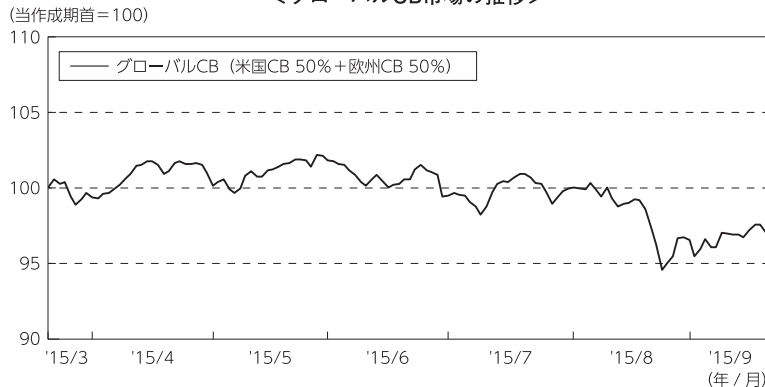
- ・ 実質的に投資している日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債(グローバルCB)からのインカムゲイン(利子収入)
- ・ 実質的に投資している日本を除く世界の企業が発行する高利回りの転換社債(グローバルCB)からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)
- ・ 円/アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)の為替変動

## ○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。

#### <グローバルCB市場の推移>



(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で合成し日や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。

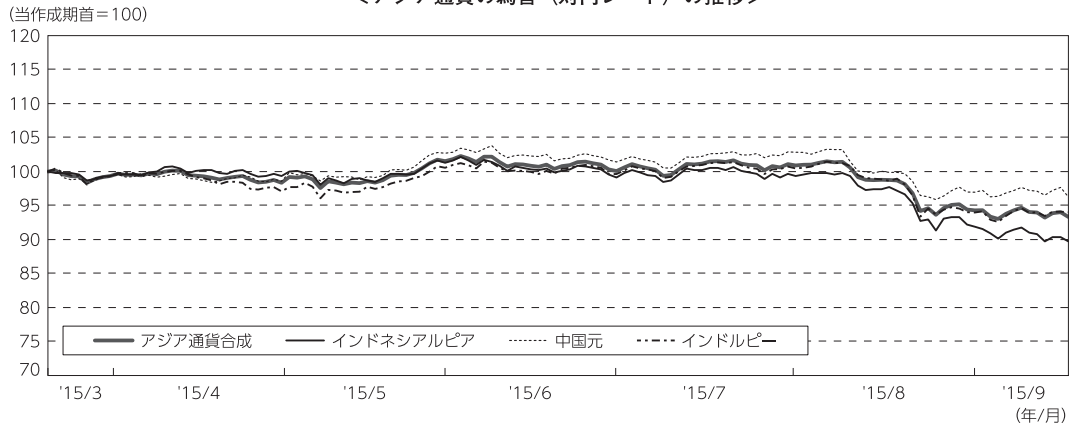
トムソン・ロイター・インデックスに係る規則および/またはガイドライン、トムソン・ロイター・インデックスおよび関連計算式の計算・編集のプロセスや基準、ベンチマークの構成やその他の関連要素は、通知を行うことなく、トムソン・ロイターの裁量により、変更または改定される場合があります。

グローバルCB市場は、一部米国企業の決算が好調な内容だったことや、ECB (欧州中央銀行) が国債購入を含む追加金融緩和策を開始したことなどから、'15年5月まで堅調に推移しました。その後は、FRB (米連邦準備制度理事会) が年内に政策金利を引き上げるとの観測が高まったことや、中国を中心に世界経済に対する先行き不透明感が強まったことなどから下落し、当作成期間では値下がりとなりました。

## ＜為替レート＞

アジア通貨（中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨を等分投資し、日々リバランスを行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。

＜アジア通貨の為替（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(アジア通貨コース)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・ボンドーアジア通貨クラス〕 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・ボンドーアジア通貨クラス〕 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・ボンドーアジア通貨クラス〕

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0.2%、AA格0.7%、A格8.7%、BBB格29.6%、BB格32.6%、B格17.7%、CCC格以下および無格付3.0%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。

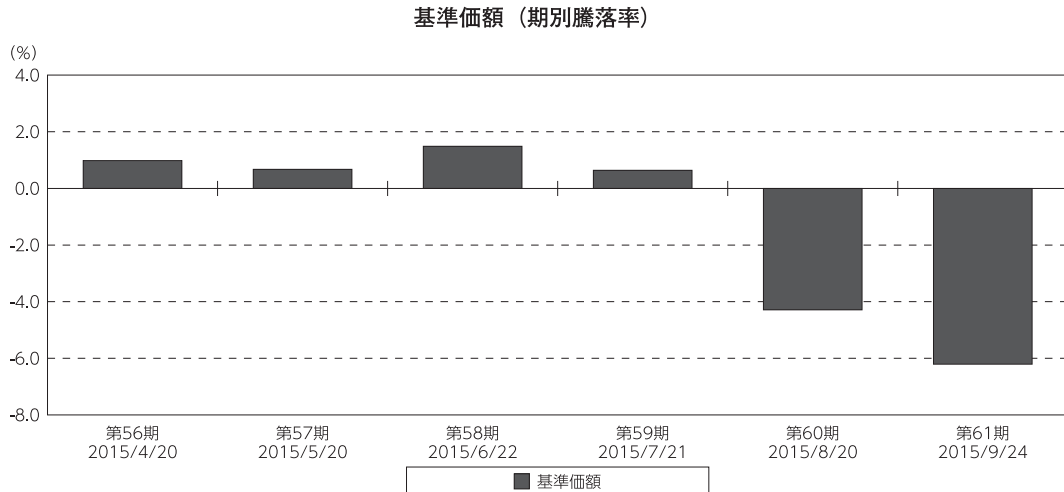
### 〔野村マネー マザーファンド〕

残存期間の短い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により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローン等で運用を行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56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期
	2015年3月21日～ 2015年4月20日	2015年4月21日～ 2015年5月20日	2015年5月21日～ 2015年6月22日	2015年6月23日～ 2015年7月21日	2015年7月22日～ 2015年8月20日	2015年8月21日～ 2015年9月24日
当期分配金 (対基準価額比率)	50 0.420%	50 0.419%	50 0.414%	50 0.414%	50 0.434%	50 0.465%
当期の収益	50	50	50	50	50	50
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,382	2,415	2,541	2,567	2,592	2,617

(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(アジア通貨コース)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・ボンドーアジア通貨クラス〕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・ボンドーアジア通貨クラス〕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・ボンドーアジア通貨クラス】

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います。組入資産について、原則として、米ドルを売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行います。

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っていきます。

### 【野村マネー マザーファンド】

残存期間の短い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により利息等収益の確保を図り、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図る運用を行う方針です。

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の動きについて

店頭デリバティブ取引に関して、将来、国際的に規制の強化等が予定されています。ファンドが投資対象とする外国投資信託が原則として活用する店頭デリバティブ取引(オプション、NDFおよびNDO等を含みます。)が当該規制強化等の対象取引となり、かつ、当該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、当該現金等を資産の一部として追加的に保有することとなります。その場合、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

(2015年3月21日～2015年9月24日)

項 目	第56期～第61期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 61	% 0.516	(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 )	(26)	(0.222)	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 )	(33)	(0.277)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
( 受 託 会 社 )	( 2 )	(0.017)	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
( そ の 他 )	( 0 )	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	61	0.517	
作成期間の平均基準価額は、11,746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。

## ○売買及び取引の状況

(2015年3月21日～2015年9月24日)

## 投資信託証券

銘 柄	第56期～第61期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	口	千円	口	千円
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・ボンドーアジア通貨クラス	9,645	93,933	24,588	228,992

\*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

(2015年3月21日～2015年9月24日)

## 利害関係人との取引状況

<野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型>  
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56期～第61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 24,116	百万円 3,463	% 14.4	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

(2015年9月24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55期末	第61期末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ コンパティブル・ボンドーアジア通貨クラス	口 533,809	口 518,866	千円 4,535,926	% 99.2
合 計	533,809	518,866	4,535,926	99.2

\*比率は、純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 親投資信託残高

銘 柄	第55期末	第61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

(2015年9月24日現在)

項 目	第61期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	4,535,926	98.3
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	75,597	1.7
投資信託財産総額	4,612,527	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56期末	第57期末	第58期末	第59期末	第60期末	第61期末
	2015年4月20日現在	2015年5月20日現在	2015年6月22日現在	2015年7月21日現在	2015年8月20日現在	2015年9月24日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	5,319,271,395	5,338,411,714	5,372,694,091	5,351,502,695	5,071,936,054	4,612,527,610
コール・ローン等	80,564,569	91,352,715	85,307,885	71,615,176	95,875,946	58,528,738
投資信託受益証券(評価額)	5,237,702,064	5,246,054,208	5,286,381,327	5,256,920,760	4,975,055,104	4,535,926,572
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,004,627	1,004,627	1,004,726	1,004,824	1,004,824	1,004,923
未収入金	—	—	—	21,961,800	—	17,067,267
未収利息	135	164	153	135	180	110
(B) 負債	40,719,787	37,780,430	27,167,966	40,310,271	51,748,305	37,997,533
未払収益分配金	22,261,268	22,298,489	22,249,685	22,057,256	21,875,602	21,353,036
未払解約金	13,953,122	11,146,178	—	14,015,614	25,558,683	12,109,446
未払信託報酬	4,495,739	4,326,470	4,907,739	4,228,318	4,304,773	4,525,328
その他未払費用	9,658	9,293	10,542	9,083	9,247	9,723
(C) 純資産総額(A-B)	5,278,551,608	5,300,631,284	5,345,526,125	5,311,192,424	5,020,187,749	4,574,530,077
元本	4,452,253,786	4,459,697,988	4,449,937,071	4,411,451,363	4,375,120,459	4,270,607,323
次期繰越損益金	826,297,822	840,933,296	895,589,054	899,741,061	645,067,290	303,922,754
(D) 受益権総口数	4,452,253,786口	4,459,697,988口	4,449,937,071口	4,411,451,363口	4,375,120,459口	4,270,607,323口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,856円	11,886円	12,013円	12,040円	11,474円	10,712円

(注) 第56期首元本額4,478百万円、第56～第61期中追加設定元本額129百万円、第56～第61期中一部解約元本額337百万円、第61期末計算口数当たり純資産額10,712円。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額1,332,588円。

## ○損益の状況

項 目	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期
	2015年3月21日～ 2015年4月20日	2015年4月21日～ 2015年5月20日	2015年5月21日～ 2015年6月22日	2015年6月23日～ 2015年7月21日	2015年7月22日～ 2015年8月20日	2015年8月21日～ 2015年9月24日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	37,278,746	37,033,346	37,434,828	37,207,249	37,051,806	36,206,329
受取配当金	37,274,859	37,029,635	37,430,435	37,203,496	37,048,405	36,202,567
受取利息	3,887	3,711	4,393	3,753	3,401	3,762
(B) 有価証券売買損益	18,716,182	3,844,154	45,309,655	627,838	△258,085,926	△336,268,226
売買益	18,981,547	3,950,251	46,195,350	1,094,278	1,562,734	7,612,411
売買損	△ 265,365	△ 106,097	△ 885,695	△ 466,440	△259,648,660	△343,880,637
(C) 信託報酬等	△ 4,505,397	△ 4,335,763	△ 4,918,281	△ 4,237,401	△ 4,314,020	△ 4,535,051
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	51,489,531	36,541,737	77,826,202	33,597,686	△225,348,140	△304,596,948
(E) 前期繰越損益金	795,440,049	815,068,636	821,595,787	866,983,183	869,316,182	607,249,401
(F) 追加信託差損益金	1,629,510	11,621,412	18,416,750	21,217,448	22,974,850	22,623,337
(配当等相当額)	( 236,115,594)	( 248,136,812)	( 253,664,042)	( 254,256,356)	( 254,293,892)	( 248,663,777)
(売買損益相当額)	(△234,486,084)	(△236,515,400)	(△235,247,292)	(△233,038,908)	(△231,319,042)	(△226,040,440)
(G) 計(D+E+F)	848,559,090	863,231,785	917,838,739	921,798,317	666,942,892	325,275,790
(H) 収益分配金	△ 22,261,268	△ 22,298,489	△ 22,249,685	△ 22,057,256	△ 21,875,602	△ 21,353,036
次期繰越損益金(G+H)	826,297,822	840,933,296	895,589,054	899,741,061	645,067,290	303,922,754
追加信託差損益金	1,629,510	11,621,412	18,416,750	21,217,448	22,974,850	22,623,337
(配当等相当額)	( 236,115,595)	( 248,136,812)	( 253,664,048)	( 254,256,357)	( 254,293,892)	( 248,663,777)
(売買損益相当額)	(△234,486,085)	(△236,515,400)	(△235,247,298)	(△233,038,909)	(△231,319,042)	(△226,040,440)
分配準備積立金	824,668,312	829,311,884	877,172,304	878,523,613	880,178,723	869,358,834
繰越損益金	—	—	—	—	△258,086,283	△588,059,417

