

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

運用報告書(全体版)

第88期(決算日2021年12月15日) 第89期(決算日2022年1月17日) 第90期(決算日2022年2月15日)
第91期(決算日2022年3月15日) 第92期(決算日2022年4月15日) 第93期(決算日2022年5月16日)

作成対象期間(2021年11月16日～2022年5月16日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2014年8月11日から2024年5月15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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN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、米ドル建ての高利回り事業債(「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」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中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いません。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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN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することを基本とします。	
主な投資対象	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	ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN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、コモディティ・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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN	米ドル建ての高利回り事業債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	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、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、利子・配当等収益等を中心に分配を行いません。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があります。また、毎年5月および11月の決算時には、基準価額水準等を勘案し、上記分配相当額のほか、分配原資の範囲内で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 (分配落)	価額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 証 組 入 比 率	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落 率					
	円		円	%	%	%	%	百万円	
64期(2019年12月16日)	6,999		50	4.2	0.0	—	99.0	172	
65期(2020年1月15日)	7,150		50	2.9	0.0	—	98.4	175	
66期(2020年2月17日)	7,241		50	2.0	0.0	—	99.0	209	
67期(2020年3月16日)	5,350		50	△25.4	0.0	—	98.9	157	
68期(2020年4月15日)	4,960		50	△6.4	0.0	—	99.0	174	
69期(2020年5月15日)	4,749		50	△3.2	0.0	—	98.9	177	
70期(2020年6月15日)	5,213		50	10.8	0.0	—	98.9	194	
71期(2020年7月15日)	5,237		20	0.8	0.0	—	99.0	188	
72期(2020年8月17日)	5,487		20	5.2	0.0	—	99.0	197	
73期(2020年9月15日)	5,691		20	4.1	0.0	—	99.0	203	
74期(2020年10月15日)	5,677		20	0.1	0.0	—	98.4	203	
75期(2020年11月16日)	5,880		20	3.9	0.0	—	98.8	212	
76期(2020年12月15日)	6,080		20	3.7	0.0	—	98.9	217	
77期(2021年1月15日)	6,179		20	2.0	0.0	—	99.0	223	
78期(2021年2月15日)	6,234		20	1.2	0.0	—	99.0	204	
79期(2021年3月15日)	6,220		20	0.1	0.0	—	98.9	179	
80期(2021年4月15日)	6,446		20	4.0	0.0	—	89.6	185	
81期(2021年5月17日)	6,543		20	1.8	0.0	—	98.5	163	
82期(2021年6月15日)	6,629		20	1.6	0.0	—	98.7	165	
83期(2021年7月15日)	6,669		20	0.9	0.0	—	98.5	163	
84期(2021年8月16日)	6,653		20	0.1	0.0	—	98.7	163	
85期(2021年9月15日)	6,731		20	1.5	0.0	—	98.7	145	
86期(2021年10月15日)	6,661		20	△0.7	0.0	—	98.5	136	
87期(2021年11月15日)	6,703		20	0.9	0.0	—	98.5	136	
88期(2021年12月15日)	6,534		20	△2.2	0.0	—	98.6	135	
89期(2022年1月17日)	6,780		20	4.1	0.0	—	98.6	135	
90期(2022年2月15日)	6,640		20	△1.8	0.0	—	98.4	91	
91期(2022年3月15日)	6,546		20	△1.1	0.0	—	98.5	89	
92期(2022年4月15日)	7,336		20	12.4	0.0	—	98.7	100	
93期(2022年5月16日)	7,112		20	△2.8	0.0	—	98.6	95	

* 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	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第88期	(期 首) 2021年11月15日	円 6,703	% —	% 0.0	% —	% 98.5	
	11月末	6,207	△ 7.4	0.0	—	98.4	
	(期 末) 2021年12月15日	6,554	△ 2.2	0.0	—	98.6	
第89期	(期 首) 2021年12月15日	6,534	—	0.0	—	98.6	
	12月末	6,775	3.7	0.0	—	96.7	
	(期 末) 2022年 1 月17日	6,800	4.1	0.0	—	98.6	
第90期	(期 首) 2022年 1 月17日	6,780	—	0.0	—	98.6	
	1 月末	6,670	△ 1.6	0.0	—	98.7	
	(期 末) 2022年 2 月15日	6,660	△ 1.8	0.0	—	98.4	
第91期	(期 首) 2022年 2 月15日	6,640	—	0.0	—	98.4	
	2 月末	6,592	△ 0.7	0.0	—	98.7	
	(期 末) 2022年 3 月15日	6,566	△ 1.1	0.0	—	98.5	
第92期	(期 首) 2022年 3 月15日	6,546	—	0.0	—	98.5	
	3 月末	7,158	9.3	0.0	—	98.6	
	(期 末) 2022年 4 月15日	7,356	12.4	0.0	—	98.7	
第93期	(期 首) 2022年 4 月15日	7,336	—	0.0	—	98.7	
	4 月末	7,202	△ 1.8	0.0	—	98.6	
	(期 末) 2022年 5 月16日	7,132	△ 2.8	0.0	—	98.6	

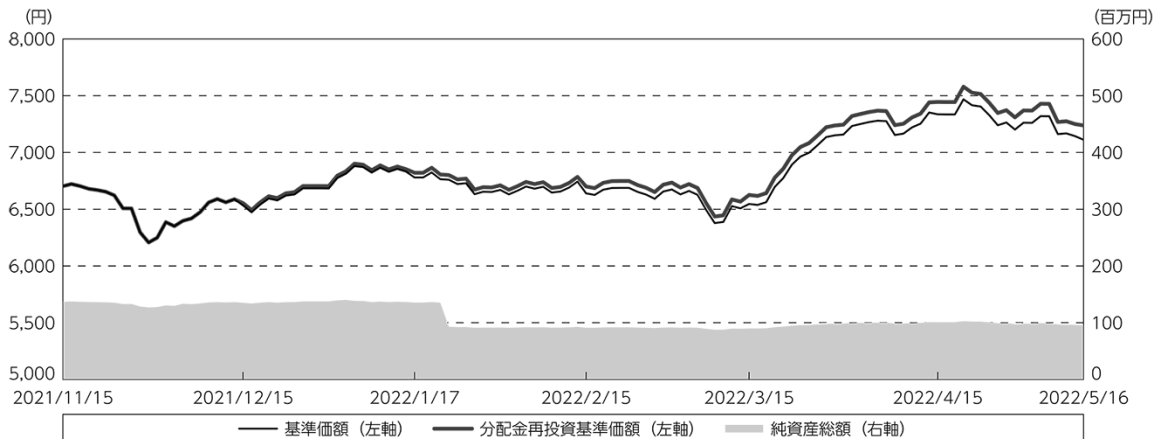
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第88期首：6,703円

第93期末：7,112円 (既払分配金(税込み)：120円)

騰落率：8.0% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年11月15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。

○基準価額の変動要因

- ・ 実質的に投資しているハイ・イールド債券からのインカムゲイン(利息収入)
- ・ 実質的に投資しているハイ・イールド債券からのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)
- ・ 為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)またはプレミアム(金利差相当分の収益)
- ・ 円/メキシコペソの為替変動

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間で値下がりとなりました（トータルリターン・現地通貨ベース）。2021年11月は、新型コロナウイルスの新たな変異株（オミクロン株）の発見でリスク回避の動きが広がったことなどを背景に下落しましたが、その後年末にかけて、オミクロン株は重症化リスクが低いとの調査結果などを受けて反発しました。2022年に入ってから、インフレ加速が警戒されるなか、FRB（米連邦準備制度理事会）が金融引き締めを急ぐとの見方が広がり、米長期金利が高水準をつけたことや、ウクライナ情勢の緊迫化を背景にリスク回避の動きが強まったことなどから下落基調で推移し、当作成期間において値下がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

〔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〕

〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN〕および〔野村マネー マザーファンド〕の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN〕の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN〕

主要投資対象である〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカム〕における信用格付け別比率については、2022年4月末時点で、BBB格0.8%、BB格41.2%、B格53.7%、CCC格以下1.7%となりました。

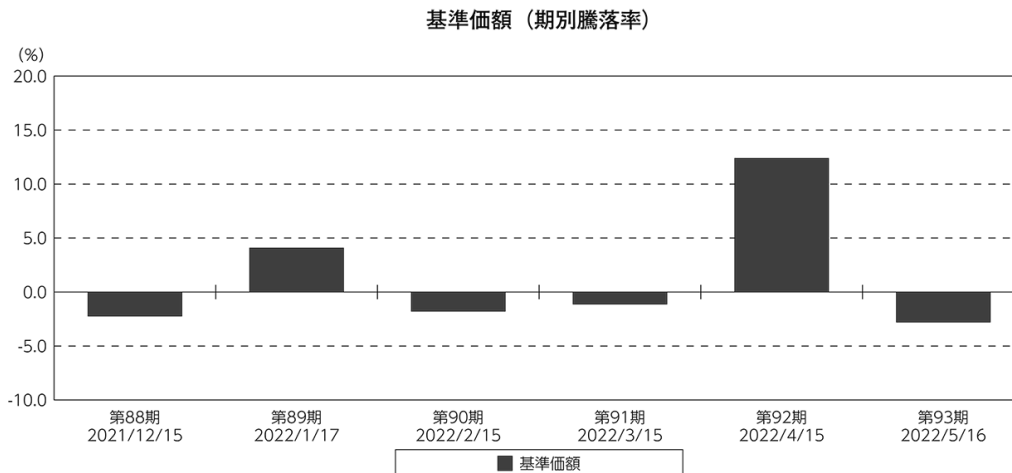
〔野村マネー マザーファンド〕

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

収益分配金については、各期毎の利子・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案して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88期	第89期	第90期	第91期	第92期	第93期
	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.305%	20 0.294%	20 0.300%	20 0.305%	20 0.272%	20 0.280%
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	2,513	2,531	2,552	2,564	2,777	2,789

(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]

[ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN] 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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN] 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

[ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスMXN]

米ドル建ての高利回り事業債（「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。）を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指します。

また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、米ドル建て資産に対し原則として米ドルを売り、メキシコペソを買う為替取引を行いません。

米国ハイ・イールド債市場は、今後12ヵ月間に直面すると考えられる景気減速リスクを緩やかに織り込み始めたものと見ています。スプレッド（国債との利回り格差）は2021年の低水準からゆっくりと拡大しているものの、多くの米国ハイ・イールド債発行者は、コロナ禍の低金利環境下で借り換えや資金調達を積極的に行なってきたことで手元資金は潤沢であり、市場環境を踏まえて発行額を抑制することが可能となっており、足元の利回りの上昇が負担となる懸念は限定的と考えます。ボラティリティ（市場変動性）が高まる一方で、企業ファンダメンタルズ（基礎的条件）の安定や堅調な消費動向が下支えとなり、スプレッドは年末まではレンジ内での推移になると予想します。足下で7%を超える米国ハイ・イールド債の利回り水準は、金利上昇に伴う影響を相殺し、魅力的な収益の獲得につながると考えられます。

[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留意ください。

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

(2021年11月16日～2022年5月16日)

項 目	第88期～第93期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 33	% 0.483	(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 ）	(13)	(0.192)	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 ）	(19)	(0.274)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	33	0.484	
作成期間の平均基準価額は、6,767円です。			

* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

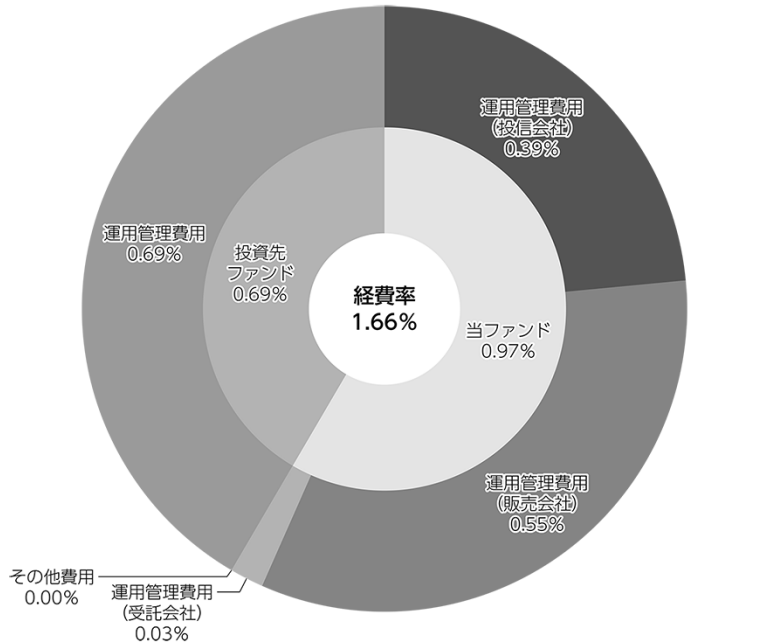
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.66%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	1.66
①当ファンドの費用の比率	0.97
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.69

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

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

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

○売買及び取引の状況

(2021年11月16日～2022年5月16日)

投資信託証券

銘		第88期～第93期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ノムラ・カレンシー・ファンド-USハイ・イールド・ボンド・インカム・クラスMN	2,450	12,818	10,852	58,224

*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

(2021年11月16日～2022年5月16日)

利害関係人との取引状況

<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>
該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区 分	第88期～第93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 5,757	百万円 30	% 0.5	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2022年5月16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87期末	第93期末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
	ノムラ・カレンシー・ファンド-USハイ・イールド・ボンド・インカム・クラスMN	25,396	16,994	94,367	98.6
	合 計	25,396	16,994	94,367	98.6

*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87期末	第93期末	
		口数	口数	評価額
野村マネー マザーファンド		千口 9	千口 9	千円 10

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年5月16日現在)

項	目	第93期末	
		評価額	比率
投資信託受益証券		千円 94,367	% 97.6
野村マネー マザーファンド		10	0.0
コール・ローン等、その他		2,287	2.4
投資信託財産総額		96,664	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88期末	第89期末	第90期末	第91期末	第92期末	第93期末
		2021年12月15日現在	2022年1月17日現在	2022年2月15日現在	2022年3月15日現在	2022年4月15日現在	2022年5月16日現在
		円	円	円	円	円	円
(A)	資産	135,656,114	136,002,297	91,526,834	90,275,046	101,200,445	96,664,560
	コール・ローン等	2,430,433	2,431,573	1,768,982	1,685,178	1,612,925	2,286,878
	投資信託受益証券(評価額)	133,215,680	133,560,724	89,747,852	88,579,868	99,577,520	94,367,682
	野村マネー マザーファンド(評価額)	10,001	10,000	10,000	10,000	10,000	10,000
(B)	負債	575,764	519,860	350,060	342,373	356,849	963,622
	未払収益分配金	413,450	399,640	274,633	274,787	274,942	269,133
	未払解約金	55,632	—	—	—	2,343	612,830
	未払信託報酬	106,446	119,953	75,265	67,441	79,395	81,483
	未払利息	1	1	—	—	—	—
	その他未払費用	235	266	162	145	169	176
(C)	純資産総額(A-B)	135,080,350	135,482,437	91,176,774	89,932,673	100,843,596	95,700,938
	元本	206,725,290	199,820,464	137,316,858	137,393,592	137,471,465	134,566,713
	次期繰越損益金	△ 71,644,940	△ 64,338,027	△ 46,140,084	△ 47,460,919	△ 36,627,869	△ 38,865,775
(D)	受益権総口数	206,725,290口	199,820,464口	137,316,858口	137,393,592口	137,471,465口	134,566,713口
	1万口当たり基準価額(C/D)	6.534円	6.780円	6.640円	6.546円	7.336円	7.112円

(注) 第88期首元本額は204,182,654円、第88～93期中追加設定元本額は4,658,390円、第88～93期中一部解約元本額は74,274,331円、1口当たり純資産額は、第88期0.6534円、第89期0.6780円、第90期0.6640円、第91期0.6546円、第92期0.7336円、第93期0.7112円です。

○損益の状況

項 目	第88期	第89期	第90期	第91期	第92期	第93期
	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	758,019	747,909	517,014	518,819	518,810	509,258
受取配当金	758,051	747,960	517,080	518,820	518,810	509,261
支払利息	△ 32	△ 51	△ 66	△ 1	—	△ 3
(B) 有価証券売買損益	△ 3,588,175	4,676,464	△ 2,216,785	△ 1,471,498	10,695,641	△ 3,176,441
売買益	49,101	4,850,739	309,711	—	10,695,846	30,380
売買損	△ 3,637,276	△ 174,275	△ 2,526,496	△ 1,471,498	△ 205	△ 3,206,821
(C) 信託報酬等	△ 106,681	△ 120,219	△ 75,427	△ 67,586	△ 79,564	△ 81,659
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,936,837	5,304,154	△ 1,775,198	△ 1,020,265	11,134,887	△ 2,748,842
(E) 前期繰越損益金	3,297,270	△ 41,834	3,463,303	1,413,472	118,420	10,747,065
(F) 追加信託差損益金	△ 71,591,923	△ 69,200,707	△ 47,553,556	△ 47,579,339	△ 47,606,234	△ 46,594,865
(配当等相当額)	(40,882,161)	(39,521,162)	(27,161,838)	(27,181,422)	(27,201,587)	(26,632,276)
(売買損益相当額)	(△112,474,084)	(△108,721,869)	(△74,715,394)	(△74,760,761)	(△74,807,821)	(△73,227,141)
(G) 計(D+E+F)	△ 71,231,490	△ 63,938,387	△ 45,865,451	△ 47,186,132	△ 36,352,927	△ 38,596,642
(H) 収益分配金	△ 413,450	△ 399,640	△ 274,633	△ 274,787	△ 274,942	△ 269,133
次期繰越損益金(G+H)	△ 71,644,940	△ 64,338,027	△ 46,140,084	△ 47,460,919	△ 36,627,869	△ 38,865,775
追加信託差損益金	△ 71,591,923	△ 69,200,707	△ 47,553,556	△ 47,579,339	△ 47,606,234	△ 46,594,865
(配当等相当額)	(40,882,161)	(39,521,162)	(27,161,838)	(27,181,422)	(27,201,587)	(26,632,276)
(売買損益相当額)	(△112,474,084)	(△108,721,869)	(△74,715,394)	(△74,760,761)	(△74,807,821)	(△73,227,141)
分配準備積立金	11,088,194	11,054,413	7,883,629	8,060,077	10,978,365	10,905,533
繰越損益金	△ 11,141,211	△ 6,191,733	△ 6,470,157	△ 7,941,657	—	△ 3,176,443

* 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(2021年11月16日～2022年5月16日)は以下の通りです。

項 目	第88期	第89期	第90期	第91期	第92期	第93期
	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日
a. 配当等収益(経費控除後)	651,339円	731,331円	441,589円	451,235円	515,127円	427,601円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	0円	0円	0円	0円	2,678,291円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	40,882,161円	39,521,162円	27,161,838円	27,181,422円	27,201,587円	26,632,276円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	10,850,305円	10,722,722円	7,716,673円	7,883,629円	8,059,889円	10,747,065円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	52,383,805円	50,975,215円	35,320,100円	35,516,286円	38,454,894円	37,806,942円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,533円	2,551円	2,572円	2,584円	2,797円	2,809円
g. 分配金	413,450円	399,640円	274,633円	274,787円	274,942円	269,133円
h. 分配金(1万口当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第88期	第89期	第90期	第91期	第92期	第93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。

ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムー
 クラスJPY、クラスAUD、クラスBRL、クラスZAR、クラスTRY、
 クラスUSD、クラスMXN

2021年9月30日決算
 (計算期間:2020年10月1日～2021年9月30日)

●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
運 用 方 針	米ドル建ての高利回り事業債を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指します。投資する事業債は、主としてBB+格(S&P社)以下(B-格未満は除く)またはBa1格(Moody's社)以下(B3格未満は除く)の格付が付与されている債券とします。格付をもたない債券への投資にあたっては、投資顧問会社によりB-格(S&P社)以上およびB3格(Moody's社)以上の格付と同等と判断される債券へ投資を行ないます。
投 資 対 象	米ドル建ての高利回り事業債
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
副 投 資 顧 問 会 社	J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク
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いたしております。

運用計算書
2021年9月30日に終了する計測期間
(米ドル)

収益	
債券利息(源泉税控除後)	8,843,292
収益合計	<u>8,843,292</u>
費用	
投資顧問報酬	926,461
管理費用	168,327
保管費用	33,985
当座借越利息	209
取引銀行報酬	6,955
受託報酬	50,537
法務報酬	1,155
立替費用	8,414
専門家報酬	21,930
雑費用	20,583
費用合計	<u>1,238,556</u>
純投資損益	<u>7,604,736</u>
投資有価証券売買に係る損益	727,760
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	5,001,533
当期実現純損益	<u>5,729,293</u>
投資有価証券評価差損益	7,113,339
外国為替先渡し契約に係る評価差損益	222,544
当期評価差損益	<u>7,335,883</u>
運用の結果による純資産の増減額	<u>20,669,912</u>

	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産
Class FA JPY Units (in JPY)	5,859	466,369	2,732,258,260
Class FB AUD Units (in JPY)	5,941	383,543	2,278,445,586
Class FC BRL Units (in JPY)	2,063	4,523,438	9,333,107,053
Class FD ZAR Units (in JPY)	3,204	136,004	435,816,359
Class FE TRY Units (in JPY)	1,548	735,410	1,138,600,591
Class FF USD Units (in JPY)	9,202	129,009	1,187,095,855
Class FG MXN Units (in JPY)	5,279	34,073	179,868,871

組入資産明細
2021年9月30日現在
(米ドル)

