

野村新エマーシング債券投信（中国元コース） 毎月分配型

運用報告書(全体版)

第166期（決算日2024年1月25日） 第167期（決算日2024年2月26日） 第168期（決算日2024年3月25日）
第169期（決算日2024年4月25日） 第170期（決算日2024年5月27日） 第171期（決算日2024年6月25日）

作成対象期間（2023年12月26日～2024年6月25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。
なお、当ファンドは、運用開始以来永らくご愛顧いただきましたが、2024年12月25日に信託期間満了となります。
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2月24日から2024年12月25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、アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ ノムラ・エマーシング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア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、米ドル建ての新興国の国債、政府保証債、政府機関債および社債（以下「エマーシング債券」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ないます。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ ノムラ・エマーシング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア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	野村新エマーシング債券投信（中国元コース）	アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ ノムラ・エマーシング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア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。
	アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ ノムラ・エマーシング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア	米ドル建てのエマーシング債券を主要投資対象とします。
	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。
主な投資制限	野村新エマーシング債券投信（中国元コース）毎月分配型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行ないません。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時に、原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なうことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合や安定分配とならない場合があります。なお、毎年6月および12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ないます。「原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なう」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したもの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	券 率	債 先 物 比	券 率	投 証 組 入 比	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金							
	円	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円	
142期(2022年1月25日)	10,053	40		△3.0	0.1	—	—	98.2	—	532	
143期(2022年2月25日)	9,529	40		△4.8	0.1	—	—	98.5	—	498	
144期(2022年3月25日)	9,822	40		3.5	0.1	—	—	98.6	—	511	
145期(2022年4月25日)	9,929	40		1.5	0.1	—	—	98.6	—	512	
146期(2022年5月25日)	9,238	40		△6.6	0.1	—	—	98.4	—	469	
147期(2022年6月27日)	9,366	40		1.8	0.1	—	—	98.5	—	478	
148期(2022年7月25日)	9,028	40		△3.2	0.1	—	—	98.6	—	460	
149期(2022年8月25日)	9,176	40		2.1	0.1	—	—	98.5	—	463	
150期(2022年9月26日)	8,895	40		△2.6	0.1	—	—	98.3	—	449	
151期(2022年10月25日)	8,338	40		△5.8	0.1	—	—	98.4	—	422	
152期(2022年11月25日)	8,763	40		5.6	0.1	—	—	98.6	—	438	
153期(2022年12月26日)	8,584	40		△1.6	0.1	—	—	98.6	—	426	
154期(2023年1月25日)	8,957	40		4.8	0.0	—	—	98.7	—	444	
155期(2023年2月27日)	8,762	40		△1.7	0.1	—	—	98.4	—	427	
156期(2023年3月27日)	8,480	40		△2.8	0.1	—	—	98.4	—	414	
157期(2023年4月25日)	8,623	40		2.2	0.1	—	—	98.5	—	421	
158期(2023年5月25日)	8,619	40		0.4	0.0	—	—	98.3	—	422	
159期(2023年6月26日)	8,878	40		3.5	0.0	—	—	98.6	—	427	
160期(2023年7月25日)	8,890	40		0.6	0.0	—	—	98.5	—	426	
161期(2023年8月25日)	8,879	20		0.1	0.0	—	—	98.9	—	417	
162期(2023年9月25日)	8,960	20		1.1	0.0	—	—	98.5	—	418	
163期(2023年10月25日)	8,832	20		△1.2	0.0	—	—	99.0	—	410	
164期(2023年11月27日)	9,361	20		6.2	0.0	—	—	98.7	—	425	
165期(2023年12月25日)	9,400	20		0.6	0.0	—	—	98.8	—	422	
166期(2024年1月25日)	9,577	20		2.1	0.0	—	—	99.0	—	420	
167期(2024年2月26日)	9,800	20		2.5	0.0	—	—	98.5	—	427	
168期(2024年3月25日)	10,071	20		3.0	0.2	—	—	98.6	—	419	
169期(2024年4月25日)	10,125	20		0.7	0.0	—	—	98.7	—	422	
170期(2024年5月27日)	10,423	20		3.1	0.1	—	—	98.8	—	435	
171期(2024年6月25日)	10,681	20		2.7	0.1	—	—	98.6	—	438	