\* 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(2015年3月21日～2015年9月24日)は以下の通りです。

項 目	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期
	2015年3月21日～ 2015年4月20日	2015年4月21日～ 2015年5月20日	2015年5月21日～ 2015年6月22日	2015年6月23日～ 2015年7月21日	2015年7月22日～ 2015年8月20日	2015年8月21日～ 2015年9月24日
a. 配当等収益(経費控除後)	34,279,280円	33,105,335円	35,210,131円	33,040,609円	32,738,143円	31,671,657円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	17,210,251円	3,436,402円	42,616,071円	557,077円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	236,115,595円	248,136,812円	253,664,048円	254,256,357円	254,293,892円	248,663,777円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	795,440,049円	815,068,636円	821,595,787円	866,983,183円	869,316,182円	859,040,213円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,083,045,175円	1,099,747,185円	1,153,086,037円	1,154,837,226円	1,156,348,217円	1,139,375,647円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	2,432円	2,465円	2,591円	2,617円	2,642円	2,667円
g. 分配金	22,261,268円	22,298,489円	22,249,685円	22,057,256円	21,875,602円	21,353,036円
h. 分配金(1万円当たり)	50円	50円	50円	50円	50円	50円

## ○分配金のお知らせ

	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期
1万口当たり分配金(税込み)	50円	50円	50円	50円	50円	50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

運用の外部委託先である野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社(NFR&T)は、平成27年10月1日(予定)をもって、リテール運用関連事業を野村アセットマネジメント株式会社に承継します。これに伴い、同日以降は運用の外部委託を行わず、NFR&Tは投資信託証券の評価等をし、運用に関する助言を行い、それに基づき、野村アセットマネジメント株式会社が運用を行います。また、組織再編に関し、ファンドの投資方針には何ら変更はありません。

## ○(参考情報)親投資信託の組入資産の明細

(2015年9月24日現在)

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

下記は、野村マネー マザーファンド全体(21,756,200千口)の内容です。

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第61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	%	%	%	%	%
国債証券	1,180,000 (1,130,000)	1,180,005 (1,129,999)	5.3 (5.1)	— (—)	— (—)	— (—)	5.3 (5.1)
地方債証券	2,189,080 (2,189,080)	2,197,649 (2,197,649)	9.9 (9.9)	— (—)	— (—)	— (—)	9.9 (9.9)
特殊債券 (除く金融債)	3,674,000 (3,674,000)	3,687,987 (3,687,987)	16.6 (16.6)	— (—)	— (—)	— (—)	16.6 (16.6)
金融債券	1,600,000 (1,600,000)	1,603,509 (1,603,509)	7.2 (7.2)	— (—)	— (—)	— (—)	7.2 (7.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,500,000 (1,500,000)	1,507,383 (1,507,383)	6.8 (6.8)	— (—)	— (—)	— (—)	6.8 (6.8)
合 計	10,143,080 (10,093,080)	10,176,535 (10,126,529)	45.8 (45.6)	— (—)	— (—)	— (—)	45.8 (45.6)

\*( )内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*—印は組み入れなし。

\*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	柄	第61期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫短期証券 第541回		—	500,000	499,999	2015/9/28
国庫短期証券 第542回		—	200,000	199,999	2015/10/5
国庫短期証券 第546回		—	100,000	99,999	2015/10/19
国庫短期証券 第547回		—	300,000	299,999	2015/10/26
国庫短期証券 第548回		—	30,000	29,999	2015/11/2
国庫債券 利付(2年)第333回		0.1	50,000	50,005	2015/10/15
小	計		1,180,000	1,180,005	
<b>地方債証券</b>					
東京都 公募第636回		2.04	100,000	101,427	2016/6/20
北海道 公募平成17年度第12回		1.6	50,000	50,296	2016/2/24
神奈川県 公募第136回		1.5	90,000	90,306	2015/12/28
大阪府 公募第284回		1.6	300,000	300,780	2015/11/27
大阪府 公募(2年)第15回		0.096	50,000	50,000	2015/11/27
大阪府 公募(5年)第73回		0.51	102,000	102,290	2016/5/30
兵庫県 公募平成18年度第7回		2.1	80,000	81,346	2016/7/27
静岡県 公募平成17年度第5回		1.6	229,050	229,589	2015/11/25
新潟県 公募平成17年度第2回		1.6	255,780	256,370	2015/11/24
新潟県 公募平成18年度第1回		2.1	6,500	6,605	2016/7/27
共同発行市場地方債 公募第31回		1.5	50,000	50,055	2015/10/23
共同発行市場地方債 公募第32回		1.6	100,000	100,250	2015/11/25
共同発行市場地方債 公募第34回		1.4	200,000	200,877	2016/1/25
共同発行市場地方債 公募第35回		1.6	100,000	100,631	2016/2/25
神戸市 公募平成17年度第10回		1.6	307,700	308,409	2015/11/24
千葉市 公募平成17年度第2回		1.6	168,050	168,412	2015/11/20
小	計		2,189,080	2,197,649	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
阪神高速道路債券 政府保証第148回		1.3	20,000	20,004	2015/9/30
公営企業債券 政府保証第861回		1.6	29,000	29,213	2016/3/17
公営企業債券 政府保証第862回		1.8	117,000	118,142	2016/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証債第1回		1.5	100,000	100,359	2015/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3回		1.5	590,000	592,894	2016/1/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回		1.6	558,000	561,618	2016/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第11回		1.8	170,000	171,708	2016/4/26
首都高速道路債券 政府保証第1回		1.6	400,000	403,123	2016/3/28
中部国際空港債券 政府保証第17回		0.051	300,000	300,000	2016/3/7
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第119回		0.067	200,000	199,997	2015/12/18
地方公共団体金融機構債券 2年第1回		0.135	200,000	200,046	2016/2/26
阪神高速道路社債 財投機関債第6回		0.589	100,000	100,117	2015/12/18
中日本高速道路社債 財投機関債第37回		0.385	200,000	200,256	2016/2/26
中日本高速道路社債 第40回		0.298	300,000	300,310	2016/3/18
西日本高速道路 第17回		0.196	300,000	300,081	2015/12/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回		0.255	90,000	90,112	2016/6/20
小	計		3,674,000	3,687,987	
<b>金融債券</b>					
商工債券 利付第724回い号		0.5	320,000	320,018	2015/9/25

銘	柄	第61期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>		%	千円	千円	
商工債券	利付第733回い号	0.55	300,000	301,050	2016/6/27
商工債券	利付第734回い号	0.55	150,000	150,587	2016/7/27
農林債券	利付第724回い号	0.5	50,000	50,001	2015/9/25
農林債券	利付第731回い号	0.75	100,000	100,385	2016/4/27
農林債券	利付第733回い号	0.55	180,000	180,630	2016/6/27
商工債券	利付(3年)第152回	0.2	100,000	100,003	2015/9/25
商工債券	利付(3年)第153回	0.2	200,000	200,026	2015/10/27
商工債券	利付(3年)第161回	0.25	100,000	100,127	2016/6/27
商工債券	利付(10年)第2回	1.78	100,000	100,677	2016/2/19
小	計		1,600,000	1,603,509	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
みずほコーポレート銀行	第24回特定社債間限定同順位特約付	0.595	200,000	200,319	2016/1/20
みずほコーポレート銀行	第25回特定社債間限定同順位特約付	0.755	200,000	200,737	2016/4/20
トヨタファイナンス	第19回社債間限定同等特約付	2.04	200,000	201,841	2016/3/18
三菱UFJリース	第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	501,998	2016/4/22
三菱UFJリース	第22回社債間限定同順位特約付	0.235	100,000	100,053	2016/2/26
三井住友海上火災保険	第5回社債間限定同順位特約付	0.67	100,000	100,192	2016/1/27
三井不動産	第25回社債間限定同順位特約付	1.805	100,000	100,792	2016/3/16
東邦瓦斯	第30回社債間限定同順位特約付	2.07	100,000	101,446	2016/6/20
小	計		1,500,000	1,507,383	
合	計		10,143,080	10,176,535	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内その他有価証券

区 分	第61期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,399,128	% 10.8

\*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。



# 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

2014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>◆NFR&amp;Tが、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の運用を行なう運用会社を原則として複数選定します。</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。</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です。</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>●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、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)で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>●NFR&amp;T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>●NFR&amp;T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> <li>●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</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	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社
共 同 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 保 管 銀 行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー

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

◇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  
2014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		291,464,678
(取得原価 : 274,505,073 米ドル)		
投資オプション契約時価 (買い)		1,000,745
(取得原価 : 1,030,145 米ドル)		
現金預金等		19,378,567
オプション契約に係る証拠金		826,546
ブローカーからの受取金		3,262,215
未収収益		1,466,768
受益証券発行未収金		65,761
		<hr/>
資産合計		317,465,280
		<hr/>
負債		
投資オプション契約時価 (売り)		183,891
(取得原価 : 83,473 米ドル)		
銀行借越金		65,761
外国為替先渡し契約に係る評価差損		6,097,118
ブローカーへの未払金		2,021,278
未払費用		752,095
		<hr/>
負債合計		9,120,143
		<hr/>
純資産総額		308,345,137
		<hr/> <hr/>

## 受益証券一口当たり情報 :

	期末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)	10,069	249,205	2,509,346,662
アジア通貨クラス (円)	9,084	577,714	5,247,784,597
資源国通貨クラス (円)	8,308	3,115,553	25,883,330,923

## 運用計算書

2014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	885
債券利息	8,387,078
受取配当金等	1,331,672
雑収益	19
	<hr/>
収益合計	9,719,654
	<hr/>
費用	
投資顧問及び共同投資顧問報酬	2,589,045
事務管理代行報酬	308,886
保管費用	116,285
当座借越利息	109
取引銀行報酬	28,504
銀行手数料	34,380
受託報酬	77,288
法務報酬	1,094
海外登記手数料	34
立替費用	40,722
専門家報酬	69,206
	<hr/>
費用合計	3,265,553
	<hr/>
純投資収益	6,454,101
	<hr/>
投資有価証券売買に係る損益	38,310,660
オプション契約に係る損益	(586,868)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	11,917,056
	<hr/>
当期実現純損益	49,640,848
	<hr/>
投資有価証券評価損益の増減	(10,949,832)
オプション契約に係る評価損益の増減	14,774
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(17,948,843)
	<hr/>
当期評価差損益	(28,883,901)
	<hr/>
運用の結果による純資産の増減額	27,211,048
	<hr/> <hr/>

純資産変動計算書  
2014年9月20日に終了する計測期間  
(金額は米ドル表示)

期初純資産総額	507,641,271
純投資収益	6,454,101
当期実現純損益	49,640,848
当期評価差損益	(28,883,901)
運用の結果による純資産の増減額	27,211,048
受益証券の発行手取金	14,197,011
受益証券の買戻支払金	(204,008,947)
	(189,811,936)
受益者への支払分配金	(36,695,246)
期末純資産総額	308,345,137