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
オーストラリア				
普通社債(固定金利債)				
USD	117,000	FMG RES AUG 2 4.3750% 01/04/31 144A	121,095	0.08
			<u>121,095</u>	<u>0.08</u>
		オーストラリア計	<u>121,095</u>	<u>0.08</u>
カナダ				
普通社債(固定金利債)				
USD	1,215,000	BAUSCH HLTH A 8.5000% 31/01/27 144A	1,299,290	0.84
USD	1,140,000	VALEANT PHARM 9.0000% 15/12/25 144A	1,202,699	0.78
USD	786,000	BAUSCH HEALTH 6.1250% 15/04/25 144A	801,704	0.52
USD	639,000	NOVA CHEMICALS CORP 5% 01/05/25 144A	674,944	0.44
USD	578,000	VALEANT PHARM 5.5000% 01/11/25 144A	586,670	0.38
USD	364,000	MEG ENERGY CO 7.1250% 01/02/27 144A	382,655	0.25
USD	250,000	GFL ENVIRON I 4.2500% 01/06/25 144A	257,500	0.17
USD	249,000	BAUSCH HEALTH 7.0000% 15/01/28 144A	253,980	0.16
USD	245,000	BAYTEX ENERGY 8.7500% 01/04/27 144A	252,963	0.16
USD	267,000	BAUSCH HEALTH 5.0000% 15/02/29 144A	248,160	0.16
USD	235,000	BAUSCH HEALTH 4.8750% 01/06/28 144A	243,225	0.16
USD	225,000	NOVA CHEMICALS CORP 5.25% 01/06/27	236,700	0.15
USD	170,000	ALBERTA ENERGY 8.1250% 15/09/30	234,564	0.15
USD	216,000	PANTHER BF AG 6.2500% 15/05/26 144A	227,070	0.15
USD	211,000	BAUSCH HEALTH 5.7500% 15/08/27 144A	221,023	0.14
USD	174,000	GFL ENVIRON I 3.7500% 01/08/25 144A	179,003	0.12
USD	160,000	VIDEOTRON LTD 3.6250% 15/06/29 144A	162,998	0.11
USD	162,000	NOVA CHEMICAL 4.2500% 15/05/29 144A	162,203	0.11
USD	155,000	1011778 BC UL 4.0000% 15/10/30 144A	152,869	0.10
USD	154,000	BAUSCH HEALTH 5.2500% 15/02/31 144A	140,456	0.09
USD	132,000	GFL ENVIRON I 4.7500% 15/06/29 144A	135,344	0.09
USD	135,000	BAUSCH HEALTH 5.0000% 30/01/28 144A	127,204	0.08
USD	124,000	PRECISION DRI 7.1250% 15/01/26 144A	127,100	0.08
USD	120,000	BAUSCH HEALTH 5.2500% 30/01/30 144A	111,207	0.07
USD	107,000	GFL ENVIRON I 4.3750% 15/08/29 144A	108,204	0.07
USD	99,000	GFL ENVIRON I 4.0000% 01/08/28 144A	98,258	0.06
USD	95,000	BCULC 3.8750% 15/01/28 144A	95,827	0.06
USD	78,000	SUPERIOR PLUS 4.5000% 15/03/29 144A	80,535	0.05
USD	77,000	1011778 BC UL 3.5000% 15/02/29 144A	76,423	0.05
USD	57,000	AUTOMATION TO 4.1250% 15/12/28 144A	58,425	0.04
USD	32,000	MEG ENERGY CO 6.5000% 15/01/25 144A	32,960	0.02
USD	24,000	PRECISION DRI 6.8750% 15/01/29 144A	24,962	0.02
			<u>8,997,125</u>	<u>5.83</u>
		カナダ計	<u>8,997,125</u>	<u>5.83</u>

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
ケイマン諸島				
その他債券				
USD	555,000	TRANSOCEAN 6.1250% 01/08/25 144A	371,850	0.24
			<u>371,850</u>	<u>0.24</u>
		ケイマン諸島計	<u>371,850</u>	<u>0.24</u>
フランス				
普通社債(固定金利債)				
USD	586,000	ALTICE FRANCE 8.1250% 01/02/27 144A	630,829	0.41
USD	390,000	NUMERICABLE SFR 7.375% 01/05/26 144	404,742	0.26
USD	308,000	ALTICE FRANCE 5.1250% 15/07/29 144A	300,300	0.19
USD	200,000	ALTICE FRANCE 5.5000% 15/10/29 144A	198,666	0.13
			<u>1,534,537</u>	<u>0.99</u>
		フランス計	<u>1,534,537</u>	<u>0.99</u>
アイルランド				
普通社債(固定金利債)				
USD	800,000	ARDAGH PKG FI 4.1250% 15/08/26 144A	828,000	0.54
USD	200,000	JAZZ SECURITI 4.3750% 15/01/29 144A	207,500	0.13
			<u>1,035,500</u>	<u>0.67</u>
		アイルランド計	<u>1,035,500</u>	<u>0.67</u>
ジャージー				
普通社債(固定金利債)				
USD	230,000	ADIANT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A	235,750	0.15
			<u>235,750</u>	<u>0.15</u>
		ジャージー計	<u>235,750</u>	<u>0.15</u>
リベリア				
普通社債(固定金利債)				
USD	45,000	ROYAL CARIBBE 9.1250% 15/06/23 144A	48,825	0.03
			<u>48,825</u>	<u>0.03</u>
		リベリア計	<u>48,825</u>	<u>0.03</u>
ルクセンブルグ				
普通社債(固定金利債)				
USD	648,000	TR OP / TR FI 5.3750% 01/09/25 144A	657,720	0.42
USD	424,000	TELECOM IT CAP 6.3750% 15/11/33	492,773	0.32
USD	215,000	ALTICE FINANC 5.7500% 15/08/29 144A	211,775	0.14
USD	134,000	TR OP / TR FI 5.1250% 01/04/29 144A	135,340	0.09
USD	100,000	ENDO LUX FIN 6.1250% 01/04/29 144A	99,500	0.06
			<u>1,597,108</u>	<u>1.03</u>
		ルクセンブルグ計	<u>1,597,108</u>	<u>1.03</u>
オランダ				
普通社債(固定金利債)				
USD	313,000	SENSATA TECHNO 4.875% 15/10/23 144A	332,953	0.22
USD	200,000	ALCOA NEDERLA 5.5000% 15/12/27 144A	214,500	0.14
USD	200,000	TRIVIUM PACK 5.5000% 15/08/26 144A	210,082	0.14
USD	200,000	UPC BROAD FIN 4.8750% 15/07/31 144A	205,250	0.13

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	171,000	SENSATA TECH 4.0000% 15/04/29 144A	174,634	0.11
USD	125,000	SENSATA TECHNO 5% 01/10/25 144A	138,013	0.09
			1,275,432	0.83
		オランダ計	1,275,432	0.83
		パナマ		
普通社債(固定金利債)				
USD	154,000	CARNIVAL CORP 4.0000% 01/08/28 144A	155,523	0.10
USD	76,000	CARNIVAL COR 10.5000% 01/02/26 144A	88,041	0.06
			243,564	0.16
		パナマ計	243,564	0.16
		イギリス		
変動金利債				
USD	250,000	BARCLAYS PLC FRN 15/09/69	282,500	0.18
USD	214,000	BARCLAYS PLC FRN 15/12/69	233,260	0.15
			515,760	0.33
		イギリス計	515,760	0.33
		アメリカ		
変動金利債				
USD	417,000	BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 AA	466,463	0.30
USD	530,000	ILFC E-CAP TRUST FRN 21/12/65 144A	442,349	0.29
USD	240,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T	280,550	0.18
USD	255,000	CITIGROUP INC FRN 15/11/69 P	278,269	0.18
USD	218,000	ENLINK MIDSTREAM FRN 15/12/69 C	166,737	0.11
USD	52,000	VIACOM INC FRN 28/02/57	59,540	0.04
			1,693,908	1.10
その他債券				
USD	274,000	AMERICAN AIRL 5.5000% 20/04/26 144A	287,765	0.18
USD	237,250	AMERICAN AIRL 5.7500% 20/04/29 144A	255,637	0.17
USD	99,000	LIBERTY MEDIA CV 4.0000% 15/11/29	75,608	0.05
USD	71,000	LIBERTY MEDIA CV 3.7500% 15/02/30	54,590	0.04
			673,600	0.44
普通社債(固定金利債)				
USD	1,912,000	HCA INC 5.875% 15/02/26	2,201,667	1.42
USD	1,707,000	DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24	1,834,785	1.18
USD	1,415,000	SPRINT CORP 7.625% 15/02/25	1,655,549	1.06
USD	1,296,000	CENTENE CORP 4.6250% 15/12/29 WI	1,409,399	0.90
USD	1,326,000	CCO HOLDINGS 4.7500% 01/03/30 144A	1,388,984	0.89
USD	1,304,000	CLEAR CHNL WO 5.1250% 15/08/27 144A	1,346,366	0.86
USD	1,220,000	TENET HEALTHC 7.5000% 01/04/25 144A	1,297,774	0.83
USD	1,205,000	CCO HOLDINGS 5.0000% 01/02/28 144A	1,257,929	0.80
USD	800,000	SPRINT CAP CORP 8.7500% 15/03/32	1,199,171	0.78
USD	1,095,000	CSC HOLDINGS 6.5000% 01/02/29 144A	1,188,074	0.77
USD	1,083,000	LEVEL 3 FIN INC 5.25% 15/3/26 WI	1,117,655	0.72
USD	1,000,000	HCA INC 5.375% 01/02/25	1,116,249	0.72
USD	1,010,000	UNITED RENTAL NA 5.2500% 15/01/30	1,104,687	0.72
USD	850,000	SPRINT CORP 7.125% 15/06/24 WI	967,894	0.63
USD	890,000	PHOTO HOLDING 8.5000% 01/10/26 144A	961,199	0.62
USD	950,000	FORD MOTOR CRED 5.5960% 07/01/22	960,734	0.62