*基準価額の騰落率は分配金込み。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第166期	(期 首)	円	%	%	%	%	%
	2023年12月25日	9,400	—	0.0	—	—	98.8
	12月末	9,390	△0.1	0.0	—	—	98.5
	(期 末)						
第167期	2024年1月25日	9,577	—	0.0	—	—	99.0
	1月末	9,610	0.3	0.0	—	—	98.5
	(期 末)						
	2024年2月26日	9,820	2.5	0.0	—	—	98.5
第168期	(期 首)						
	2024年2月26日	9,800	—	0.0	—	—	98.5
	2月末	9,874	0.8	0.0	—	—	98.5
	(期 末)						
第169期	2024年3月25日	10,091	3.0	0.2	—	—	98.6
	(期 首)						
	2024年3月25日	10,071	—	0.2	—	—	98.6
	3月末	10,114	0.4	0.0	—	—	98.6
第170期	(期 末)						
	2024年4月25日	10,145	0.7	0.0	—	—	98.7
	(期 首)						
	2024年4月25日	10,125	—	0.0	—	—	98.7
第171期	4月末	10,308	1.8	0.1	—	—	98.7
	(期 末)						
	2024年5月27日	10,443	3.1	0.1	—	—	98.8
	(期 首)						
第171期	2024年5月27日	10,423	—	0.1	—	—	98.8
	5月末	10,408	△0.1	0.1	—	—	98.5
	(期 末)						
	2024年6月25日	10,701	2.7	0.1	—	—	98.6

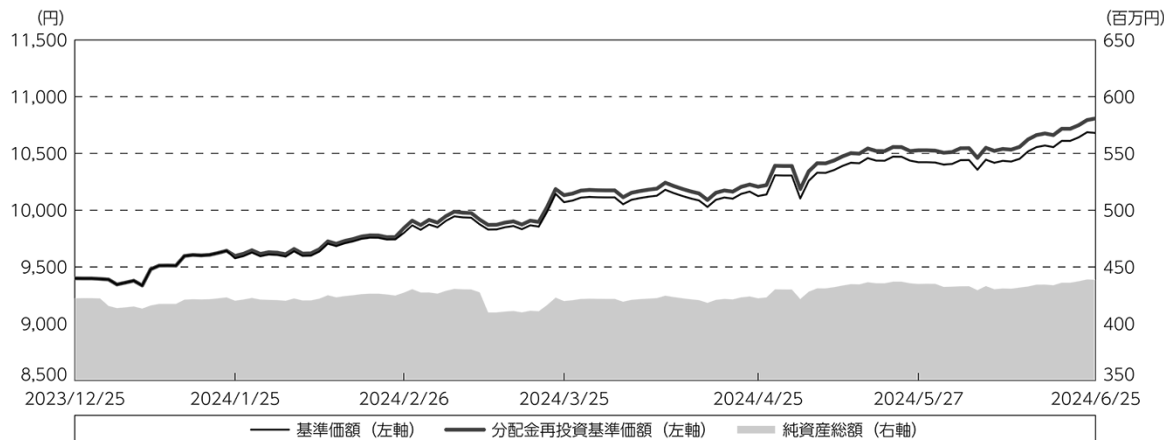
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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166期首：9,400円

第171期末：10,681円（既払分配金（税込み）：120円）

騰落率：15.0%（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（2023年12月25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エマージング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エマージング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／中国元の為替変動

○投資環境

エマージング債券市場は、当作成期間では上昇しました。2024年1月上旬は、米国国債金利が利下げ観測の後退から上昇し米ドル高地合いとなったことで下落したものの、その後4月初旬にかけては投資家のリスク選好姿勢を背景に反発しました。4月中旬にも米ドル高を背景に下落する場面があったものの、その後は金利上昇への警戒感が後退しリスク環境が好転したことから再び上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

【野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型】

【アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ -ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア】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【アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ -ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア】の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

【アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ -ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシェア】

米ドル建ての新興国の国債、政府保証債、政府機関債および社債（「エマージング債券」といいます。）を中心に投資するとともに、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。