発行済受益証券数の変動表  
2014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	519,214
発行受益証券数	48,649
買戻受益証券数	(318,658)
期末発行済受益証券数	249,205
アジア通貨クラス	
期首受益証券数	907,624
発行受益証券数	22,757
買戻受益証券数	(352,667)
期末発行済受益証券数	577,714
資源国通貨クラス	
期首受益証券数	4,870,249
発行受益証券数	100,617
買戻受益証券数	(1,855,313)
期末発行済受益証券数	3,115,553

統計情報  
2014年9月20日現在  
(未監査)

	2014	2013	2012
期末純資産総額 (米ドル)	308,345,137	507,641,271	1,441,426,102
日本円クラス (円)			
期末純資産総額	2,509,346,662	4,935,052,393	9,944,202,180
期末1口当たり純資産価格	10,069	9,505	8,747
アジア通貨クラス (円)			
期末純資産総額	5,247,784,597	7,246,365,477	15,550,213,806
期末1口当たり純資産価格	9,084	7,984	6,592
資源国通貨クラス (円)			
期末純資産総額	25,883,330,923	38,196,919,167	87,239,551,193
期末1口当たり純資産価格	8,308	7,843	6,698

組入資産明細  
2014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	組入比率 (%)
<b>オーストラリア</b>					
<b>転換社債</b>					
AUD	2,278,000	CFS RETAIL PROP CV 5.75% 04/7/16 EM	2,393,598	2,132,765	0.70
AUD	750,000	WESTERN AREAS CV 6.4% 02/07/15	657,233	688,079	0.22
USD	450,000	PALADIN ENERGY CV 3.625% 04/11/15	391,500	411,750	0.13
			3,442,331	3,232,594	1.05
		合計： オーストラリア	3,442,331	3,232,594	1.05
<b>オーストリア</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	476,500	IMMOFINANZ CV 4.25% 08/03/18	2,748,943	2,703,341	0.88
EUR	550,000	STEINHOFF FIN HLDG CV 4.5% 31/03/18	760,383	959,901	0.31
EUR	500,000	CONWERT IMM INV CV 5.25% 1/2/16 CWI	680,211	672,749	0.22
EUR	300,000	CONWERT IMMO INV CV 4.5% 06/09/18	376,170	411,133	0.13
EUR	200,000	STEINHOFF FIN CV 6.375% 26/5/17 SHF	260,160	347,541	0.11
			4,825,867	5,094,665	1.65
		合計： オーストリア	4,825,867	5,094,665	1.65
<b>ベルギー</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	600,000	BEKAERT NV CV 0.75% 18/06/18 BEKB	814,825	766,963	0.25
EUR	6,269	ECONOCOM GRP CV 1.5% 15/01/19 EBAB	90,593	91,990	0.03
			905,418	858,953	0.28
<b>変動金利債</b>					
EUR	2,000,000	FORTIS BANK CV FRN 19/12/49 CASH	1,326,326	2,001,328	0.65
			1,326,326	2,001,328	0.65
		合計： ベルギー	2,231,744	2,860,281	0.93
<b>バミューダ諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	1,137,000	ENERGY XXI BERM CV 3% 15/12/18 144A	1,097,579	969,589	0.31
USD	600,000	JAZZ INV I CV 1.875% 15/8/21 144A	657,504	672,468	0.22
HKD	4,000,000	REXLOT HLDG CV 4.5% 17/04/19	515,854	510,887	0.17
USD	300,000	SHIP FINANCE INTL 3.75% 10/02/16	291,226	326,931	0.11
USD	600,000	AFRICAN MINERALS CV 8.5% 10/02/17	610,068	210,000	0.07
USD	200,000	BW GROUP LTD CV 1.75% 10/09/19	200,000	209,146	0.07
USD	140,000	SHIP FIN INTL 3.25% 01/02/18	140,000	160,059	0.05
			3,512,231	3,059,080	1.00

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	組入比率 (%)
<b>優先証券</b>					
--	22,818	MAIDEN HDGS PFD 7.25% 15/09/16 B	1,147,406	1,070,392	0.34
--	2,400	BUNGE LTD CV PFD 4.875% 31/12/49	205,263	264,480	0.09
		合計： バミューダ諸島	1,352,669	1,334,872	0.43
			4,864,900	4,393,952	1.43
<b>英領ヴァージン諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	1,400,000	BILLION EXPRESS CV 0.75% 18/10/15	1,509,913	1,448,300	0.47
HKD	8,000,000	SHIN POWER INTL CV 0% 28/07/19	1,032,046	1,014,033	0.33
USD	800,000	NEWFORD CAPITAL CV 0% 12/05/16	827,000	852,000	0.28
HKD	5,000,000	FOSUN/LOGO STAR CV 1.5% 22/11/18	641,097	721,692	0.23
USD	450,000	PB ISSUER NO 2 LTD CV 1.75% 12/4/16	477,000	444,600	0.14
		合計： 英領ヴァージン諸島	4,487,056	4,480,625	1.45
			4,487,056	4,480,625	1.45
<b>カナダ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	400,000	JUST NRG GRP CV 6.5% 29/07/19 JECN	400,000	376,000	0.12
		合計： カナダ	400,000	376,000	0.12
			400,000	376,000	0.12
<b>ケイマン諸島</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	2,600,000	SIEM INDUSTRIES CV 1% 12/09/19 SUBC	2,647,829	2,479,751	0.81
USD	1,800,000	CHINA OVS CV 0% 04/02/21 COLI	1,797,200	1,892,610	0.61
HKD	11,000,000	HENGAN INTL GROUP CV 0% 27/06/18	1,416,936	1,450,876	0.47
HKD	10,000,000	BIOSTIME CV 0% 20/02/19	1,233,059	1,190,096	0.39
HKD	10,000,000	KINGSOFT CORP CV 1.25% 11/04/19	1,259,791	1,187,889	0.39
HKD	8,000,000	SHENZHO INTL CV 0.5% 18/06/19	1,031,669	1,014,033	0.33
USD	742,000	VIPSHOP HDG CV 1.5% 15/03/19	756,656	925,578	0.30
CNY	5,000,000	FUFENG GROUP CV 3% 27/11/18	813,861	897,032	0.29
USD	723,000	VANTAGE DRILL CV 5.5% 15/07/43 144A	747,766	741,798	0.24
CNY	4,000,000	CHINA YONGDA AUTO CV 1.5% 18/07/19	648,686	639,620	0.21
USD	600,000	BES FINANCE CV 3.5% 06/12/15	600,218	628,218	0.20
USD	500,000	ENN ENERGY HDGS CV 0% 26/02/18	559,375	608,795	0.20
USD	518,000	CTRIPO.COM INT CV 1.25% 15/10/18 144	591,094	562,631	0.18
USD	500,000	HAITIAN INTL CV 2% 13/02/19	490,000	507,750	0.16
USD	300,000	TAL EDUCATION CV 2.5% 15/05/19 144A	309,377	445,254	0.14
USD	400,000	QIHOO 360 TECH CV 2.5% 15/09/18 144	457,251	419,000	0.14
USD	300,000	POLARCUS LTD CV 2.875% 27/04/16	249,008	280,800	0.09
HKD	2,000,000	ASM PACIFIC CV 2% 28/03/19	257,719	269,944	0.09
USD	200,000	AYC FINANCE CV 0.5% 02/05/19	200,000	216,800	0.07
USD	200,000	QIHOO 360 TECH CV 2.5% 15/09/18 REG	229,000	209,500	0.07
USD	100,000	ZHEN DING TECH CV 0% 26/06/19	100,000	102,000	0.03
		合計： ケイマン諸島	16,396,495	16,669,975	5.41
			16,396,495	16,669,975	5.41

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	組入比率 (%)
<b>キプロス</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	2,000,000	HOLDGROVE LTD CV 1% 24/09/17	1,988,232	1,997,700	0.65
			1,988,232	1,997,700	0.65
		合計： キプロス	1,988,232	1,997,700	0.65
<b>フィンランド</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	500,000	NOKIA OYJ CV 5% 26/10/17 REGS	1,165,098	1,814,408	0.59
EUR	100,000	SOLIDIUM OY CV 0% 04/09/18	137,370	133,267	0.04
			1,302,468	1,947,675	0.63
		合計： フィンランド	1,302,468	1,947,675	0.63
<b>フランス</b>					
<b>転換社債</b>					
--	8,300	AXA SA CV 3.75% 01/01/17 CS	2,902,468	3,006,032	0.97
--	24,450	NEXANS SA CV 2.5% 01/01/19 EMTN	2,311,549	2,326,380	0.75
--	55,000	PEUGEOT SA CV 4.45% 01/01/16 UG	2,310,606	1,880,281	0.61
--	11,000	FONCIERE REGIONS CV 3.34% 01/01/17	1,368,927	1,311,801	0.43
--	15,629	ORPEA CV 1.75% 01/01/20 ORP	968,118	1,198,163	0.39
--	245,200	ALCATEL LUCENT CV 0.125% 30/01/20 A	1,321,742	1,194,810	0.39
--	2,984	UNIBAIL RODAMCO CV 0% 01/07/21 ULNA	1,144,971	1,096,802	0.36
--	46,358	MAUREL & PROM CV 1.625% 01/7/19 MAU	1,104,466	1,036,838	0.34
--	134,900	ALCATEL LUCENT CV 0% 30/01/19 ALU	734,703	679,947	0.22
--	43,500	AIR FRANCE KLM CV 2.03% 15/2/23 AFF	641,927	653,284	0.21
--	13,418	PIERRE ET VACANC CV 3.5% 1/10/19 VA	660,407	636,362	0.21
--	4,325	RALLYE SA CV 1% 02/10/20 COFP	676,590	629,681	0.20
--	4,000	TECHNIP CV 0.25% 01/01/17 TEC	516,003	502,594	0.16
--	7,300	NEXITY CV 0.625% 19/12/19	430,779	406,371	0.13
--	1,700	MISARTE CV 3.25% 01/01/16 PP	381,293	385,699	0.13
--	4,000	CREDIT AGRICOLE CV 0% 06/12/16 EMTN	374,299	373,530	0.12
--	900	UNIBAIL RODAMCO CV 0.75% 01/01/18	248,768	293,377	0.10
--	2,600	FONCIERE REGIONS CV 0.875% 01/04/19	295,138	291,762	0.09
--	3,400	TEM CV 4.25% 01/01/15 DG	255,485	228,395	0.07
--	100,000	BNP PARIBAS CV 0.25% 21/09/15	152,069	139,481	0.05
--	1,200	NEOPOST SA CV 3.75% 01/02/15	143,207	131,844	0.04
--	700	GECINA SA CV 2.125% 01/01/16 GFC	116,849	127,189	0.04
			19,060,364	18,530,623	6.01
		合計： フランス	19,060,364	18,530,623	6.01
<b>ドイツ</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	10,700	TUI AG CV 2.75% 24/03/16	825,892	953,536	0.30
EUR	700,000	DEUTSCHE WOHNEN CV 0.5% 22/11/20	951,876	952,867	0.31
EUR	500,000	SGL CARBON CV 2.75% 25/01/18	626,994	613,657	0.20
EUR	400,000	FRESENIUS MED CV 1.125% 31/1/20 FME	517,680	516,413	0.17
EUR	300,000	DEUTSCHE POST CV 0.6% 06/12/19 DPW	415,606	515,186	0.17
EUR	300,000	LEG IMMOBILIEN CV 0.5% 01/07/21 LEG	418,831	419,347	0.14
EUR	300,000	FRESENIUS SE CV 0% 24/09/19	432,008	398,204	0.13