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	934,000	STAPLES INC 7.5000% 15/04/26 144A	949,177	0.61
USD	896,000	NEXSTAR ESCRO 5.6250% 15/07/27 144A	947,196	0.61
USD	852,000	ALBERTSONS CO 7.5000% 15/03/26 144A	922,289	0.60
USD	913,000	BWAY HDGS CO 5.5% 15/04/24 144A	920,988	0.60
USD	856,000	NCR CORP 5.7500% 01/09/27 144A	905,219	0.59
USD	835,000	FORD MOTOR CRED 4.5420% 01/08/26	902,843	0.58
USD	845,000	CCO HDG LLC/CAP 5.125% 01/05/27 144	879,331	0.57
USD	830,000	POST HLDGS 5.75% 01/03/27 144A	861,124	0.56
USD	810,000	DIAMOND 1/2 FIN 7.125% 15/06/24 144	828,070	0.54
USD	720,000	HCA INC 5.3750% 01/09/26	824,399	0.53
USD	769,000	SS&C TECH INC 5.5000% 30/09/27 144A	812,255	0.53
USD	750,000	IHEARTCOMMUNICAT 6.3750% 01/05/26	789,374	0.51
USD	629,000	MGM GROWTH/MGM 5.7500% 01/02/27 WI	722,946	0.47
USD	703,000	VISTA OUTDOOR 4.5000% 15/03/29 144A	718,817	0.47
USD	665,000	ENCOMPASS HLTH 4.5000% 01/02/28	687,443	0.45
USD	636,000	BRINK'S CO/TH 4.6250% 15/10/27 144A	663,331	0.43
USD	614,000	NRG ENERGY IN 5.2500% 15/06/29 144A	657,008	0.43
USD	675,000	DAVITA INC 3.7500% 15/02/31 144A	656,744	0.43
USD	575,000	DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26	649,749	0.42
USD	625,000	LIVE NATION E 4.7500% 15/10/27 144A	635,093	0.41
USD	597,000	AMER AXLE & MFG 6.8750% 01/07/28	634,168	0.41
USD	580,000	DANA INC 5.3750% 15/11/27	611,899	0.40
USD	575,000	TARGA RES PRTNRS 5.8750% 15/04/26	600,515	0.39
USD	595,000	ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A	597,974	0.39
USD	509,000	NETFLIX INC 4.8750% 15/04/28 144A	587,105	0.38
USD	553,000	IMOLA MERGER 4.7500% 15/05/29 144A	570,972	0.37
USD	537,000	NUANCE COMMUNIC 5.6250% 15/12/26	555,795	0.36
USD	442,000	OCCIDENTAL PETE 8.5000% 15/07/27	554,078	0.36
USD	445,000	NETFLIX INC 5.8750% 15/11/28	544,013	0.35
USD	399,000	OCCIDENTAL PETE 8.8750% 15/07/30	542,640	0.35
USD	532,000	CCO HOLDINGS 4.2500% 01/02/31 144A	541,310	0.35
USD	490,000	LIVE NATION E 6.5000% 15/05/27 144A	537,775	0.35
USD	516,000	IRON MOUNTAIN 4.8750% 15/09/27 144A	534,705	0.35
USD	485,000	MGM RESORTS 5.5000% 15/04/27	528,650	0.34
USD	490,000	MEREDITH CORP 6.5000% 01/07/25	526,422	0.34
USD	497,000	TENET HEALTHC 6.2500% 01/02/27 144A	516,495	0.33
USD	493,000	FRONTIER COMM 5.0000% 01/05/28 144A	515,855	0.33
USD	486,000	SIRIUS XM RAD 5.0000% 01/08/27 144A	508,721	0.33
USD	479,000	CENTENE CORP 4.2500% 15/12/27 WI	502,006	0.33
USD	471,000	VICI PROPRTI 4.2500% 01/12/26 144A	492,289	0.32
USD	467,000	VAIL RESORTS 6.2500% 15/05/25 144A	492,101	0.32
USD	450,000	RANGE RESOURCES 9.2500% 01/02/26 WI	489,825	0.32
USD	448,000	SIRIUS XM RAD 5.5000% 01/07/29 144A	485,531	0.31
USD	448,000	VICI PROPRTI 4.6250% 01/12/29 144A	485,498	0.31
USD	443,000	CDK GLOBAL IN 5.2500% 15/05/29 144A	480,101	0.31
USD	445,000	EMBARQ CORP 7.995% 01/06/36	477,263	0.31
USD	450,000	GRIFFON CORP 5.7500% 01/03/28 WI	474,750	0.31
USD	465,000	STATION CAS 4.5000% 15/02/28 144A	473,138	0.31
USD	460,000	CENTURYTEL IN 4.0000% 15/02/27 144A	469,775	0.30
USD	445,000	ENTEGRIS INC 4.3750% 15/04/28 144A	466,138	0.30
USD	444,000	VISTRA OPERAT 5.6250% 15/02/27 144A	459,540	0.30

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	430,000	CINC BELL INC 8.0000% 15/10/25 144A	448,146	0.29
USD	405,000	COOPER-STAND 13.0000% 01/06/24 144A	445,500	0.29
USD	421,000	TENET HEALTHC 5.1250% 01/11/27 144A	440,998	0.29
USD	415,000	CHENIERE ENERGY 4.6250% 15/10/28 WI	436,933	0.28
USD	418,000	MEREDITH CORP 6.8750% 01/02/26	431,585	0.28
USD	415,000	CENTURYLINK I 5.1250% 15/12/26 144A	430,563	0.28
USD	335,000	SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28	427,963	0.28
USD	417,000	TENET HEALTHC 4.6250% 15/07/24 144A	423,255	0.27
USD	405,000	LABL ESCROW I 6.7500% 15/07/26 144A	423,225	0.27
USD	380,000	NEWELL RUBBERMAID INC 4.2% 01/04/26	420,410	0.27
USD	405,000	ARAMARK SERV 5.0000% 01/02/28 144A	417,150	0.27
USD	400,000	JELD-WEN INC 4.8750% 15/12/27 144A	416,000	0.27
USD	401,000	CENTRAL GARDEN 4.1250% 15/10/30	412,108	0.27
USD	389,000	AVANTOR FUNDI 4.6250% 15/07/28 144A	409,909	0.27
USD	375,000	TALLGRASS NRG 7.5000% 01/10/25 144A	405,469	0.26
USD	396,000	WYNN LAS VEGAS 5.5% 01/03/25 144A	405,393	0.26
USD	392,000	LAMB WESTON 4.875% 01/11/26 144A	402,184	0.26
USD	355,000	SOUTHWESTERN ENE 8.3750% 15/09/28	401,150	0.26
USD	436,000	WOLVERINE ESC 9.0000% 15/11/26 144A	401,120	0.26
USD	378,000	FREEPORT-MCMORAN 4.3750% 01/08/28	395,123	0.26
USD	384,000	B&G FOODS INC 5.25% 01/04/25	393,120	0.25
USD	370,000	MASTEC INC 4.5000% 15/08/28 144A	385,725	0.25
USD	355,000	TARGA RES PRTNRS 6.5000% 15/07/27	382,513	0.25
USD	370,000	ORGANON & CO/ 4.1250% 30/04/28 144A	378,270	0.25
USD	360,000	EDGEWELL PERS 5.5000% 01/06/28 144A	378,000	0.24
USD	365,000	TELEFLEX INC 4.2500% 01/06/28 144A	377,319	0.24
USD	378,000	ENERGIZER HLD 4.3750% 31/03/29 144A	375,165	0.24
USD	359,000	RHP HOTEL PPTY 4.7500% 15/10/27	372,534	0.24
USD	358,000	ON SEMICONDC 3.8750% 01/09/28 144A	369,309	0.24
USD	353,000	DIRECTV HLDGS 5.8750% 15/08/27 144A	368,673	0.24
USD	374,000	WMG ACQUISITI 3.0000% 15/02/31 144A	365,118	0.24
USD	364,000	HOLOGIC INC 3.2500% 15/02/29 144A	364,724	0.24
USD	350,000	AXALTA COAT/B 4.7500% 15/06/27 144A	364,424	0.24
USD	335,000	HEXION INC 7.8750% 15/07/27 144A	358,450	0.23
USD	345,000	DISH DBS CORP 5% 15/03/23	358,369	0.23
USD	341,000	COMMSCOPE FIN 6.0000% 01/03/26 144A	355,654	0.23
USD	341,000	ALLISON TRANS 4.7500% 01/10/27 144A	355,066	0.23
USD	292,000	NETFLIX INC 5.3750% 15/11/29 144A	353,320	0.23
USD	332,000	GOODYEAR TIRE 5.0000% 15/07/29 144A	352,750	0.23
USD	339,000	TARGA RES PRT 4.0000% 15/01/32 144A	350,865	0.23
USD	297,000	HOWMET AEROSPACE 5.9000% 01/02/27	348,233	0.23
USD	347,000	ALBERTSONS CO 3.5000% 15/03/29 144A	346,133	0.22
USD	329,000	HERC HOLDINGS 5.5000% 15/07/27 144A	344,628	0.22
USD	330,000	PG&E CORP 5.0000% 01/07/28	335,363	0.22
USD	315,000	FORD MOTOR CRED 4.2710% 09/01/27	335,081	0.22
USD	305,000	EQM MIDSTREAM 6.0000% 01/07/25 144A	334,448	0.22
USD	341,000	STAPLES INC 10.7500% 15/04/27 144A	332,049	0.22
USD	321,000	FREEPORT-MCMORAN 4.1250% 01/03/28	331,147	0.21
USD	345,000	PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A	330,597	0.21
USD	296,000	WESCO DISTRIB 7.2500% 15/06/28 144A	328,492	0.21
USD	320,000	RBS GLOBAL/RE 4.8750% 15/12/25 144A	327,840	0.21

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	315,000	ANTERO MIDSTR 5.7500% 15/01/28 144A	326,419	0.21
USD	308,000	COMMSCOPE FIN 8.2500% 01/03/27 144A	322,624	0.21
USD	308,000	TEMPUR SEALY 4.0000% 15/04/29 144A	318,281	0.21
USD	314,000	WYNN RESORTS 5.1250% 01/10/29 144A	317,140	0.21
USD	296,000	WESCO DISTRIB 7.1250% 15/06/25 144A	317,128	0.21
USD	304,000	CDW LLC/CDW FIN 4.2500% 01/04/28	317,075	0.21
USD	308,000	HILTON WORLDWIDE 4.8750% 01/04/27	316,773	0.21
USD	295,000	FORD MOTOR CRED 4.6870% 09/06/25	316,019	0.20
USD	315,000	ACCO BRANDS C 4.2500% 15/03/29 144A	314,606	0.20
USD	300,000	CHEMOURS CO 5.7500% 15/11/28 144A	313,875	0.20
USD	295,000	SABRE GLBL IN 7.3750% 01/09/25 144A	313,069	0.20
USD	280,000	LIBERTY MEDIA 8.2500% 01/02/30	311,276	0.20
USD	299,000	ENCINO ACQUIS 8.5000% 01/05/28 144A	307,223	0.20
USD	247,000	US CELLULAR 6.7000% 15/12/33	305,045	0.20
USD	274,000	CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y	304,483	0.20
USD	280,000	LAMAR MEDIA CORP 4.8750% 15/01/29	296,800	0.19
USD	280,000	HILL-ROM HLDG 4.3750% 15/09/27 144A	292,600	0.19
USD	286,000	CRESTWOOD MID PA 5.7500% 01/04/25	292,435	0.19
USD	282,000	HILTON GRAND VA 6.1250% 01/12/24 WI	291,955	0.19
USD	268,000	VINE ENERGY H 6.7500% 15/04/29 144A	289,775	0.19
USD	275,000	GCI LLC 4.7500% 15/10/28 144A	289,438	0.19
USD	288,000	ZAYO GROUP HO 4.0000% 01/03/27 144A	286,920	0.19
USD	275,000	STANDARD INDS 4.7500% 15/01/28 144A	286,344	0.19
USD	270,000	FORD MOTOR CRED 4.1250% 17/08/27	286,200	0.19
USD	270,000	FORD MOTOR CRED 4.1340% 04/08/25	286,123	0.19
USD	285,000	RHP HOTEL PPT 4.5000% 15/02/29 144A	285,713	0.19
USD	267,000	GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A	285,690	0.19
USD	270,000	NOVELIS CORP 4.7500% 30/01/30 144A	284,155	0.18
USD	272,000	IQVIA INC 5.0000% 15/05/27 144A	281,520	0.18
USD	270,000	HESS MIDSTREA 5.1250% 15/06/28 144A	280,800	0.18
USD	275,000	ENERGIZER HLD 4.7500% 15/06/28 144A	279,125	0.18
USD	266,000	GREIF INC 6.5000% 01/03/27 144A	277,970	0.18
USD	260,000	ALBERTSONS CO 4.6250% 15/01/27 144A	273,000	0.18
USD	265,000	AVIS BUDGET C 4.7500% 01/04/28 144A	272,288	0.18
USD	239,000	CENTURY TEL ENTP 6.8750% 15/01/28 G	271,863	0.18
USD	273,000	PACTIV EVERGR 4.0000% 15/10/27 144A	270,270	0.18
USD	190,000	FORD MOTOR CO 9.6250% 22/04/30	269,463	0.17
USD	247,000	YUM! BRANDS I 4.7500% 15/01/30 144A	268,613	0.17
USD	205,000	DCP MIDSTREAM 6.75% 15/09/37	264,450	0.17
USD	245,000	OWENS-BROCKWA 6.6250% 13/05/27 144A	263,375	0.17
USD	219,000	OCCIDENTAL PETE 8.0000% 15/07/25	262,253	0.17
USD	250,000	PETSMART INC/ 4.7500% 15/02/28 144A	258,305	0.17
USD	242,000	SPIRIT AEROSY 7.5000% 15/04/25 144A	256,290	0.17
USD	245,000	DOWNSTREAM D 10.5000% 15/02/23 144A	256,025	0.17
USD	243,000	ARCONIC CORP 6.0000% 15/05/25 144A	254,846	0.17
USD	246,000	CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 01/05/26 144	254,303	0.16
USD	240,000	CALIFORNIA RE 7.1250% 01/02/26 144A	252,900	0.16
USD	245,000	GRAY TELE INC 5.875% 15/07/26 144A	252,773	0.16
USD	239,000	CD&R SMOKEY B 6.7500% 15/07/25 144A	252,743	0.16
USD	238,000	ARCONIC ROLLE 6.1250% 15/02/28 144A	250,793	0.16
USD	235,000	NUSTAR LOGISTICS 5.625% 28/04/27	250,566	0.16