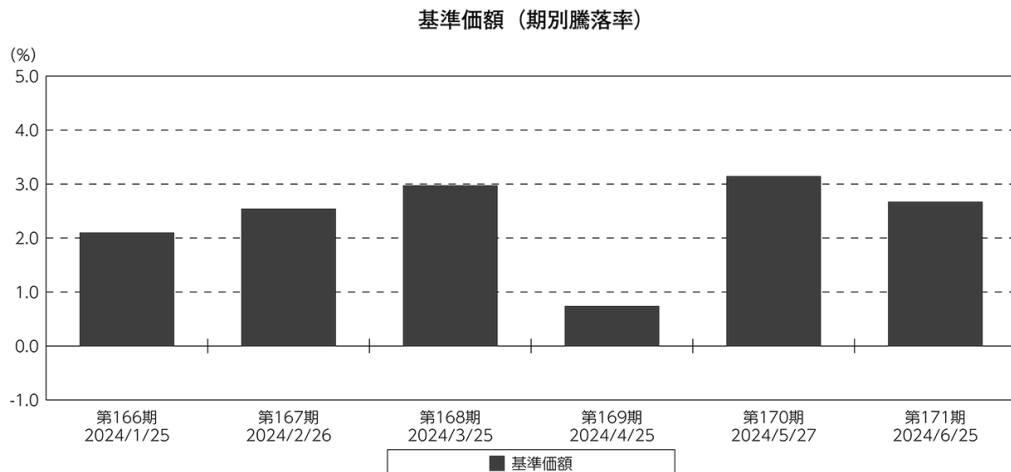
【野村マネー マザーファンド】

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166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2023年12月26日～ 2024年1月25日	2024年1月26日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月25日	2024年4月26日～ 2024年5月27日	2024年5月28日～ 2024年6月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.208%	20 0.204%	20 0.198%	20 0.197%	20 0.192%	20 0.187%
当期の収益	16	16	16	14	16	16
当期の収益以外	4	3	3	5	3	3
翌期繰越分配対象額	2,269	2,265	2,263	2,258	2,254	2,250

(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

【野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型】

【アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ -ノムラ・エマージング・マーケッツ・ボンド・ポートフォリオークラスJCNシェア】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【アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ -ノムラ・エマージング・マーケッツ・ボンド・ポートフォリオークラスJCNシェア】受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

【アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ -ノムラ・エマージング・マーケッツ・ボンド・ポートフォリオークラスJCNシェア】

米ドル建てのエマージング債券を主要投資対象とし、値上がり益とインカムゲインからなるトータル・リターンを最大化を目指します。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、米ドル建て資産を原則として米ドルを売り、中国元を買う為替取引を行ないます。

金融緩和転換で先行するエマージング諸国は、物価抑制と経済成長の両面で先進国よりも相対的に優位に立ちやすいとみています。また、過去のインフレ局面で利上げを進めたことから

エマージング諸国の金利水準自体が高い環境にあります。インフレ抑制および財政悪化の底打ちも米国などの先進国に対し全般的にサイクルが先行しており、利下げが経済活動を下支える見込みです。中国の景気鈍化も市場の織り込みが進み追加的な悪材料とはなりにくく、エマージング諸国投資の環境は好転方向にあると考えます。また今後は、米国の利下げ開始を織り込む局面で米ドルの軟化がエマージング諸国投資や商品価格の支援材料となる可能性があります。一方、地政学的リスクが一層高まっていることに対しては市場の警戒が低いとみています。地域紛争がグローバル経済のリスクになるとは想定していないものの、地域の選択には留意が必要です。環境面ではインフレの再燃が最大のリスク・シナリオと想定します。2024年は選挙が多く、見方を変更する国もいくつか出てくると想定し、選挙イベントに着目したポジションは収益機会と捉えています。運用にあたっては、地政学的イベントやインフレ警戒によるリスク環境の悪化を注視しつつ、ポートフォリオのリスクを機動的に調整し、分散度を高めつつ、価格面での魅力がある国の選別に注力します。

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

[野村マネー マザーファンド]

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年12月26日～2024年6月25日)

項 目	第166期～第171期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 48	% 0.484	(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 ）	(19)	(0.193)	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 ）	(27)	(0.275)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	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	48	0.485	
作成期間の平均基準価額は、9,950円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