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	組入比率 (%)
EUR	26,700	TAG IMMO AG CV 6.5% 10/12/15	261,299	318,375	0.10
EUR	200,000	ADIDAS AG CV 0.25% 14/06/19 ADS	265,821	279,980	0.09
EUR	100,000	RAG STIFTUNG CV 0% 31/12/18 EVK	137,107	128,265	0.04
			4,853,114	5,095,830	1.65
		合計： ドイツ	4,853,114	5,095,830	1.65
		<b>香港</b>			
<b>転換社債</b>					
USD	250,000	ASIA VIEW LTD CV 1.5% 08/08/19	250,000	244,550	0.08
USD	200,000	HKEX INTERNATIONAL CV 0.5% 23/10/17	232,060	243,500	0.08
			482,060	488,050	0.16
		合計： 香港	482,060	488,050	0.16
		<b>ハンガリー</b>			
<b>転換社債</b>					
EUR	900,000	MNV ZRT 3.375% 02/04/19 RICH	1,230,506	1,207,758	0.39
			1,230,506	1,207,758	0.39
		合計： ハンガリー	1,230,506	1,207,758	0.39
		<b>インド</b>			
<b>転換社債</b>					
USD	820,000	STERLITE IND CV 4% 30/10/14	807,410	817,287	0.26
USD	600,000	TATA POWER CV 1.75% 21/11/14	651,379	651,450	0.21
USD	600,000	LARSEN&TOURBO LTD CV 3.5% 22/10/14	601,230	604,800	0.20
USD	550,000	SINTEX INDS CV 7.5% 28/11/17 SINT	550,000	561,000	0.18
USD	400,000	JAIPRAKASH POWER CV 5% 13/02/15	418,337	427,504	0.14
			3,028,356	3,062,041	0.99
		合計： インド	3,028,356	3,062,041	0.99
		<b>イタリア</b>			
<b>転換社債</b>					
EUR	600,000	BENI STABILI CV 2.625% 17/04/19 BNS	813,678	843,535	0.27
EUR	600,000	BUZZI UNICEM CV 1.375% 17/07/19 BZU	771,720	835,793	0.27
EUR	400,000	PRYSMIAN SPA CV 1.25% 08/03/18 PRY	521,480	530,903	0.17
EUR	200,000	ASTALDI SPA CV 4.5% 31/01/19	268,982	302,939	0.10
EUR	200,000	SCHEMATRENTA CV 0.25% 29/11/16 PCIM	291,342	265,477	0.09
EUR	100,000	SOGEFI CV 2% 21/05/21 LOC	137,190	130,617	0.04
EUR	100,000	SAFILO GROUP SA CV 1.25% 22/05/19 S	137,170	117,643	0.04
			2,941,562	3,026,907	0.98
		合計： イタリア	2,941,562	3,026,907	0.98
		<b>ジャージー</b>			
<b>転換社債</b>					
GBP	1,200,000	INTU JERSEY LTD CV 2.5% 04/10/18	1,998,459	2,153,156	0.71
GBP	600,000	BRITISH LAND INTL CV 1.5% 10/09/17	953,520	1,107,506	0.36
GBP	400,000	GREAT PORTLAND CV 1% 10/09/18 GPOR	622,320	698,601	0.23
GBP	400,000	DERWENT LNDN CV 1.125% 24/07/19 DLN	610,626	692,027	0.22
GBP	400,000	PHP FIN JERSEY CV 4.25% 20/05/19	675,200	660,532	0.21

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	組入比率 (%)
GBP	400,000	ST MODWEN PROP CV 2.875% 6/3/19	667,080	655,136	0.21
USD	500,000	PREMIER OIL CV 2.5% 27/07/18 PMO	571,446	561,300	0.18
EUR	300,000	GABRIEL FINANCE LTD CV 2% 26/11/16	400,472	375,341	0.12
GBP	200,000	BALFOUR BEATTY CV 1.875% 03/12/18 B	322,992	318,346	0.10
			6,822,115	7,221,945	2.34
<b>変動金利債</b>					
EUR	800,000	MAGNOLIA FIN CV FRN 29/03/49	893,288	1,006,529	0.33
			893,288	1,006,529	0.33
		合計： ジャージー	7,715,403	8,228,474	2.67
<b>ルクセンブルグ</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	1,700,000	KLOECKNER & CO FIN 2.5% 22/12/17 KC	2,282,793	2,184,896	0.70
USD	1,000,000	TMK BONDS SA CV 5.25% 11/02/15	1,047,501	991,500	0.31
EUR	600,000	GBL VERWALTUNG CV 1.25% 07/2/17 GSZ	872,157	881,288	0.29
EUR	540,280	CONTROLINVESTE CV 3% 28/01/15 PTC	686,878	694,734	0.23
USD	600,000	SUBSEA 7 SA CV 1% 05/10/17 SUBC	627,840	569,400	0.18
EUR	300,000	FF GROUP FIN 1.75% 03/07/19 FFGR	407,329	388,470	0.13
USD	300,000	GLENCORE FIN CV 5% 31/12/14	359,364	338,466	0.11
EUR	200,000	GAGFAH SA CV 1.5% 20/05/19	275,200	293,556	0.10
USD	200,000	APERAM CV 0.625% 08/07/21 APAM	200,200	203,100	0.07
			6,759,262	6,545,410	2.12
<b>変動金利債</b>					
EUR	2,000,000	AGEASFINLUX SA CV FRN 07/11/49	1,659,694	1,724,558	0.56
EUR	500,000	OPUS SECURITIES CV FRN 29/10/49 OTP	371,924	547,623	0.18
			2,031,618	2,272,181	0.74
<b>優先証券</b>					
--	67,641	ARCELORMITTAL PFD CV 6% 15/01/16 MT	1,712,981	1,544,920	0.50
--	22,038	INTELSAT SA SFPVD 5.75% 01/05/16	1,230,484	1,024,767	0.33
			2,943,465	2,569,687	0.83
		合計： ルクセンブルグ	11,734,345	11,387,278	3.69
<b>マレーシア</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	200,000	CAHAYA CAPITAL CV 0% 18/09/21	200,000	198,750	0.06
			200,000	198,750	0.06
		合計： マレーシア	200,000	198,750	0.06
<b>メキシコ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	500,000	CEMEX SAB DE CV 4.875% 15/3/15	488,189	613,130	0.20
			488,189	613,130	0.20
		合計： メキシコ	488,189	613,130	0.20

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	組入比率 (%)
<b>オランダ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	3,400,000	LUKOIL INTL FIN CV 2.625% 16/06/15	3,585,767	3,345,362	1.07
EUR	1,200,000	ACS ACTIVIDA CV 2.625% 22/10/18 IBE	1,674,890	1,688,927	0.54
USD	1,000,000	SIEMENS FINAN CV 1.65% 16/08/19 WW	1,008,322	1,131,190	0.37
EUR	700,000	AMORIM ENERGIA CV 3.375% 3/6/18 GAL	912,699	986,877	0.32
USD	1,000,000	STMICROELECTRO CV 0% 03/07/19 STM	986,300	942,630	0.31
EUR	700,000	ACS ACTIVIDA CV 1.625% 27/03/19 IBE	973,112	934,494	0.30
EUR	700,000	SONAE INVEST CV 1.625% 11/06/19 SON	927,099	888,880	0.29
USD	800,000	QIAGEN NV CV 0.375% 19/03/19	819,540	827,288	0.27
EUR	600,000	VASTNED RETAIL CV 1.875% 10/04/19 V	825,480	775,780	0.25
USD	500,000	SIEMENS FINAN CV 1.05% 16/08/17 WW	578,750	545,745	0.18
USD	523,000	YANDEX NV CV 1.125% 15/12/18 144A	552,464	480,152	0.16
USD	400,000	QIAGEN NV CV 0.875% 19/03/21 QGEN	400,000	424,356	0.14
USD	400,000	STMICROELECTRONICS 1% 03/07/21 STMI	395,016	387,024	0.13
EUR	200,000	SALZGITTER FIN CV 2% 08/11/17	291,061	282,834	0.09
EUR	200,000	WERELDHAVE NV CV 1% 22/05/19	274,340	264,758	0.09
			14,204,840	13,906,297	4.51
		合計： オランダ	14,204,840	13,906,297	4.51
<b>ノルウェー</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	100,000	MARINE HARVEST CV 0.875% 6/5/19 MHG	138,250	146,442	0.05
			138,250	146,442	0.05
		合計： ノルウェー	138,250	146,442	0.05
<b>ポルトガル</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	2,100,000	PARPUBLICA CV 5.25% 28/09/17 GALP	2,910,138	3,083,128	1.00
			2,910,138	3,083,128	1.00
		合計： ポルトガル	2,910,138	3,083,128	1.00
<b>韓国</b>					
<b>転換社債</b>					
KRW	1,800,000,000	LOTTE SHOPPING CV 0% 24/01/18 LOTT	1,698,205	1,771,200	0.57
USD	400,000	SK HYNIX INC CV 2.65% 14/05/15	422,714	552,824	0.18
USD	400,000	WISTRON CORP CV 0% 19/01/15	428,750	417,748	0.14
			2,549,669	2,741,772	0.89
		合計： 韓国	2,549,669	2,741,772	0.89
<b>シンガポール</b>					
<b>転換社債</b>					
SGD	2,500,000	CAPITALAND CV 2.95% 20/06/22	1,920,464	1,978,408	0.64
SGD	1,750,000	CAPITALAND LTD CV 1.85% 19/06/20	1,380,230	1,319,391	0.43
USD	700,000	OLAM INTERN CV 6% 15/10/16	865,976	774,375	0.25
SGD	500,000	RUBY ASSETS PTE CV 1.6% 01/02/17	413,425	441,762	0.14
			4,580,095	4,513,936	1.46
		合計： シンガポール	4,580,095	4,513,936	1.46

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	組入比率 (%)
<b>南アフリカ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	600,000	IMPALA PLAT HDGS CV 1% 21/2/18 IMP	516,390	513,150	0.17
			516,390	513,150	0.17
		合計： 南アフリカ	516,390	513,150	0.17
<b>スペイン</b>					
<b>転換社債</b>					
EUR	1,650,000	ABENGOA SA CV 4.5% 03/02/17	2,134,401	2,354,393	0.76
EUR	1,100,000	CAJA AHORROS BARC CV 1% 25/11/17 CA	1,480,242	1,668,984	0.54
EUR	700,000	MELIA HOTELS CV 4.5% 04/04/18	939,514	1,165,636	0.38
EUR	500,000	OHL INVEST CV 4% 25/04/18 OHL	664,008	698,209	0.23
EUR	400,000	INTL CONSOLID CV 1.75% 31/05/18	645,435	676,520	0.22
EUR	450,000	SOL MELIA CV 5% 18/12/14	627,370	622,587	0.20
EUR	250,000	SACYR VALLEHERM CV 6.5% 01/05/16 EM	353,612	325,101	0.11
EUR	200,000	NH HOTELES SA CV 4% 08/11/18	274,120	290,434	0.09
EUR	200,000	INDRA SISTEMAS 1.75% 17/10/18 IDR	276,230	273,470	0.09
			7,394,932	8,075,334	2.62
		合計： スペイン	7,394,932	8,075,334	2.62
<b>スウェーデン</b>					
<b>転換社債</b>					
SEK	2,000,000	AB INDUSTRIVARDEN CV 0% 15/05/19	307,616	281,402	0.09
			307,616	281,402	0.09
		合計： スウェーデン	307,616	281,402	0.09
<b>スイス</b>					
<b>転換社債</b>					
CHF	105,000	SWISS LIFE HLDG CV 0% 02/12/20 SLHN	114,516	128,296	0.04
			114,516	128,296	0.04
		合計： スイス	114,516	128,296	0.04
<b>台湾</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	3,300,000	AU OPTRONICS CORP CV 0% 13/10/15	3,012,465	3,648,546	1.19
USD	400,000	ADVANCED SEMICONDU CV 0% 05/09/18	419,500	491,340	0.16
USD	400,000	EPISTAR CORP CV 0% 07/08/18	400,000	440,176	0.14
			3,831,965	4,580,062	1.49
		合計： 台湾	3,831,965	4,580,062	1.49
<b>タイ</b>					
<b>転換社債</b>					
USD	600,000	CP FOODS HLD CV 0.5% 15/01/19	600,000	617,754	0.20
			600,000	617,754	0.20
		合計： タイ	600,000	617,754	0.20