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	235,000	JELD-WEN INC 6.2500% 15/05/25 144A	247,925	0.16
USD	242,000	ENTERCOM MEDI 6.5000% 01/05/27 144A	246,840	0.16
USD	217,000	AMERIGAS FIN 5.875% 20/08/26	245,210	0.16
USD	243,000	GENESIS ENERGY 7.7500% 01/02/28	242,393	0.16
USD	230,000	VERTICAL US N 5.2500% 15/07/27 144A	242,075	0.16
USD	195,000	NEWELL RUBBERMAI 5.8750% 01/04/36	241,800	0.16
USD	226,000	HILTON DOMESTIC 4.8750% 15/01/30 WI	241,662	0.16
USD	240,000	DYCOM INDS 4.5000% 15/04/29 144A	240,900	0.16
USD	228,000	ORGANON & CO/ 5.1250% 30/04/31 144A	239,685	0.16
USD	240,000	CCO HOLDINGS 4.2500% 15/01/34 144A	238,800	0.15
USD	198,000	OCCIDENTAL PETE 6.1250% 01/01/31	238,586	0.15
USD	214,000	SPECTRUM BRAN 5.5000% 15/07/30 144A	235,935	0.15
USD	225,000	BUCKEYE PARTN 4.1250% 01/03/25 144A	232,875	0.15
USD	229,000	STATION CASIN 5.0000% 01/10/25 144A	232,830	0.15
USD	225,000	GLOBAL MEDICA 6.5000% 01/10/25 144A	232,380	0.15
USD	225,000	ENLINK MIDSTREAM 4.1500% 01/06/25	232,216	0.15
USD	221,000	AMER AXLE & MFG 6.5000% 01/04/27	230,242	0.15
USD	220,000	ACI WORLDWIDE 5.7500% 15/08/26 144A	229,900	0.15
USD	225,000	BUCKEYE PARTN 4.5000% 01/03/28 144A	228,938	0.15
USD	220,000	EQM MIDSTREAM 4.5000% 15/01/29 144A	228,250	0.15
USD	231,000	FRST STU BIDC 4.0000% 31/07/29 144A	227,034	0.15
USD	220,000	OCCIDENTAL PETE 3.4000% 15/04/26	226,600	0.15
USD	225,000	COMMScope INC 4.7500% 01/09/29 144A	225,281	0.15
USD	219,000	UNITED AIRLIN 4.3750% 15/04/26 144A	224,749	0.15
USD	216,000	ENLINK MIDSTREAM 4.4% 01/04/24	224,502	0.15
USD	207,000	SOUTHWESTERN ENE 5.3750% 15/03/30	223,560	0.14
USD	220,000	IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/31 144A	223,535	0.14
USD	215,000	NEXSTAR BROAD 4.7500% 01/11/28 144A	223,063	0.14
USD	217,000	BWX TECHNOLOG 4.1250% 15/04/29 144A	222,696	0.14
USD	225,000	CSC HOLDINGS 4.5000% 15/11/31 144A	222,188	0.14
USD	225,000	SINCLAIR TELE 4.1250% 01/12/30 144A	219,938	0.14
USD	209,000	TRANSDIGM INC 6.2500% 15/03/26 144A	218,405	0.14
USD	200,000	MATTEL INC 5.8750% 15/12/27 144A	216,500	0.14
USD	212,000	CORECIVIC INC 8.2500% 15/04/26	216,240	0.14
USD	210,000	UNITED RENTAL NA 3.8750% 15/02/31	214,988	0.14
USD	209,000	SRS DISTRIB 4.6250% 01/07/28 144A	213,571	0.14
USD	205,000	SCOTTS MIRACLE 4.5000% 15/10/29	213,456	0.14
USD	205,000	PERFORMANCE F 5.5000% 15/10/27 144A	213,200	0.14
USD	215,000	ADT SEC CORP 4.1250% 01/08/29 144A	213,065	0.14
USD	170,000	L BRANDS 6.75% 01/07/36	211,832	0.14
USD	200,000	MARRIOTT OWNE 6.1250% 15/09/25 144A	211,250	0.14
USD	203,000	IHEARTCOMMUNI 5.2500% 15/08/27 144A	211,120	0.14
USD	175,000	FORD MOTOR CO 9.0000% 22/04/25	210,984	0.14
USD	205,000	SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26	209,572	0.14
USD	207,000	TALLGRASS NRG 6.0000% 01/09/31 144A	208,810	0.14
USD	185,000	SPRINGLEAF FINANCE 6.8750% 15/03/25	208,125	0.13
USD	200,000	FORD MOTOR CRED 4.0000% 13/11/30	208,000	0.13
USD	202,000	LUMEN TECH IN 5.3750% 15/06/29 144A	207,050	0.13
USD	200,000	FORD MOTOR CRED 3.3750% 13/11/25	206,416	0.13
USD	198,000	OASIS MIDSTRE 8.0000% 01/04/29 144A	205,920	0.13
USD	200,000	IQVIA INC 5.0000% 15/10/26 144A	205,250	0.13

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	201,000	OCEANEERING INTL 6.0000% 01/02/28	204,518	0.13
USD	199,000	COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 144A	201,488	0.13
USD	196,000	CINCINNATI BELL 7% 15/07/24 144A	199,675	0.13
USD	195,000	BOOZ ALLEN & 3.8750% 01/09/28 144A	199,664	0.13
USD	200,000	MADISON IAQ L 4.1250% 30/06/28 144A	199,500	0.13
USD	200,000	ATLAS LUXCO 4 4.6250% 01/06/28 144A	199,000	0.13
USD	200,000	OLYMPUS WTR H 4.2500% 01/10/28 144A	197,000	0.13
USD	196,000	BLACK KNIGHT 3.6250% 01/09/28 144A	196,980	0.13
USD	200,000	MAV ACQUISITI 5.7500% 01/08/28 144A	196,500	0.13
USD	191,000	TRIMAS CORP 4.1250% 15/04/29 144A	196,224	0.13
USD	189,000	MIDCONTINENT 5.3750% 15/08/27 144A	196,088	0.13
USD	181,000	COMSTOCK RE I 6.7500% 01/03/29 144A	195,254	0.13
USD	194,000	STERICYCLE IN 3.8750% 15/01/29 144A	195,046	0.13
USD	195,000	PERFORMANCE F 4.2500% 01/08/29 144A	194,756	0.13
USD	184,000	PM GENERAL PU 9.5000% 01/10/28 144A	194,414	0.13
USD	183,000	ALLEGHENY TECH 5.8750% 01/12/27	194,322	0.13
USD	183,000	MGM GROWTH/MG 3.8750% 15/02/29 144A	193,980	0.13
USD	190,000	HOLLY PAR/FIN 5.0000% 01/02/28 144A	192,660	0.12
USD	175,000	FORD MOTOR CO 8.5000% 21/04/23	192,047	0.12
USD	190,000	UBER TECHNOLO 4.5000% 15/08/29 144A	191,425	0.12
USD	187,000	YUM! BRANDS INC 3.6250% 15/03/31	189,338	0.12
USD	187,000	ELEMENT SOLN 3.8750% 01/09/28 144A	188,870	0.12
USD	184,000	ALBERTSONS CO 3.2500% 15/03/26 144A	186,530	0.12
USD	173,000	YUM! BRANDS INC 4.6250% 31/01/32	184,245	0.12
USD	225,000	COOPER STANDARD 5.625% 15/11/26	183,903	0.12
USD	175,000	POST HOLDINGS 5.6250% 15/01/28 144A	183,663	0.12
USD	173,000	FRONTIER COMM 5.8750% 15/10/27 144A	183,380	0.12
USD	167,000	MGM RESORTS 5.7500% 15/06/25	182,808	0.12
USD	182,000	SCOTTS MIRACL 4.0000% 01/04/31 144A	182,091	0.12
USD	166,000	BLUE RACER MI 7.6250% 15/12/25 144A	179,695	0.12
USD	184,000	EMERGENT BIOS 3.8750% 15/08/28 144A	179,179	0.12
USD	270,000	DIAMOND SPORT 5.3750% 15/08/26 144A	178,840	0.12
USD	173,000	LIVE NATION E 5.6250% 15/03/26 144A	178,839	0.12
USD	188,000	PLANTRONICS I 4.7500% 01/03/29 144A	177,745	0.12
USD	153,000	SABRE GLBL IN 9.2500% 15/04/25 144A	176,333	0.11
USD	180,000	GENESIS ENERGY 6.2500% 15/05/26	176,175	0.11
USD	171,000	PAR PHARMA IN 7.5000% 01/04/27 144A	174,206	0.11
USD	168,000	NATIONSTAR MT 5.5000% 15/08/28 144A	173,040	0.11
USD	165,000	AVIS BUDGET C 5.7500% 15/07/27 144A	172,013	0.11
USD	165,000	EQM MIDSTREAM 4.7500% 15/01/31 144A	171,600	0.11
USD	160,000	VALEANT PHARM 9.2500% 01/04/26 144A	170,800	0.11
USD	162,000	JB POINDEXTER 7.1250% 15/04/26 144A	170,505	0.11
USD	167,000	NIELSEN CO LUX 5% 01/02/25 144A	170,340	0.11
USD	165,000	LEVEL 3 FIN I 4.6250% 15/09/27 144A	170,064	0.11
USD	151,000	OCCIDENTAL PETE 5.8750% 01/09/25	169,309	0.11
USD	160,000	GARTNER GROUP 4.5000% 01/07/28 144A	168,000	0.11
USD	162,000	NCR CORP 5.1250% 15/04/29 144A	167,014	0.11
USD	162,000	STANDARD IND 5% 15/02/27 144A	166,860	0.11
USD	165,000	LIVE NATION E 4.8750% 01/11/24 144A	166,856	0.11
USD	160,000	CEDAR FAIR LP 5.5000% 01/05/25 144A	166,779	0.11
USD	156,000	CVR PARTNERS 6.1250% 15/06/28 144A	163,800	0.11