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	組入比率 (%)	
<b>アラブ首長国連邦</b>						
<b>転換社債</b>						
EUR	2,600,000	AABAR INVEST CV 4% 27/05/16	REGs	3,656,282	3,859,269	1.25
USD	1,400,000	DP WORLD LTD CV 1.75% 19/06/24		1,405,850	1,498,112	0.49
				5,062,132	5,357,381	1.74
		合計： アラブ首長国連邦		5,062,132	5,357,381	1.74
<b>イギリス</b>						
<b>転換社債</b>						
USD	2,100,000	VEDANTA RES JERSEY CV 5.5% 13/07/16		2,226,384	2,142,000	0.70
GBP	400,000	SVG CAPITAL CV 8.25% 05/06/16		597,823	715,083	0.23
USD	500,000	INMARSAT PLC CV 1.75% 16/11/17 ISAT		582,656	687,485	0.22
USD	600,000	HOCHSCHILD MINING CV 5.75% 20/10/14		625,500	603,096	0.20
USD	600,000	SALAMANDER ENERGY CV 5% 30/03/15		616,616	598,950	0.19
GBP	200,000	TUI TRAVEL PLC CV 4.9% 27/04/17		375,296	389,426	0.13
				5,024,275	5,136,040	1.67
		合計： イギリス		5,024,275	5,136,040	1.67
<b>アメリカ</b>						
<b>転換社債</b>						
USD	1,045,000	GILEAD SCIENCES CV 1.625% 01/05/16		2,677,991	4,848,256	1.58
USD	2,828,000	SANDISK CORP CV 0.5% 15/10/20 144A		2,987,763	3,507,992	1.15
USD	2,644,000	MICRON TECHNO CV 3% 15/11/43 G		2,536,390	3,366,657	1.09
USD	2,936,000	YAHOO CV 0% 01/12/18 144A		2,965,194	3,068,590	1.00
USD	2,270,000	LAM RESEARCH CORP CV 0.5% 15/05/16		2,547,852	2,967,639	0.96
USD	2,451,000	PRICELINE GRP CV 0.35% 15/6/20		2,476,865	2,799,189	0.91
USD	1,922,000	LIBERTY INTERACT CV 0.75% 30/3/43		1,991,111	2,659,029	0.86
USD	2,244,000	CITRIC SYSTEMS CV 0.5% 15/04/19 144		2,308,155	2,461,623	0.80
USD	1,774,000	INTEL CORP CV 2.95% 15/12/35		1,799,356	2,271,465	0.74
USD	1,300,000	WELLPOINT INC CV 2.75% 15/10/42		1,433,337	2,190,448	0.71
USD	2,150,000	ANNALY CAPITAL CV 5% 15/05/15		2,171,654	2,167,050	0.70
USD	2,032,000	ARES CAPITAL CV 4.875% 15/3/17		2,031,999	2,141,220	0.69
USD	2,000,000	ARES CAP CORP CV 5.125% 01/06/16		2,074,842	2,101,500	0.68
USD	1,977,000	SUNEDISON CV 0.25% 15/01/20 144A		2,127,119	2,017,351	0.65
USD	1,682,000	NUVASIVE INC CV 2.75% 01/07/17		1,691,917	1,935,646	0.63
USD	1,708,000	SALESFORCE CV 0.25% 01/04/18		1,742,682	1,921,910	0.62
USD	1,481,000	MGM RESORTS MIRAGE CV 4.25% 15/4/15		1,673,787	1,919,183	0.62
USD	1,882,000	REDWOOD TRUST INC CV 4.625% 15/4/18		1,911,382	1,889,848	0.61
USD	789,000	NOVELLUS SYSTEMS CV 2.625% 15/5/41		1,315,145	1,774,374	0.58
USD	487,000	MYLAN CV 3.75% 15/09/15		1,278,386	1,769,943	0.57
USD	904,000	MICROCHIP TECH CV 2.125% 15/12/37		1,181,818	1,743,762	0.57
USD	1,600,000	GOLDEN AGRI RES CV 2.5% 04/10/17		1,600,000	1,563,664	0.51
USD	1,519,000	AKAMAI TECH CV 0% 15/02/19 144A		1,513,547	1,563,218	0.51
USD	1,353,000	ILLUMINA INC CV 0% 15/06/19 144A		1,379,087	1,424,587	0.46
USD	843,000	INTEL CORP CV 3.25% 01/08/39 144A		1,168,385	1,421,795	0.46
USD	835,000	VERISIGN INC CV 3.25% 15/08/37		1,053,946	1,420,226	0.46
USD	1,433,000	PROSPECT CAP CORP CV 4.75% 15/4/20		1,424,508	1,390,812	0.45
USD	1,267,000	BGC PARTNERS CV 4.5% 15/07/16		1,301,424	1,343,907	0.44
USD	1,294,000	TESLA MOTORS CV 1.25% 01/03/21		1,233,428	1,293,347	0.42
USD	1,198,000	ARVINMERITOR 4% 15/02/27		1,053,490	1,277,188	0.41

## 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	組入比率 (%)
USD	591,000	SANDISK CORP CV 1.5% 15/08/17	626,615	1,196,497	0.39
USD	1,050,000	NVIDIA CORP CV 1% 01/12/18 144A	1,049,881	1,185,461	0.38
USD	1,099,000	BLACKSTONE MTG CV 5.25% 01/12/18	1,126,816	1,163,797	0.38
USD	1,140,000	CARDTRONICS INC CV 1% 01/12/20 144A	1,062,248	1,092,511	0.35
USD	967,000	MERCADOLIBRE CV 2.25% 01/07/19 144A	979,302	1,082,508	0.35
USD	1,078,000	CAMPUS CREST CV 4.75% 15/10/18 144A	1,086,293	1,056,063	0.34
USD	995,000	FOREST CITY CV 3.625% 15/08/20	991,784	1,048,034	0.34
USD	1,000,000	OMNICARE INC CV 3.25% 15/12/35 OCR	1,076,250	1,046,340	0.34
USD	959,000	BIOMARIN PHARMA CV 1.5% 15/10/20	963,269	1,046,192	0.34
USD	973,000	LIBERTY INTERACT CV 1% 30/9/43 144A	989,275	1,010,597	0.33
USD	409,000	SALIX PHARMA CV 1.5% 15/03/19	431,211	1,009,678	0.33
USD	1,035,000	IAS OPER PARTNER CV 5% 15/3/18 144A	980,708	1,006,496	0.33
USD	973,000	CHESAPEAKE ENERGY CV 2.5% 15/05/37	1,022,921	989,833	0.32
USD	620,000	XILINX INC CV 2.625% 15/06/17	1,052,531	959,741	0.31
USD	858,000	MACQUARIE INFRA CV 2.875% 15/07/19	863,100	955,452	0.31
USD	935,000	LIBERTY MEDIA CV 1.375% 15/10/23 14	960,438	938,544	0.30
USD	746,000	CIENA CORP CV 3.75% 15/10/18 144A	866,634	936,402	0.30
USD	935,000	TESLA MOTORS CV 0.25% 01/03/19	927,534	929,694	0.30
USD	500,000	LENNAR CORP CV 3.25% 15/11/21 144A	847,149	904,405	0.29
USD	1,114,000	ALASKA COMM SYS CV 6.25% 01/05/18	1,106,326	894,364	0.29
USD	1,236,000	PEABODY ENERGY CV 4.75% 15/12/41	1,515,073	869,938	0.28
USD	640,000	JARDEN CORP CV 1.5% 15/06/19	668,800	771,462	0.25
USD	721,000	PROSPECT CAPITAL CV 5.75% 15/03/18	720,267	744,072	0.24
USD	695,000	JARDEN CORP CV 1.125% 15/03/34 144A	695,000	717,045	0.23
USD	630,000	VECTOR GROUP LTD CV STEP 15/04/20	666,187	705,266	0.23
USD	639,000	STARWOOD PROPERTY CV 4.55% 01/03/18	639,912	698,791	0.23
USD	813,000	COBALT INTL CV 2.625% 01/12/19	832,472	698,164	0.23
USD	595,000	INFINERA CORP CV 1.75% 01/06/18	620,409	696,275	0.23
USD	304,000	GAYLORD ENT CV 3.75% 01/10/14 144A	383,263	693,692	0.22
USD	620,000	SYNCHRONOSS TECH CV 0.75% 15/08/19	628,138	688,188	0.22
USD	730,000	GAIN CAPITAL CV 4.125% 01/12/18 144	730,000	687,916	0.22
USD	911,000	TITAN MACHINE CV 3.75% 01/05/19	839,295	687,295	0.22
USD	259,000	EQUINIX INC CV 4.75% 15/06/16	602,515	686,176	0.22
USD	630,000	ARES CAPITAL CV 5.75% 01/02/16	636,813	664,020	0.22
USD	645,000	J2 GLOBAL COMM CV 3.25% 15/6/29	653,769	654,991	0.21
USD	616,000	BIOMARIN PHARMA CV 0.75% 15/10/18	629,767	650,274	0.21
USD	656,000	SPIRIT REALTY CAP CV 3.75% 15/05/21	663,697	647,575	0.21
USD	625,000	SPECTRUM PHARM CV 2.75% 15/12/18 14	625,000	647,213	0.21
USD	167,000	SBA COMMUNICATION CV 4% 01/10/14	234,176	620,113	0.20
USD	511,000	CONCUR TECHNO CV 0.5% 15/06/18	559,954	609,771	0.20
USD	580,000	APOLLO INVEST CV 5.75% 15/1/16	571,886	605,914	0.20
USD	600,000	SPIRIT REALTY CAP CV 2.875% 15/5/19	601,226	590,586	0.19
USD	305,000	FORD MOTOR CO CV 4.25% 15/11/16	561,290	588,055	0.19
USD	429,000	ICONIX BRAND CV 1.50% 15/03/18	429,000	587,172	0.19
USD	540,000	CUBIST PHARMA CV 1.125% 01/09/18	576,969	585,760	0.19
USD	542,000	NEW MOUNTAIN CV 5% 15/06/19 144A	543,480	554,818	0.18
USD	400,000	PRICELINE GRP INC CV 1% 15/3/18	563,984	552,500	0.18
USD	469,000	ENCORE CAP GP CV 3% 01/07/20	463,298	544,063	0.18
USD	521,000	JDS UNIPHASE CV 0.625% 15/08/33	540,013	537,875	0.17
USD	520,000	AMERICAN REALTY CV 3.75% 15/12/20	561,098	529,729	0.17
USD	374,000	MGIC INVESTMENT CORP CV 2% 01/04/20	498,021	521,023	0.17

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	組入比率 (%)
USD	420,000	MOLINA HEALTH CV 1.125% 15/1/20	420,000	514,920	0.17
USD	500,000	PROSPECT CAP CV 5.375% 15/10/17	516,875	514,100	0.17
USD	485,000	ELECTRONIC IMAGING CV 0.75% 1/9/19	485,000	502,208	0.16
USD	464,000	SERVICENOW INC CV 0% 01/11/18 144A	475,130	500,730	0.16
USD	230,000	ILLUMINA INC CV 0.25% 15/03/16	201,754	492,655	0.16
USD	483,000	HURON CONSULT CV 1.25% 1/10/19 144A	483,000	482,469	0.16
USD	431,000	ILLUMINA INC CV 0.5% 15/06/21	436,460	468,531	0.15
USD	316,000	VECTOR GROUP LTD CV 2.5% 15/01/19	316,000	463,572	0.15
USD	410,000	PROSPECT CAP CV 5.875% 15/01/19	418,547	423,116	0.14
USD	373,000	PORTFOLIO REC ASS CV 3% 1/8/20 144A	404,129	422,837	0.14
USD	263,000	SUNEDISON CV 2% 01/10/18 144A	321,157	422,615	0.14
USD	400,000	ARES CAP CORP CV 4.375% 15/1/19	428,000	415,500	0.13
USD	299,000	AUXILIUM PHARMA CV 1.5% 15/07/18	318,510	407,214	0.13
USD	413,000	TWITTER INC CV 0.25% 15/09/19 144A	413,000	403,212	0.13
USD	400,000	COBALT INTL CV 3.125% 15/05/24	431,000	380,000	0.12
USD	368,000	HOMEAWAY INC CV 0.125% 01/04/19 144	376,196	356,868	0.12
USD	349,000	NETSUITE INC CV 0.25% 01/06/18	361,112	356,332	0.12
USD	337,000	PROLOGIS CV 3.25% 15/03/15	386,701	355,414	0.12
USD	362,000	TWITTER INC CV 1% 15/09/21 144A	362,000	355,117	0.12
USD	300,000	DEVELOPERS DIV CV 1.75% 15/11/40	352,541	343,782	0.11
USD	380,000	EMULEX CORP CV 1.75% 15/11/18 144A	380,000	339,707	0.11
USD	213,000	LEXINGTON REALTY CV 6% 15/01/30 144	293,591	339,575	0.11
USD	343,000	ENCORE CAP GP CV 2.875% 15/3/21 144	342,960	336,620	0.11
USD	278,000	INCYTE CORP CV 0.375% 15/11/18 144A	320,914	333,025	0.11
USD	260,000	WORKDAY INC CV 0.75% 15/07/18	312,125	320,832	0.10
USD	300,000	DEPOMED CV 2.5% 01/09/21	300,000	316,890	0.10
USD	276,000	PALO ALTO NETWORKS CV 0% 1/7/19 144	276,000	309,948	0.10
USD	300,000	NUANCE COMM 2.75% 01/11/31	300,750	297,330	0.10
USD	200,000	LAM RESEACH CV 1.25% 15/05/18	268,600	275,176	0.09
USD	236,000	CUBIST PHARMA CV 1.875% 01/09/20	236,000	264,698	0.09
USD	249,000	NAVISTAR INTL CV 4.75% 15/04/19 14	267,831	261,480	0.08
USD	256,000	FINISAR CORP CV 0.5% 15/12/33 144A	276,227	246,938	0.08
USD	225,000	HORNBECK OFFSH CV 1.5% 01/09/19	225,000	242,141	0.08
USD	200,000	STARWOOD PROPERTY CV 4% 15/01/19	227,008	222,260	0.07
USD	220,000	WEB COM GP CV 1% 15/08/18	241,795	204,138	0.07
USD	143,000	WRIGHT MEDICAL CV 2% 15/08/17	145,771	198,801	0.06
USD	150,000	ELECTRONIC ART CV 0.75% 15/7/16	150,750	190,203	0.06
USD	120,000	AIR LEASE CORP CV 3.875% 1/12/18	125,079	171,000	0.06
USD	145,000	STANDARD PACIF CORP CV 1.25% 1/8/32	183,488	170,810	0.06
USD	100,000	HOTEL RES CV 2.5% 15/10/29 14	136,197	168,385	0.05
USD	143,000	GOODRICH PETROLEUM CV 5% 01/10/32	137,566	156,249	0.05
USD	100,000	TEVA PHARM FIN CV 0.25% 01/02/26 C	132,132	126,244	0.04
USD	92,000	SUNPOWER CORP CV 0.875% 1/6/21 144	92,000	105,090	0.03
USD	100,000	CIENA CORP CV 0.875% 15/06/17	89,750	99,610	0.03
USD	100,000	ACORDA THERAPEUTIC CV 1.75% 15/6/21	99,250	98,983	0.03
			106,585,513	119,087,085	38.62
<b>変動金利債</b>					
USD	10,750	CENTERPOINT ENERGY CV FRN 15/09/29	470,191	669,782	0.22
			470,191	669,782	0.22

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	組入比率 (%)
<b>その他債券</b>					
USD	2,268,000	LIBERTY MEDIA LLC CV 3.5% 15/01/31	1,242,692	1,260,044	0.41
USD	1,850,000	LIBERTY MEDIA CV 3.75% 15/2/30	957,248	1,112,968	0.36
			2,199,940	2,373,012	0.77
<b>ステップアップ/ダウン債</b>					
USD	1,471,000	GENERAL CABLE CV STUP 15/11/29	1,754,434	1,228,984	0.39
USD	893,000	HOLOGIC INC CV STEPDOWN 01/03/42 WI	863,473	950,732	0.31
USD	450,000	HOLOGIC INC CV STEP 15/12/37	514,688	540,392	0.18
			3,132,595	2,720,108	0.88
<b>優先証券</b>					
--	51,600	NEXTERA ENERGY CV PFD 5.799% 1/9/16	2,616,471	2,801,880	0.91
--	2,339	BK OF AMERICA CV PFD 7.25% 31/12/49	2,243,047	2,731,952	0.89
--	1,473	WELLS FARGO CO PFD 7.5% 31/12/49	1,817,430	1,767,821	0.57
--	31,302	EXELON CORP PFD 6.5% 01/06/17	1,620,689	1,594,524	0.52
--	13,647	CROWN CASTLE PFD 4.5% 01/11/16 A	1,364,700	1,425,429	0.46
--	925	HEALTHSOUTH CORP PFD 6.5% 31/12/49	1,029,766	1,264,077	0.41
--	13,750	OMNICARE CAP PFD CV 4% 15/06/33	564,524	1,068,238	0.35
--	18,000	DOMINION RES PFD CV 6.375% 1/07/17	927,450	908,640	0.29
--	15,923	DOMINION RES PFD CV 6.125% 01/04/16	799,626	898,853	0.29
--	784	CHESAPEAKE CV PFD 5.75% 31/12/49 14	1,020,367	898,660	0.29
--	941	HALCON RESOURC PFD 5.75% 21/12/49 A	901,101	846,900	0.27
--	7,501	AMERICAN TOWER PFD 5.25% 15/05/17	783,100	819,934	0.27
--	14,839	WEYERHAEUSER PFD CV 6.375% 1/7/16 A	750,963	809,616	0.26
--	6,000	KEYCORP CV PFD 7.75% 31/12/19	629,201	793,140	0.26
--	13,000	UNITED TECH CORP PFD 7.5% 01/08/22	721,965	781,300	0.25
--	560	HUNTINGTON BAN CV PFD 8.5% 31/12/49	692,109	757,680	0.25
--	12,050	HEALTH CARE RE CV PFD 6.5% 31/12/49	606,920	702,636	0.23
--	7,075	SANDRIDGE ENER PFD CV 8.5% 31/12/49	1,074,087	676,922	0.22
--	10,950	ALCOA INC PFD 5.375% 01/10/17 1	547,500	547,500	0.18
--	4,687	STANLEY BLACK PFD 6.25% 17/11/16	491,894	546,551	0.18
--	8,715	DOMINION RES PFD CV 6% 01/07/16 B	446,833	493,618	0.16
--	8,940	TYSON FOODS PFD CV 4.75% 15/07/17	444,246	445,748	0.14
--	6,500	NEXTERA ENERGY PFD 5.889% 1/09/15	363,862	394,940	0.13
--	7,002	LACLEDE PFD CV 6.75% 01/04/17	355,570	374,607	0.12
--	9,000	METLIFE INC PFD 5% 08/10/14	395,603	290,223	0.09
			23,209,024	24,641,389	7.99
		合計： アメリカ	135,597,263	149,491,376	48.48
<b>組入資産合計</b>			<b>274,505,073</b>	<b>291,464,678</b>	<b>94.53</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  
2014年9月20日現在  
(購入金額、売却金額、契約数は通貨を欄左側に表示)

## 注記 1 – 外国為替先渡し契約

2014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	12,014,900	USD	5,000,000	2014年11月4日	10,016
USD	571,868	KRW	594,400,000	2014年11月25日	4,606
USD	51,804	EUR	40,000	2014年10月28日	227
AUD	5,910	USD	5,322	2014年10月15日	(40)
AUD	5,903	USD	5,322	2014年9月30日	(40)
ZAR	58,336	USD	5,322	2014年9月30日	(55)
ZAR	58,475	USD	5,322	2014年10月15日	(56)
BRL	25,199	USD	10,645	2014年11月4日	(137)
JPY	1,879,459	USD	17,556	2014年10月15日	(324)
JPY	1,879,704	USD	17,556	2014年9月30日	(325)
JPY	1,804,721	USD	17,213	2014年9月30日	(669)
JPY	2,309,507	USD	22,235	2014年9月30日	(1,064)
JPY	32,059,585	USD	304,945	2014年9月30日	(11,046)
BRL	4,736,564	USD	2,000,000	2014年11月4日	(24,931)
BRL	7,618,499	USD	3,200,000	2014年12月2日	(47,764)
BRL	4,508,387	USD	1,960,735	2014年10月2日	(62,437)
BRL	12,655,239	USD	5,300,000	2014年12月2日	(63,758)
BRL	9,676,336	USD	4,100,000	2014年11月4日	(65,127)
BRL	4,584,720	USD	2,000,000	2014年10月2日	(69,561)
BRL	4,576,772	USD	2,000,000	2014年10月2日	(72,908)
BRL	7,236,175	USD	3,100,000	2014年11月4日	(82,634)
BRL	4,779,990	USD	2,100,000	2014年10月2日	(87,341)
BRL	16,815,966	USD	7,100,000	2014年11月4日	(88,018)
BRL	7,218,920	USD	3,100,000	2014年11月4日	(89,829)
BRL	6,893,706	USD	3,000,000	2014年10月2日	(97,342)
BRL	13,982,148	USD	6,000,000	2014年10月2日	(112,688)
BRL	9,227,940	USD	4,000,000	2014年10月2日	(114,491)
BRL	11,568,770	USD	5,000,000	2014年10月2日	(128,863)
BRL	9,505,784	USD	4,100,000	2014年11月4日	(136,244)
BRL	7,005,339	USD	3,100,000	2014年10月2日	(150,337)
BRL	16,899,508	USD	7,200,000	2014年11月4日	(153,183)
BRL	13,594,372	USD	5,900,000	2014年10月2日	(175,964)
BRL	12,003,082	USD	5,200,000	2014年11月4日	(194,912)
BRL	11,999,442	USD	5,200,000	2014年11月4日	(196,430)
BRL	13,020,527	USD	5,700,000	2014年10月2日	(217,587)
BRL	11,568,263	USD	5,100,000	2014年10月2日	(229,076)
BRL	16,708,154	USD	7,200,000	2014年11月4日	(232,974)
BRL	11,535,623	USD	5,100,000	2014年10月2日	(242,819)

## 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

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	11,737,892	USD	5,200,000	2014年10月2日	(257,652)
BRL	17,316,919	USD	7,600,000	2014年10月2日	(308,552)
ZAR	230,203,630	USD	21,077,444	2014年10月15日	(342,063)
JPY	1,274,538,314	USD	12,128,757	2014年10月15日	(442,288)
JPY	993,094,053	USD	9,561,742	2014年9月30日	(457,753)
ZAR	183,668,996	USD	17,049,327	2014年9月30日	(465,888)
ZAR	183,672,714	USD	17,085,992	2014年9月30日	(502,217)
AUD	19,226,295	USD	17,755,291	2014年10月15日	(569,926)
ZAR	230,210,048	USD	21,337,477	2014年10月15日	(601,518)
AUD	19,226,078	USD	17,956,772	2014年10月15日	(771,602)
AUD	25,855,293	USD	23,929,591	2014年9月30日	(794,256)
AUD	25,855,292	USD	24,050,852	2014年9月30日	(915,517)
USD	7,200,000	BRL	16,562,570	2014年10月2日	226,177
USD	7,200,000	BRL	16,752,859	2014年10月2日	146,054
USD	7,100,000	BRL	16,668,769	2014年10月2日	81,461
USD	4,100,000	BRL	9,590,925	2014年10月2日	61,653
USD	5,300,000	BRL	12,447,050	2014年10月2日	59,055
USD	3,200,000	BRL	7,492,800	2014年10月2日	45,088
USD	673,020	BRL	1,520,169	2014年10月2日	32,939
USD	680,006	BRL	1,558,050	2014年10月2日	23,975
USD	2,000,000	BRL	4,695,000	2014年10月2日	23,127
USD	372,996	BRL	844,362	2014年10月2日	17,470
USD	306,515	BRL	693,866	2014年10月2日	14,356
USD	369,930	BRL	845,227	2014年10月2日	14,040
USD	336,510	AUD	360,944	2014年10月15日	13,881
USD	336,510	AUD	360,564	2014年9月30日	13,877
USD	340,003	AUD	367,186	2014年10月15日	11,794
USD	340,003	AUD	366,797	2014年9月30日	11,793
USD	264,829	BRL	603,051	2014年10月2日	10,909
USD	321,261	BRL	740,261	2014年10月2日	9,568
USD	336,510	ZAR	3,626,261	2014年9月30日	9,096
USD	336,510	ZAR	3,635,045	2014年10月15日	9,087
USD	186,498	AUD	199,436	2014年9月30日	8,042
USD	318,700	BRL	740,829	2014年10月2日	6,767
USD	153,257	AUD	164,391	2014年9月30日	6,160
USD	132,414	AUD	141,688	2014年9月30日	5,632
USD	153,257	ZAR	1,635,790	2014年9月30日	5,562
USD	186,498	ZAR	2,009,775	2014年9月30日	5,036
USD	132,414	ZAR	1,418,076	2014年9月30日	4,377
USD	340,003	ZAR	3,717,559	2014年9月30日	4,346
USD	340,003	ZAR	3,726,587	2014年10月15日	4,334
USD	57,189	JPY	5,944,211	2014年9月30日	2,697
USD	60,643	JPY	6,369,409	2014年9月30日	2,253
USD	33,130	BRL	74,998	2014年10月2日	1,552
USD	23,932	BRL	54,057	2014年10月2日	1,171
USD	26,987	JPY	2,837,818	2014年9月30日	972
USD	26,987	JPY	2,837,467	2014年10月15日	970
USD	16,565	AUD	17,714	2014年9月30日	714
USD	18,710	BRL	43,112	2014年10月2日	557
USD	11,966	AUD	12,835	2014年10月15日	494
USD	11,966	AUD	12,821	2014年9月30日	493