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	148,000	DCP MIDSTREAM OP 5.3750% 15/07/25	163,540	0.11
USD	166,000	AXALTA COATIN 3.3750% 15/02/29 144A	161,850	0.10
USD	150,000	CARPENTER TECH 6.3750% 15/07/28	161,487	0.10
USD	155,000	COVEY PARK ENERG 7.5% 15/05/25 144A	161,293	0.10
USD	125,000	EQT CORP 7.5000% 01/02/30	161,250	0.10
USD	165,000	ALLISON TRANS 3.7500% 30/01/31 144A	160,140	0.10
USD	155,000	PRESIDIO HLDG 4.8750% 01/02/27 144A	160,038	0.10
USD	156,000	BOOZ ALLEN & 4.0000% 01/07/29 144A	159,884	0.10
USD	146,000	ANTERO MIDSTR 7.8750% 15/05/26 144A	159,842	0.10
USD	150,000	SIX FLAGS THE 7.0000% 01/07/25 144A	159,375	0.10
USD	163,000	SBA COMMUNICA 3.1250% 01/02/29 144A	158,240	0.10
USD	157,000	SCOTTS MIRACL 4.3750% 01/02/32 144A	158,178	0.10
USD	155,000	TENET HEALTHC 4.2500% 01/06/29 144A	157,713	0.10
USD	154,000	BUILDERS FIRS 4.2500% 01/02/32 144A	157,693	0.10
USD	138,000	EQT CORP 6.6250% 01/02/25	157,665	0.10
USD	154,000	GLOBAL INFRAS 5.6250% 01/06/29 144A	157,527	0.10
USD	154,000	DT MIDSTREAM 4.1250% 15/06/29 144A	157,080	0.10
USD	153,000	CLEVELAND-CLI 4.6250% 01/03/29 144A	156,538	0.10
USD	126,000	OCCIDENTAL PETE 6.6250% 01/09/30	155,653	0.10
USD	150,000	WR GRACE HOLD 4.8750% 15/06/27 144A	155,160	0.10
USD	145,000	FORTERRA FIN 6.5000% 15/07/25 144A	155,150	0.10
USD	155,000	ZI TECH/ZI FI 3.8750% 01/02/29 144A	155,000	0.10
USD	135,000	DCP MIDSTREAM OP 5.6250% 15/07/27	153,900	0.10
USD	156,000	CALPINE CORP 4.6250% 01/02/29 144A	153,691	0.10
USD	150,000	UNIVISION COM 4.5000% 01/05/29 144A	153,000	0.10
USD	148,000	NEWS CORP 3.8750% 15/05/29 144A	152,625	0.10
USD	147,000	BWX TECHNOLOG 4.1250% 30/06/28 144A	151,043	0.10
USD	140,000	GOODYEAR TIRE 5.2500% 30/04/31	149,800	0.10
USD	130,000	SPRINGLEAF FIN 6.6250% 15/01/28	149,175	0.10
USD	141,000	AVIS BUDGET C 5.3750% 01/03/29 144A	148,728	0.10
USD	152,000	AMER AXLE & MFG 5.0000% 01/10/29	148,314	0.10
USD	126,000	OCCIDENTAL PETE 6.3750% 01/09/28	148,064	0.10
USD	160,000	NATIONAL CINE 5.8750% 15/04/28 144A	146,894	0.10
USD	145,000	SIX FLAGS ENT 4.875% 31/07/24 144A	146,088	0.09
USD	142,000	CDW LLC/CDW FIN 3.2500% 15/02/29	145,604	0.09
USD	145,000	CALPINE CORP 5.0000% 01/02/31 144A	145,363	0.09
USD	140,000	VICI PROPRTI 3.7500% 15/02/27 144A	145,075	0.09
USD	145,000	TENNECO INC 5.375% 15/12/24	145,000	0.09
USD	141,000	TENET HEALTHC 4.6250% 01/09/24 144A	144,701	0.09
USD	139,000	OWENS & MINOR 4.5000% 31/03/29 144A	140,564	0.09
USD	144,000	LEVEL 3 FIN I 3.6250% 15/01/29 144A	139,860	0.09
USD	135,000	TENET HEALTHC 4.8750% 01/01/26 144A	139,641	0.09
USD	146,000	PBF HOLDING C 9.2500% 15/05/25 144A	139,248	0.09
USD	135,000	HESS MIDSTREA 4.2500% 15/02/30 144A	136,688	0.09
USD	128,000	MIDAS OPCO HL 5.6250% 15/08/29 144A	135,200	0.09
USD	132,000	COTY INC 5.0000% 15/04/26 144A	134,640	0.09
USD	128,000	CHENIERE ENER 4.0000% 01/03/31 144A	134,560	0.09
USD	130,000	BOYNE USA 4.7500% 15/05/29 144A	133,900	0.09
USD	132,000	ENTERCOM MEDI 6.7500% 31/03/29 144A	133,320	0.09
USD	130,000	TENNECO INC 5.1250% 15/04/29 144A	132,844	0.09
USD	133,000	WABASH NATION 4.5000% 15/10/28 144A	132,501	0.09

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	126,000	ADVANCED DRAI 5.0000% 30/09/27 144A	131,544	0.09
USD	132,000	ROCKET MTGE L 2.8750% 15/10/26 144A	131,340	0.09
USD	115,000	EQM MIDSTREAM 6.5000% 01/07/27 144A	129,419	0.08
USD	114,000	OCCIDENTAL PETE 5.5000% 01/12/25	126,717	0.08
USD	115,000	LAMB WESTON H 4.8750% 15/05/28 144A	126,644	0.08
USD	123,000	NCR CORP 5.0000% 01/10/28 144A	126,460	0.08
USD	125,000	VIAVI SOLUTIO 3.7500% 01/10/29 144A	125,469	0.08
USD	112,000	TENNECO INC 7.8750% 15/01/29 144A	125,020	0.08
USD	115,000	ALLISON TRANS 5.8750% 01/06/29 144A	124,976	0.08
USD	120,000	PRESTIGE BRAN 5.1250% 15/01/28 144A	124,800	0.08
USD	123,000	NOVELIS CORP 3.2500% 15/11/26 144A	124,230	0.08
USD	122,000	SIRIUS XM RAD 4.0000% 15/07/28 144A	123,983	0.08
USD	115,000	YUM! BRANDS I 7.7500% 01/04/25 144A	123,052	0.08
USD	122,000	CLAR SCI HLD 3.8750% 01/07/28 144A	122,000	0.08
USD	116,000	AVIS BUDGET C 5.7500% 15/07/27 144A	120,906	0.08
USD	114,000	ENCOMPASS HLTH 4.7500% 01/02/30	119,985	0.08
USD	116,000	AMER AXLE & MFG 6.2500% 15/03/26	119,480	0.08
USD	113,000	SPIRIT AEROSY 5.5000% 15/01/25 144A	118,933	0.08
USD	120,000	NRG ENERGY IN 3.8750% 15/02/32 144A	118,928	0.08
USD	120,000	TENNECO INC 5% 15/07/26	117,975	0.08
USD	114,000	CALPINE CORP 5.25% 01/06/26 144A	117,275	0.08
USD	109,000	CINEMARK USA 8.7500% 01/05/25 144A	116,971	0.08
USD	108,000	CCO HOLDINGS 5.3750% 01/06/29 144A	116,861	0.08
USD	119,000	API GROUP DE 4.1250% 15/07/29 144A	116,602	0.08
USD	110,000	IRB HOLDING C 7.0000% 15/06/25 144A	116,600	0.08
USD	114,000	ENTEGRIS INC 3.6250% 01/05/29 144A	116,320	0.08
USD	113,000	NGL EN OP/FIN 7.5000% 01/02/26 144A	115,399	0.07
USD	109,000	CNX RESOURCES 6.0000% 15/01/29 144A	114,995	0.07
USD	111,000	CLEVELAND-CLI 4.8750% 01/03/31 144A	114,608	0.07
USD	110,000	ACADIA HEALTH 5.0000% 15/04/29 144A	114,538	0.07
USD	120,000	STANDARD INDS 3.3750% 15/01/31 144A	114,322	0.07
USD	111,000	SUNOCO LP/FIN 4.5000% 15/05/29	112,918	0.07
USD	110,000	PTC INC 4.0000% 15/02/28 144A	112,750	0.07
USD	118,000	COMMSCOPE TECH FIN 5% 15/03/27 144A	112,552	0.07
USD	102,000	NUSTAR LOGISTICS 6.3750% 01/10/30	112,200	0.07
USD	105,000	VICI PROPRTI 4.1250% 15/08/30 144A	111,673	0.07
USD	107,000	COMSTOCK RE I 5.8750% 15/01/30 144A	111,649	0.07
USD	110,000	NATIONSTAR MT 5.1250% 15/12/30 144A	111,375	0.07
USD	100,000	ANTERO RESOUR 7.6250% 01/02/29 144A	110,750	0.07
USD	102,000	NUSTAR LOGISTICS 5.7500% 01/10/25	110,160	0.07
USD	110,000	GRAY TELE INC 4.7500% 15/10/30 144A	108,075	0.07
USD	105,000	CRESTWOOD MID 5.6250% 01/05/27 144A	108,024	0.07
USD	104,000	ASBURY AUTO GRP 4.5000% 01/03/28 WI	107,250	0.07
USD	100,000	SPRINGLEAF FIN 6.1250% 15/03/24	106,860	0.07
USD	100,000	ALLIED UNIVER 6.6250% 15/07/26 144A	105,875	0.07
USD	103,000	TALLGRASS NRG 6.0000% 31/12/30 144A	105,554	0.07
USD	102,000	DCP MIDSTREAM OP 3.875% 15/03/23	105,060	0.07
USD	99,000	SUMMIT MATERI 5.2500% 15/01/29 144A	104,292	0.07
USD	96,000	HILTON DOMEST 5.7500% 01/05/28 144A	103,080	0.07
USD	99,000	ARCHROCK LP/F 6.2500% 01/04/28 144A	102,404	0.07
USD	101,000	VISTRA OPERAT 4.3750% 01/05/29 144A	101,724	0.07

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	94,000	SPECTRUM BRAN 5.0000% 01/10/29 144A	101,168	0.07
USD	95,000	MGM RESORTS 6.7500% 01/05/25	100,463	0.07
USD	88,000	ANTERO RESOUR 8.3750% 15/07/26 144A	99,440	0.06
USD	88,000	RANGE RESOURC 8.2500% 15/01/29 144A	99,143	0.06
USD	95,000	TEREX CORP 5.0000% 15/05/29 144A	98,681	0.06
USD	95,000	RP ESCROW ISS 5.2500% 15/12/25 144A	97,494	0.06
USD	95,000	KAISER ALUMIN 4.5000% 01/06/31 144A	97,457	0.06
USD	95,000	PGT INNOVATIO 4.3750% 01/10/29 144A	95,874	0.06
USD	95,000	CHENIERE ENER 3.2500% 31/01/32 144A	95,197	0.06
USD	92,000	GARTNER GROUP 3.7500% 01/10/30 144A	95,045	0.06
USD	95,000	EDGEWELL PERS 4.1250% 01/04/29 144A	94,763	0.06
USD	90,000	WMG ACQUISITI 3.8750% 15/07/30 144A	94,176	0.06
USD	90,000	ANTERO MIDSTR 5.7500% 01/03/27 144A	92,925	0.06
USD	91,000	SENSATA TECHN 3.7500% 15/02/31 144A	91,569	0.06
USD	88,000	SUBURBAN PROP 5.0000% 01/06/31 144A	91,441	0.06
USD	92,000	NRG ENERGY IN 3.3750% 15/02/29 144A	91,080	0.06
USD	85,000	SCIENCE APP 4.8750% 01/04/28 144A	88,188	0.06
USD	78,000	EQT CORP 5.0000% 15/01/29	88,033	0.06
USD	85,000	EQT CORP 3.1250% 15/05/26 144A	87,355	0.06
USD	87,000	TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A	87,326	0.06
USD	83,000	ENLINK MIDSTREAM PRT 4.85% 15/07/26	87,183	0.06
USD	86,000	ARCHES BUYER 4.2500% 01/06/28 144A	87,183	0.06
USD	85,000	SWITCH LTD 3.7500% 15/09/28 144A	86,275	0.06
USD	80,000	JAGUAR HL / P 5.0000% 15/06/28 144A	86,000	0.06
USD	81,000	JAGUAR HL / P 4.6250% 15/06/25 144A	84,240	0.05
USD	130,000	PBF HOLDING CO 6.0000% 15/02/28	84,175	0.05
USD	80,000	MATTEL INC 3.7500% 01/04/29 144A	83,176	0.05
USD	85,000	LUMEN TECH IN 4.5000% 15/01/29 144A	82,875	0.05
USD	78,000	OASIS PETROLE 6.3750% 01/06/26 144A	81,714	0.05
USD	81,000	ADAPTHEALTH L 4.6250% 01/08/29 144A	81,000	0.05
USD	78,000	DT MIDSTREAM 4.3750% 15/06/31 144A	80,633	0.05
USD	79,000	HILTON DOMEST 3.7500% 01/05/29 144A	79,790	0.05
USD	73,000	CENTURYLINK INC 5.6250% 01/04/25	79,570	0.05
USD	78,000	KENNEDY-WILSON 4.7500% 01/03/29	79,365	0.05
USD	79,000	CVR PART / NITROGE 9.25% 15/06/23 1	79,190	0.05
USD	80,000	NRG ENERGY IN 3.6250% 15/02/31 144A	78,922	0.05
USD	76,000	TWILIO INC 3.8750% 15/03/31	78,660	0.05
USD	77,000	KENNEDY-WILSON 5.0000% 01/03/31	78,636	0.05
USD	78,000	ALLEGHENY TECH 4.8750% 01/10/29	78,293	0.05
USD	76,000	SYNAPTICS INC 4.0000% 15/06/29 144A	77,747	0.05
USD	76,000	TWILIO INC 3.6250% 15/03/29	77,569	0.05
USD	78,000	ONEMAIN FINANCE 4.0000% 15/09/30	77,513	0.05
USD	75,000	BUCKEYE PARTNERS 4.1250% 01/12/27	76,500	0.05
USD	74,000	DISH DBS CORP 5.875% 15/07/22	76,035	0.05
USD	75,000	SPECTRUM BRAN 3.8750% 15/03/31 144A	75,938	0.05
USD	71,000	ROCKCLIFF ENE 5.5000% 15/10/29 144A	72,299	0.05
USD	70,000	TALLGRASS NRG 5.5000% 15/01/28 144A	71,575	0.05
USD	69,000	SPECTRUM BRANDS 5.75% 15/07/25	70,985	0.05
USD	70,000	QUICKEN LOANS 3.8750% 01/03/31 144A	70,875	0.05
USD	70,000	QUICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A	70,788	0.05
USD	67,000	ANTERO RESOUR 5.3750% 01/03/30 144A	70,719	0.05

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	66,000	CHESAPEAKE EN 5.8750% 01/02/29 144A	70,373	0.05
USD	66,000	CHESAPEAKE EN 5.5000% 01/02/26 144A	69,135	0.04
USD	67,000	ALBERTSONS COS 5.7500% 15/03/25 WI	68,005	0.04
USD	66,000	SWITCH LTD 4.1250% 15/06/29 144A	67,932	0.04
USD	65,000	WEEKLEY HM LL 4.8750% 15/09/28 144A	67,711	0.04
USD	67,000	SCRIPPS ESCRO 3.8750% 15/01/29 144A	67,355	0.04
USD	64,000	HILTON DOMEST 5.3750% 01/05/25 144A	66,640	0.04
USD	60,000	MGM GROWTH/FIN 4.5% 01/09/26	65,175	0.04
USD	62,000	ARCHROCK LP/F 6.8750% 01/04/27 144A	65,100	0.04
USD	60,000	TARGA RES PRTNRS 4.8750% 01/02/31	64,829	0.04
USD	60,000	DANA INC 5.6250% 15/06/28	64,350	0.04
USD	62,000	MATTEL INC 3.3750% 01/04/26 144A	64,077	0.04
USD	60,000	UNITED RENTALS 5.5% 15/05/27	63,075	0.04
USD	63,000	SYNEOS HEALTH 3.6250% 15/01/29 144A	62,843	0.04
USD	60,000	OCCIDENTAL PETE 3.5000% 15/06/25	62,250	0.04
USD	62,000	NOVELIS CORP 3.8750% 15/08/31 144A	61,443	0.04
USD	48,000	L BRANDS 6.875% 01/11/35	60,436	0.04
USD	60,000	SIRIUS XM RAD 4.1250% 01/07/30 144A	60,420	0.04
USD	58,000	SERVICE CORP 4.0000% 15/05/31	60,030	0.04
USD	60,000	ONEMAIN FINANCE 3.5000% 15/01/27	59,828	0.04
USD	57,000	NESCO HOLDING 5.5000% 15/04/29 144A	58,853	0.04
USD	57,000	ALLEGHENY TECH 5.1250% 01/10/31	57,285	0.04
USD	55,000	SIRIUS XM RAD 3.1250% 01/09/26 144A	55,612	0.04
USD	55,000	GAP INC/THE 3.6250% 01/10/29 144A	55,206	0.04
USD	50,000	PRIME SEC/FIN 5.7500% 15/04/26 144A	54,125	0.04
USD	56,000	COINBASE GLOB 3.3750% 01/10/28 144A	54,044	0.04
USD	56,000	COINBASE GLOB 3.6250% 01/10/31 144A	53,388	0.03
USD	50,000	NIELSEN FINAN 5.6250% 01/10/28 144A	51,685	0.03
USD	50,000	PG&E CORP 5.2500% 01/07/30	51,063	0.03
USD	50,000	BUCKEYE PARTNERS 3.95% 01/12/26	51,000	0.03
USD	50,000	COLGATE ENERG 5.8750% 01/07/29 144A	50,667	0.03
USD	46,000	GOODYEAR TIRE 5.2500% 15/07/31 144A	49,165	0.03
USD	48,000	HILTON DOMEST 4.0000% 01/05/31 144A	48,861	0.03
USD	47,000	SM ENERGY CO 6.5000% 15/07/28	48,655	0.03
USD	45,000	T-MOBILE USA INC 4.7500% 01/02/28	47,869	0.03
USD	45,000	PERFORMANCE F 6.8750% 01/05/25 144A	47,644	0.03
USD	45,000	GAP INC/THE 3.8750% 01/10/31 144A	45,212	0.03
USD	46,000	CATALENT PHAR 3.1250% 15/02/29 144A	44,850	0.03
USD	44,000	HEALTHQUITY 4.5000% 01/10/29 144A	44,715	0.03
USD	45,000	LIVE NATION E 3.7500% 15/01/28 144A	44,663	0.03
USD	44,000	GARTNER GROUP 3.6250% 15/06/29 144A	44,647	0.03
USD	40,000	NEWELL BRANDS I 4.8750% 01/06/25	44,210	0.03
USD	40,000	EQT MIDSTREAM PT 5.5000% 15/07/28	43,945	0.03
USD	43,000	ROCKET MTGE L 4.0000% 15/10/33 144A	42,785	0.03
USD	41,000	SINCLAIR TELE 5.875% 15/3/26 144 A	41,871	0.03
USD	38,000	APACHE CORP 4.8750% 15/11/27	41,561	0.03
USD	38,000	APACHE CORP 4.6250% 15/11/25	41,040	0.03
USD	39,000	ASBURY AUTO GRP 4.7500% 01/03/30 WI	40,804	0.03
USD	39,000	ROLLER BEARIN 4.3750% 15/10/29 144A	39,926	0.03
USD	38,000	CNX MID PART 4.7500% 15/04/30 144A	38,423	0.02
USD	35,000	TARGA RES PRT 5.3750% 01/02/27 144A	36,274	0.02

通貨	種類 / 額面 ⁽¹⁾	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	34,000	EQT MIDSTREAM P 4.7500% 15/07/23 5Y	35,445	0.02
USD	32,000	MARRIOTT OWNE 4.5000% 15/06/29 144A	32,480	0.02
USD	33,000	TREEHOUSE FOODS 4.0000% 01/09/28	32,258	0.02
USD	29,000	DEVON ENERGY 5.8750% 15/06/28 144A	31,962	0.02
USD	30,000	TALLGRASS NRG 6.0000% 01/03/27 144A	31,200	0.02
USD	30,000	ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A	30,900	0.02
USD	25,000	TRIUMPH GROUP 8.8750% 01/06/24 144A	27,500	0.02
USD	26,000	VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A	26,553	0.02
USD	24,000	CEDAR FAIR LP 5.3750% 15/04/27	24,660	0.02
USD	23,000	EQT MIDSTREAM PT 4.1250% 01/12/26	23,746	0.02
USD	18,000	HCA INC 5.6250% 01/09/28	21,409	0.01
USD	20,000	MGM RESORTS INTL 4.625% 01/09/26	21,025	0.01
USD	20,000	VISTRA OPERAT 5.0000% 31/07/27 144A	20,593	0.01
USD	15,000	L BRANDS INC 9.3750% 01/07/25 144A	19,088	0.01
USD	18,000	TRIPADVISOR I 7.0000% 15/07/25 144A	19,080	0.01
USD	15,000	NUSTAR LOGISTICS 6.0000% 01/06/26	16,280	0.01
USD	14,000	MARRIOTT OWNERS 4.7500% 15/01/28 WI	14,280	0.01
USD	13,000	SM ENERGY CO 6.6250% 15/01/27	13,330	0.01
USD	10,000	NCR CORP 6.1250% 01/09/29 144A	10,830	0.01
USD	10,000	POST HOLDINGS 5.5000% 15/12/29 144A	10,607	0.01
USD	10,000	DAVITA INC 4.6250% 01/06/30 144A	10,300	0.01
USD	3,000	HOWMET AEROSPACE 6.8750% 01/05/25	3,503	0.00
			<u>129,156,772</u>	<u>83.67</u>
		アメリカ計	<u>131,524,280</u>	<u>85.21</u>
		投資有価証券合計	<u>147,500,826</u>	<u>95.55</u>