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

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	15,147	BRL	34,805	2014年10月2日	492
USD	16,565	ZAR	178,513	2014年9月30日	447
USD	15,979	BRL	37,144	2014年10月2日	339
USD	11,966	ZAR	128,950	2014年9月30日	323
USD	11,966	ZAR	129,262	2014年10月15日	323
USD	8,502	JPY	894,022	2014年9月30日	306
USD	8,502	JPY	893,912	2014年10月15日	306
USD	7,573	AUD	8,146	2014年9月30日	284
USD	7,573	ZAR	81,586	2014年9月30日	207
USD	5,000,000	BRL	11,910,000	2014年10月2日	(14,815)
USD	34,655,979	EUR	25,500,000	2014年10月9日	1,779,734
USD	16,416,916	EUR	12,350,000	2014年9月26日	495,814
USD	5,312,265	GBP	3,100,000	2014年10月9日	207,750
CNY	113,184,303	USD	18,262,896	2014年10月17日	126,145
USD	2,509,852	AUD	2,700,000	2014年10月9日	95,438
USD	2,935,496	GBP	1,730,000	2014年9月26日	86,530
USD	1,586,324	AUD	1,700,000	2014年9月26日	64,731
USD	9,265,377	EUR	7,150,000	2014年9月26日	47,897
USD	1,375,792	KRW	1,393,568,000	2014年10月10日	42,919
USD	1,844,673	SGD	2,300,000	2014年10月9日	29,092
USD	855,899	SGD	1,070,000	2014年9月26日	11,255
USD	291,623	SEK	2,000,000	2014年10月9日	10,610
USD	256,555	GBP	150,000	2014年10月9日	9,563
USD	800,000	IDR	9,528,000,000	2014年10月17日	8,125
USD	133,737	EUR	100,000	2014年10月9日	4,811
USD	1,000,000	EUR	772,725	2014年10月9日	3,752
USD	58,825	KRW	60,000,000	2014年10月10日	1,438
GBP	60,000	USD	97,563	2014年10月9日	1,233
USD	900,000	CNY	5,537,700	2014年10月17日	290
USD	2,645,017	HKD	20,500,000	2014年10月9日	281
USD	700,000	INR	42,889,000	2014年10月17日	147
USD	483,914	HKD	3,750,000	2014年10月9日	121
USD	258,070	HKD	2,000,000	2014年10月9日	47
USD	477,348	HKD	3,700,000	2014年10月9日	6
USD	7,000	CNY	43,081	2014年10月10日	(4)
USD	1,548,113	HKD	12,000,000	2014年9月26日	(37)
SGD	97,000	USD	76,749	2014年10月9日	(179)
EUR	250,000	USD	322,765	2014年10月9日	(449)
KRW	230,025,331	USD	221,000	2014年10月10日	(993)
EUR	300,000	USD	387,901	2014年10月9日	(1,122)
USD	168,684	CNY	1,045,000	2014年10月10日	(1,214)
USD	646,987	CNY	4,000,000	2014年9月26日	(4,239)
USD	654,323	CNY	4,050,000	2014年9月26日	(5,043)
USD	1,200,000	CNY	7,423,200	2014年10月17日	(6,047)
INR	1,033,225,446	USD	16,885,527	2014年10月17日	(25,589)
EUR	462,160	USD	625,000	2014年10月9日	(29,153)
AUD	1,030,000	USD	952,297	2014年10月9日	(31,244)
EUR	572,385	HKD	6,000,000	2014年10月9日	(36,113)
IDR	293,860,037	USD	16,946,768	2014年10月17日	(300,290)
USD	11,259,954	EUR	8,730,000	2014年11月25日	813
USD	1,338,931	HKD	10,378,000	2014年11月25日	19

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	126,943	CHF	119,000	2014年11月25日	(214)
USD	1,195,201	SGD	1,515,000	2014年11月25日	(683)
USD	355,359	GBP	218,000	2014年11月25日	(3,450)
					<b>(6,097,118)</b>

注記 2 – 未決済オプション契約

2014年9月20日現在、ファンドは以下の未決済オプション契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
<b>買い持ちポジション</b>						
EUR	40	C ADS 60	2015年6月19日	25,090	31,712	6,622
EUR	129	C ADS 76	2014年12月19日	57,475	6,485	(50,990)
EUR	100	C CP1 FP 56	2015年3月20日	52,704	65,100	12,396
EUR	500	C DPW GY 24	2014年12月19日	67,737	174,029	106,292
GBP	270	C GL LN 3.8	2015年3月20日	98,184	54,471	(43,713)
EUR	240	C MT NA 11	2015年6月19日	30,077	38,982	8,905
EUR	240	C SE1 FP 14	2014年12月19日	34,575	14,541	(20,034)
EUR	50	C SIE GY 92	2015年6月19日	40,993	56,527	15,534
EUR	170	C SIE GY 96	2015年3月20日	89,166	121,407	32,241
EUR	50	C TE1 FP 72	2015年3月20日	37,275	16,436	(20,839)
EUR	430	CALL DPW 26	2014年12月19日	113,361	70,398	(42,963)
EUR	50	CALL KR1 160	2014年12月19日	84,157	54,722	(29,435)
GBP	15	CALL SHP 4200	2014年12月19日	97,623	273,962	176,339
EUR	160	CALL TE1 72	2014年12月19日	159,357	20,626	(138,731)
EUR	50	PUT EURO STOXX 50 3100	2014年9月19日	38,525	6	(38,519)
EUR	130	PUT NOA3 GR 5.8	2014年12月19日	3,846	1,341	(2,505)
				1,030,145	1,000,745	(29,400)
<b>売り持ちポジション</b>						
EUR	(50)	C CP1 FP 64	2015年3月20日	(9,273)	(11,537)	(2,264)
GBP	(15)	C SHP LN 4800	2014年12月19日	(44,191)	(145,381)	(101,190)
EUR	(50)	C TE1 FP 84	2015年3月20日	(11,753)	(2,578)	9,175
EUR	(22)	CALL CP1 64	2014年12月19日	(4,376)	(2,467)	1,909
EUR	(500)	CALL NOA3 GR 6.8	2014年12月19日	(10,573)	(21,915)	(11,342)
EUR	(10)	P SX5E 2900	2014年9月19日	(3,307)	(13)	3,294
				(83,473)	(183,891)	(100,418)
				<b>946,672</b>	<b>816,854</b>	<b>(129,818)</b>

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第13期（決算日2015年8月19日）

作成対象期間（2014年8月20日～2015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	株式への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債組入比率	債券率	債先物比率	債券率	純資産額
	騰落	期中率					
9期(2011年8月19日)	円 10,170	% 0.1	% 91.3	% —	% —	百万円 5,916	
10期(2012年8月20日)	10,181	0.1	100.7	—	—	2,216	
11期(2013年8月19日)	10,191	0.1	80.9	—	—	5,297	
12期(2014年8月19日)	10,199	0.1	59.7	—	—	8,648	
13期(2015年8月19日)	10,206	0.1	44.7	—	—	22,034	

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

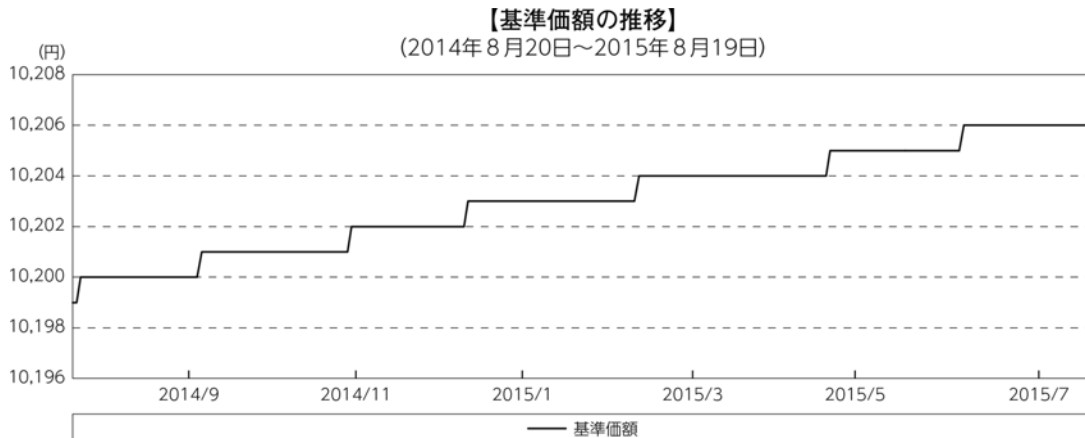
年月日	基準価額		債組入比率	債券率	債先物比率	債券率
	騰落	期中率				
(期首) 2014年8月19日	円 10,199	% —	% 59.7	% —	% —	
8月末	10,200	0.0	70.0	—	—	
9月末	10,200	0.0	62.3	—	—	
10月末	10,201	0.0	52.6	—	—	
11月末	10,202	0.0	52.6	—	—	
12月末	10,202	0.0	54.3	—	—	
2015年1月末	10,203	0.0	90.0	—	—	
2月末	10,203	0.0	59.5	—	—	
3月末	10,204	0.0	52.3	—	—	
4月末	10,204	0.0	62.6	—	—	
5月末	10,205	0.1	59.8	—	—	
6月末	10,205	0.1	41.2	—	—	
7月末	10,206	0.1	46.2	—	—	
(期末) 2015年8月19日	10,206	0.1	44.7	—	—	

\*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



### ○基準価額の変動要因

#### \* 基準価額は0.07%の上昇

基準価額は、期首10,199円から期末は10,206円となりました。

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

## ○投資環境

国内経済は、企業収益や雇用・所得環境が改善する中で緩やかな回復を続けてきましたが、4-6月期は個人消費や輸出といった内外需が落ち込み、景気回復が小休止状態にあることを示しました。

このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続し、2014年10月の金融政策決定会合では、資産買入れ額の拡大および長期国債買入れの平均残存年限の長期化を図るなど金融緩和を強化しました。