(1) 額面価格は発行通貨建て表示

外国為替先渡し契約

2021年9月30日現在

通貨(買い)		通貨(売り)		満期日	未実現損益(米ドル)
AUD	9,822	USD	7,275	October 08, 2021	(202)
TRY	38,788	USD	4,550	October 08, 2021	(220)
TRY	4,779,047	USD	565,130	October 08, 2021	(31,495)
BRL	90,346,316	USD	17,017,000	November 03, 2021	(421,357)
BRL	135,638,271	USD	25,526,000	November 03, 2021	(610,714)
BRL	136,750,035	USD	25,775,000	November 03, 2021	(655,494)
USD	61,967	TRY	523,116	October 08, 2021	3,555
USD	122,551	AUD	166,694	October 08, 2021	2,503
USD	49,379	TRY	433,177	October 20, 2021	1,317
USD	12,128	ZAR	174,233	October 08, 2021	632
USD	5,374	TRY	45,372	October 08, 2021	308
USD	8,292	MXN	166,073	October 08, 2021	198
USD	26,047	TRY	231,682	October 08, 2021	177
USD	1,945	MXN	38,958	October 08, 2021	47
USD	909	ZAR	13,149	October 08, 2021	42
USD	339	ZAR	4,874	October 08, 2021	18
USD	18	ZAR	259	October 08, 2021	1
USD	43,849	AUD	60,885	October 20, 2021	(1)
USD	8,098	BRL	44,162	November 03, 2021	(13)
USD	244,309	BRL	1,332,218	November 03, 2021	(405)
MXN	16,809,804	USD	838,158	October 08, 2021	(18,864)
MXN	13,472,171	USD	675,362	October 20, 2021	(19,948)
ZAR	28,547,832	USD	1,981,057	October 08, 2021	(97,395)
ZAR	28,005,038	USD	1,946,633	October 20, 2021	(101,896)
AUD	12,801,166	USD	9,377,019	October 20, 2021	(157,497)
JPY	1,259,004,174	USD	11,446,126	October 08, 2021	(201,888)
BRL	90,026,073	USD	16,759,544	November 03, 2021	(222,727)
AUD	12,947,227	USD	9,564,192	October 08, 2021	(239,948)
TRY	45,803,298	USD	5,326,019	October 20, 2021	(244,060)
JPY	1,244,419,318	USD	11,367,707	October 20, 2021	(252,812)
TRY	41,351,157	USD	4,915,143	October 08, 2021	(297,808)
USD	117,121	JPY	12,903,552	October 08, 2021	1,879
USD	74,551	JPY	8,203,464	October 08, 2021	1,286
JPY	1,102,244	USD	10,028	October 08, 2021	(184)
					(3,562,965)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年8月19日）

作成対象期間（2020年8月20日～2021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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	中率			
15期(2017年8月21日)	円 10,208		% △0.0	% 64.0	% —	百万円 17,754
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

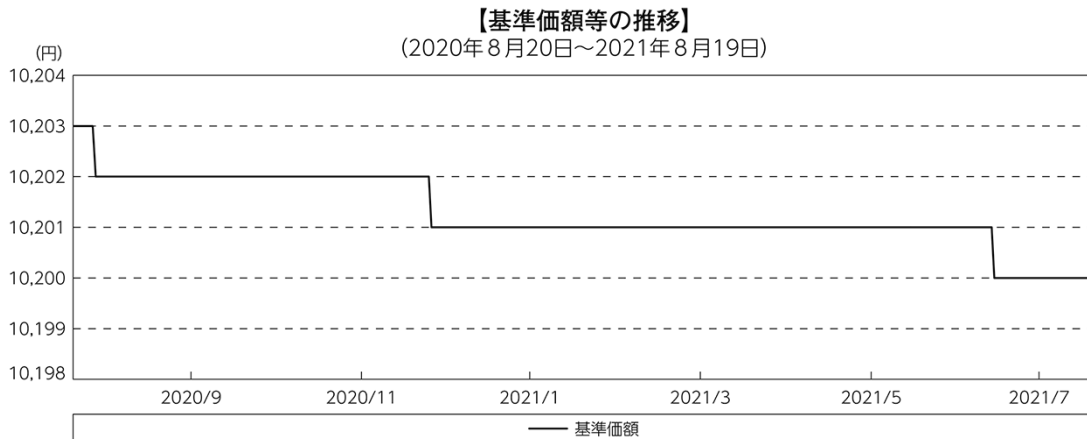
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年8月19日	円 10,203		% —	% 68.2	% —
8月末	10,202		△0.0	58.9	—
9月末	10,202		△0.0	50.4	—
10月末	10,202		△0.0	56.6	—
11月末	10,202		△0.0	28.3	—
12月末	10,201		△0.0	48.3	—
2021年1月末	10,201		△0.0	58.0	—
2月末	10,201		△0.0	56.6	—
3月末	10,201		△0.0	53.8	—
4月末	10,201		△0.0	59.8	—
5月末	10,201		△0.0	58.1	—
6月末	10,201		△0.0	57.9	—
7月末	10,200		△0.0	55.9	—
(期末) 2021年8月19日	10,200		△0.0	60.1	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

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

○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.07%程度で推移しました。

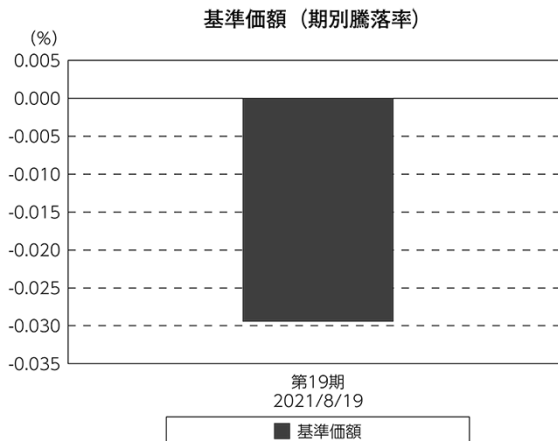
○当ファンドのポートフォリオ

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りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年8月20日～2021年8月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年8月20日～2021年8月19日)

公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 2,933,243	千円 — (2,410,000)
	特殊債券	7,744,464	— (6,142,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	4,656,400	— (3,416,400)

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

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

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 200,000	千円 — (200,000)

*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

(2020年8月20日～2021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		B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D		D C
		百万円	百万円			百万円	百万円	
公社債	百万円 15,334	百万円 130	% 0.8		百万円 -	百万円 -	% -	

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021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B B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
地方債証券	1,300,000 (1,300,000)	1,302,420 (1,302,420)	14.2 (14.2)	- (-)	- (-)	- (-)	14.2 (14.2)	
特殊債券 (除く金融債)	1,167,000 (1,167,000)	1,168,119 (1,168,119)	12.8 (12.8)	- (-)	- (-)	- (-)	12.8 (12.8)	
金融債券	1,230,000 (1,230,000)	1,230,089 (1,230,089)	13.4 (13.4)	- (-)	- (-)	- (-)	13.4 (13.4)	
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,800,000 (1,800,000)	1,801,060 (1,801,060)	19.7 (19.7)	- (-)	- (-)	- (-)	19.7 (19.7)	
合 計	5,497,000 (5,497,000)	5,501,690 (5,501,690)	60.1 (60.1)	- (-)	- (-)	- (-)	60.1 (60.1)	

* ()内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期		末
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第702回	1.04	100,000	100,353	2021/12/20
大阪府 公募第354回	1.03	100,000	100,201	2021/10/28
共同発行市場地方債 公募第102回	1.03	500,000	500,520	2021/9/24
熊本県 公募平成23年度第2回	1.0	340,000	340,645	2021/10/28
広島市 公募平成23年度第2回	1.0	200,000	200,380	2021/10/25
広島市 公募平成23年度第5回	1.01	60,000	60,319	2022/2/25
小 計		1,300,000	1,302,420	
特殊債券(除く金融債)				
政保 地方公共団体金融機構債券(8年) 第2回	0.502	30,000	30,058	2021/12/24
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第152回	1.1	77,000	77,321	2021/12/28
首都高速道路 第19回	0.07	500,000	500,131	2021/12/20
阪神高速道路 第19回	0.02	460,000	460,073	2021/12/20
成田国際空港 第11回	1.067	100,000	100,534	2022/2/18
小 計		1,167,000	1,168,119	
金融債券				
商工債券 利付第802回い号	0.06	30,000	30,002	2022/3/25
しんきん中金債券 利付第321回	0.03	150,000	150,002	2021/8/27
しんきん中金債券 利付第322回	0.03	450,000	450,018	2021/9/27
商工債券 利付(3年)第223回	0.11	500,000	500,053	2021/8/27
商工債券 利付(3年)第224回	0.11	100,000	100,013	2021/9/27
小 計		1,230,000	1,230,089	
普通社債券(含む投資法人債券)				
中部電力 第522回	0.13	300,000	300,284	2022/4/25
関西電力 第525回	0.14	100,000	100,050	2021/12/20
クレディセゾン 第53回社債間限定同順位特約付	0.435	600,000	600,488	2021/10/22
トヨタファイナンス 第66回社債間限定同順位特約付	0.233	100,000	100,018	2021/9/17
三菱UFJリース 第43回社債間限定同順位特約付	0.06	500,000	500,088	2021/10/25
三井不動産 第44回社債間限定同順位特約付	1.173	200,000	200,129	2021/9/6
小 計		1,800,000	1,801,060	
合 計		5,497,000	5,501,690	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年8月19日現在)

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公社債	千円 5,501,690		% 60.1
コール・ローン等、その他	3,657,462		39.9
投資信託財産総額	9,159,152		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 (2021年8月19日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	9,159,152,994
コール・ローン等	3,648,709,633
公社債(評価額)	5,501,690,180
未収利息	6,302,831
前払費用	2,450,350
(B) 負債	3,052
未払利息	3,052
(C) 純資産総額(A-B)	9,159,149,942
元本	8,979,256,768
次期繰越損益金	179,893,174
(D) 受益権総口数	8,979,256,768口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,200円

(注) 期首元本額は3,112,610,329円、期中追加設定元本額は11,088,903,882円、期中一部解約元本額は5,222,257,443円、1口当たり純資産額は1.0200円です。

○損益の状況 (2020年8月20日～2021年8月19日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	26,935,137
受取利息	27,892,600
支払利息	△ 957,463
(B) 有価証券売買損益	△ 28,401,101
売買損	△ 28,401,101
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,465,964
(D) 前期繰越損益金	63,039,317
(E) 追加信託差損益金	223,303,118
(F) 解約差損益金	△ 104,983,297
(G) 計(C+D+E+F)	179,893,174
次期繰越損益金(G)	179,893,174

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Xプライス(適格機関投資家専用)	2,690,621,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,977,425,742
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家私売制限付)	1,413,674,178
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)	287,434,434
野村世界業種別投資シリーズ(マネーパブル・ファンド)	241,214,028
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーパブル・ファンド)	101,692,450
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投資	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
ネクストコア	2,282,012
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第12回 野村短期公社債ファンド	1,901,723
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(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資(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資(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資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(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資(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資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンプレートン・トータル・リターン Aコース	983,381

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・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	982,608
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信 (中国元コース) 年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信 (毎月分配型)	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信 (中国元コース) 毎月分配型	982,607

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信 (米ドルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信 (米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 年2回決算型	980,297
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投信 (メキシコペソコース) 毎月分配型	626,503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	398,357
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715
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
第7回 野村短期公社債ファンド	204,767
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投信 (インドルピーコース) 毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投信 (トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村通貨選択日本株投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信 (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 (資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンプルトン・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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプレートン・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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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NPSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村NPSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

〇お知らせ

該当事項はございません。