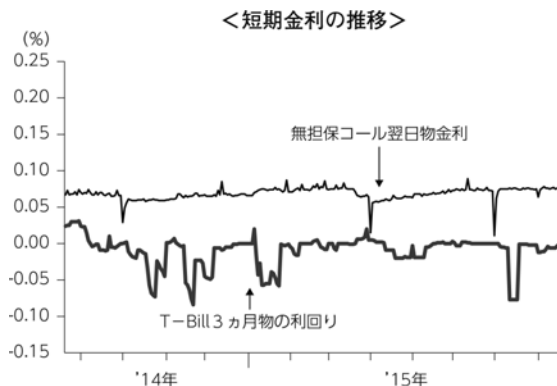
### ・無担保コール翌日物金利の推移

期を通じて概ね0.06%台から0.07%台で推移しました。

### ・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

2014年9月以降、国内投資家の恒常的な国債需要に加え、日本銀行による買入や海外からの資金流入などによる需給ひっ迫から利回りは低下し、マイナスとなりました。

その後、一時的な需給の緩みにより利回りがプラス圏に戻る局面もありましたが、期末にかけて概ねマイナス圏で推移しました。





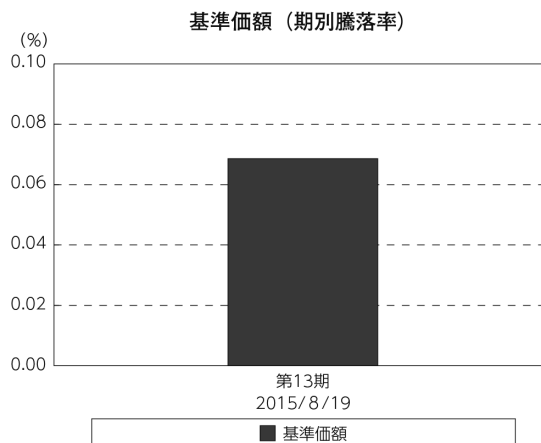
## ○当ファンドのポートフォリオ

今期の運用につきましては、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー（CP）等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローン等で運用を行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

今後も、残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、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る運用を行なう方針です。

今後とも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

(2014年8月20日～2015年8月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 ( 0 )	% 0.002 (0.002)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、10,202円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○ 売買及び取引の状況

(2014年8月20日～2015年8月19日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	57,121,186	33,710,730 (24,409,350)
	地方債証券	3,262,292	— ( 1,970,000)
	特殊債券	10,876,852	— ( 7,504,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,312,770	— ( 2,240,000)

\*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。

## その他有価証券

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	コマーシャル・ペーパー	7,297,610	— (5,300,000)

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2014年8月20日～2015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	$\frac{B}{A}$ %	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 40,912	百万円 5,799	% 14.2	百万円 50	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證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2015年8月19日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	1,180,000 (1,130,000)	1,180,008 (1,129,999)	5.4 (5.1)	- (-)	- (-)	- (-)	5.4 (5.1)
地方債証券	1,281,600 (1,281,600)	1,287,899 (1,287,899)	5.8 (5.8)	- (-)	- (-)	- (-)	5.8 (5.8)
特殊債券 (除く金融債)	4,686,000 (4,686,000)	4,703,401 (4,703,401)	21.3 (21.3)	- (-)	- (-)	- (-)	21.3 (21.3)
金融債券	1,470,000 (1,470,000)	1,473,440 (1,473,440)	6.7 (6.7)	- (-)	- (-)	- (-)	6.7 (6.7)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,200,000 (1,200,000)	1,207,103 (1,207,103)	5.5 (5.5)	- (-)	- (-)	- (-)	5.5 (5.5)
合 計	9,817,600 (9,767,600)	9,851,853 (9,801,844)	44.7 (44.5)	- (-)	- (-)	- (-)	44.7 (44.5)

\* ( ) 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。

\* -印は組み入れなし。

\* 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	柄	当期			末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>			千円	千円	
国庫短期証券	第541回	—	500,000	499,999	2015/9/28
国庫短期証券	第542回	—	200,000	199,999	2015/10/5
国庫短期証券	第546回	—	100,000	99,999	2015/10/19
国庫短期証券	第547回	—	300,000	299,999	2015/10/26
国庫短期証券	第548回	—	30,000	29,999	2015/11/2
国庫債券	利付(2年)第333回	0.1	50,000	50,009	2015/10/15
小	計		1,180,000	1,180,008	
<b>地方債証券</b>					
東京都	公募第625回	1.41	200,000	200,218	2015/9/18
北海道	公募平成17年度第6回	1.4	105,100	105,142	2015/8/31
北海道	公募平成17年度第12回	1.6	50,000	50,365	2016/2/24
神奈川県	公募第136回	1.5	90,000	90,421	2015/12/28
大阪府	公募第284回	1.6	300,000	301,207	2015/11/27
兵庫県	公募平成18年度第7回	2.1	80,000	81,503	2016/7/27
新潟県	公募平成18年度第1回	2.1	6,500	6,617	2016/7/27
共同発行市場地方債	公募第31回	1.5	50,000	50,123	2015/10/23
共同発行市場地方債	公募第32回	1.6	100,000	100,391	2015/11/25
共同発行市場地方債	公募第34回	1.4	200,000	201,130	2016/1/25
共同発行市場地方債	公募第35回	1.6	100,000	100,778	2016/2/25
小	計		1,281,600	1,287,899	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第346回	1.4	300,000	300,095	2015/8/26
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第347回	1.3	352,000	352,411	2015/9/22
首都高速道路債券	政府保証第199回	1.4	50,000	50,018	2015/8/28
阪神高速道路債券	政府保証第148回	1.3	20,000	20,028	2015/9/30
本州四国連絡橋債券	政府保証第27回	1.4	300,000	300,141	2015/8/31
公営企業債券	政府保証第861回	1.6	29,000	29,256	2016/3/17
公営企業債券	政府保証第862回	1.8	117,000	118,337	2016/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証債第1回	1.5	100,000	100,499	2015/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第3回	1.5	590,000	593,701	2016/1/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第5回	1.6	558,000	562,454	2016/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第11回	1.8	170,000	171,994	2016/4/26
首都高速道路債券	政府保証第1回	1.6	400,000	403,726	2016/3/28
中部国際空港債券	政府保証第17回	0.051	300,000	300,000	2016/3/7
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第119回	0.067	200,000	199,993	2015/12/18
地方公共団体金融機構債券	2年第1回	0.135	200,000	200,056	2016/2/26
首都高速道路社債	第6回	0.315	100,000	100,024	2015/9/24
阪神高速道路社債	財投機関債第6回	0.589	100,000	100,166	2015/12/18
中日本高速道路債券	財投機関債第20回	0.417	100,000	100,025	2015/9/18
中日本高速道路社債	財投機関債第37回	0.385	200,000	200,314	2016/2/26
西日本高速道路	第16回	0.246	200,000	200,038	2015/9/18
西日本高速道路	第17回	0.196	300,000	300,113	2015/12/18
小	計		4,686,000	4,703,401	
<b>金融債券</b>					
商工債券	利付第724回い号	0.5	320,000	320,138	2015/9/25
商工債券	利付第733回い号	0.55	300,000	301,185	2016/6/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>		%	千円	千円	
商工債券	利付第734回い号	0.55	150,000	150,655	2016/7/27
農林債券	利付第723回い号	0.55	150,000	150,020	2015/8/27
農林債券	利付第724回い号	0.5	50,000	50,021	2015/9/25
農林債券	利付第733回い号	0.55	100,000	100,392	2016/6/27
商工債券	利付(3年)第152回	0.2	100,000	100,013	2015/9/25
商工債券	利付(3年)第153回	0.2	100,000	100,026	2015/10/27
商工債券	利付(3年)第161回	0.25	100,000	100,144	2016/6/27
商工債券	利付(10年)第2回	1.78	100,000	100,841	2016/2/19
小	計		1,470,000	1,473,440	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
みずほコーポレート銀行	第24回特定社債間限定同順位特約付	0.595	200,000	200,415	2016/1/20
みずほコーポレート銀行	第25回特定社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	100,429	2016/4/20
トヨタファイナンス	第19回社債間限定同等特約付	2.04	200,000	202,217	2016/3/18
三菱UFJリース	第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	502,336	2016/4/22
三菱UFJリース	第22回社債間限定同順位特約付	0.235	100,000	100,066	2016/2/26
東邦瓦斯	第30回社債間限定同順位特約付	2.07	100,000	101,639	2016/6/20
小	計		1,200,000	1,207,103	
合	計		9,817,600	9,851,853	

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,499,141	% 11.3

\* 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。

## ○投資信託財産の構成

(2015年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,851,853	% 44.3
その他有価証券	2,499,141	11.2
コール・ローン等、その他	9,864,830	44.5
投資信託財産総額	22,215,824	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 (2015年8月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,215,824,811
コール・ローン等	847,502,284
公社債(評価額)	9,851,853,649
その他有価証券	2,499,141,851
未収利息	15,014,658
前払費用	12,080,826
差入保証金	8,990,231,543
(B) 負債	181,800,841
未払金	181,483,841
未払解約金	317,000
(C) 純資産総額(A-B)	22,034,023,970
元本	21,588,342,274
次期繰越損益金	445,681,696
(D) 受益権総口数	21,588,342,274口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,206円

(注) 期首元本額8,478百万円、期中追加設定元本額20,130百万円、期中一部解約元本額7,020百万円、計算口数当たり純資産額10,206円。

## ○損益の状況 (2014年8月20日～2015年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	61,355,124
受取利息	58,968,909
その他収益金	2,386,215
(B) 有価証券売買損益	△ 49,857,397
売買益	19,664
売買損	△ 49,877,061
(C) 保管費用等	△ 261,886
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,235,841
(E) 前期繰越損益金	169,135,352
(F) 追加信託差損益金	408,020,917
(G) 解約差損益金	△142,710,414
(H) 計(D+E+F+G)	445,681,696
次期繰越損益金(H)	445,681,696

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

\*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。



ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	0
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Aコース)	0
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村カルミニャック・ファンド Aコース	0
野村カルミニャック・ファンド Bコース	0
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
野村エマーシング債券プレミアム毎月分配型	0
野村エマーシング債券プレミアム年2回決算型	0
ノムラ THE USA Aコース	0
ノムラ THE USA Bコース	0
ノムラ THE EUROPE Aコース	0
ノムラ THE EUROPE Bコース	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
米国変動好金利ファンド Aコース	8
米国変動好金利ファンド Bコース	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村グローバルボンド投信 Aコース	0
野村グローバルボンド投信 Bコース	0
野村グローバルボンド投信 Cコース	0
野村グローバルボンド投信 Dコース	0
野村グローバルボンド投信 Eコース	0
野村グローバルボンド投信 Fコース	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村新興国高配当株トリプルウィング ブラジルリアル毎月分配型	0
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	0
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	0
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	0
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	0
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)	0
ノムラ THE ASIA Aコース	0
ノムラ THE ASIA Bコース	0
第1回 野村短期公社債ファンド	0
第2回 野村短期公社債ファンド	0
第3回 野村短期公社債ファンド	0
第4回 野村短期公社債ファンド	0
第5回 野村短期公社債ファンド	0
第6回 野村短期公社債ファンド	0
第7回 野村短期公社債ファンド	0
第8回 野村短期公社債ファンド	0
第9回 野村短期公社債ファンド	0
第10回 野村短期公社債ファンド	0
第11回 野村短期公社債ファンド	0
第12回 野村短期公社債ファンド	0
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)	5,276
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家監別制限付)	3,422
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)27ライス(適格機関投資家専用)	2,296
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)D7ライス(適格機関投資家専用)	4,635
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家監別制限付)	1,186
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1308(適格機関投資家監別制限付)	1,019
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Bコース	0

\*単位未満は切り捨て。



○お知らせ

---

①デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2014年12月4日>

②信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2015年2月23日>

〈「野村グローバルCB投信（バスケット通貨選択型）」（マネープールファンド（年2回決算型）を除く）の  
お申し込み時の留意点〉

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

(2015年9月24日現在)

	「円コース」 「資源国通貨コース」	「アジア通貨コース」
2015年9月	－	24
10月	－	1、2、5、6、7、14
11月	11、26	11、12、26
12月	24、25、28	24、25、28

※2015年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご留意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。