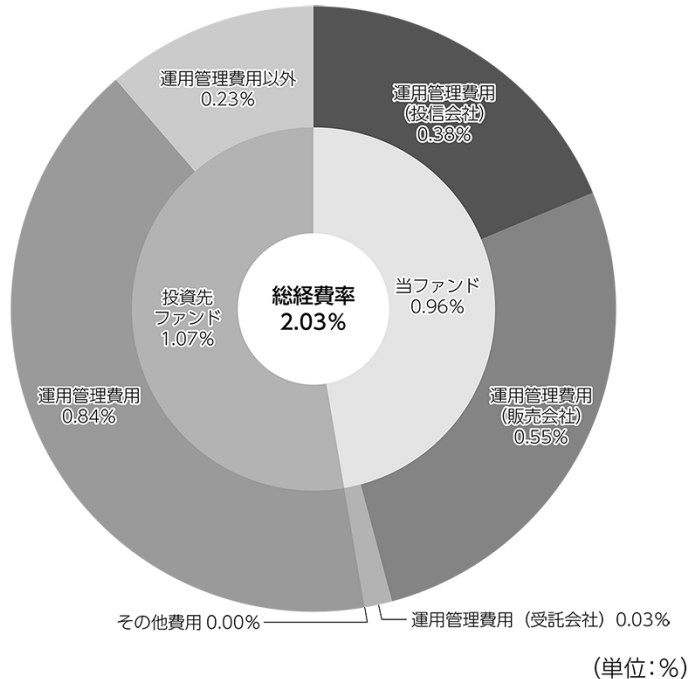
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.03%です。



総経費率(①+②+③)	2.03
①当ファンドの費用の比率	0.96
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.84
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.23

- (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) 当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
 (注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。
 (注) 各比率は、年率換算した値です。
 (注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（マザーファンドを除く。）です。
 (注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
 (注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。
 (注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
 (注) 投資先ファンドの運用管理費用については年間最低報酬額が適用される場合があるため、純資産総額によっては目論見書等に記載の報酬率を上回る場合があります。
 (注) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。
 (注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。
 (注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年12月26日～2024年6月25日)

投資信託証券

銘柄		第166期～第171期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ - ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシエア	口 —	千円 —	口 3,574	千円 41,774

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年12月26日～2024年6月25日)

利害関係人との取引状況

<野村新エマージング債券投信（中国元コース）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166期～第171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 741	百万円 50	% 6.7	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

(2024年6月25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	柄	第165期末		第171期末	
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
	アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ - ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオークラスJ CNシエア	37,373	33,799	432,627	98.6
	合計	37,373	33,799	432,627	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165期末	第171期末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 982	千口 982	千円 1,001

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年6月25日現在)

項 目	第171期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 432,627	% 98.3
野村マネー マザーファンド	1,001	0.2
コール・ローン等、その他	6,522	1.5
投資信託財産総額	440,150	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166期末	第167期末	第168期末	第169期末	第170期末	第171期末
	2024年1月25日現在	2024年2月26日現在	2024年3月25日現在	2024年4月25日現在	2024年5月27日現在	2024年6月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	421,492,719	429,516,582	421,086,740	423,546,297	436,225,160	440,150,186
コール・ローン等	4,612,371	7,547,386	5,920,744	5,657,704	5,378,756	6,521,105
投資信託受益証券(評価額)	415,878,679	420,967,527	414,164,316	416,886,814	429,844,526	432,627,200
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,001,669	1,001,669	1,001,669	1,001,767	1,001,866	1,001,866
未収利息	—	—	11	12	12	15
(B) 負債	1,221,255	2,202,389	1,146,340	1,180,902	1,201,472	1,413,879
未払収益分配金	877,706	872,062	833,944	834,328	834,747	821,559
未払解約金	—	971,300	—	—	—	258,032
未払信託報酬	342,778	358,222	311,700	345,795	365,903	333,537
未払利息	1	—	—	—	—	—
その他未払費用	770	805	696	779	822	751
(C) 純資産総額(A-B)	420,271,464	427,314,193	419,940,400	422,365,395	435,023,688	438,736,307
元本	438,853,039	436,031,091	416,972,132	417,164,477	417,373,998	410,779,696
次期繰越損益金	△ 18,581,575	△ 8,716,898	2,968,268	5,200,918	17,649,690	27,956,611
(D) 受益権総口数	438,853,039口	436,031,091口	416,972,132口	417,164,477口	417,373,998口	410,779,696口
1万円当たり基準価額(C/D)	0.9577円	9.800円	10.071円	10.125円	10.423円	10.681円

(注) 第166期首元本額は449,361,002円、第166～171期中追加設定元本額は1,462,233円、第166～171期中一部解約元本額は40,043,539円、1口当たり純資産額は、第166期0.9577円、第167期0.9800円、第168期1.0071円、第169期1.0125円、第170期1.0423円、第171期1.0681円です。

○損益の状況

項 目	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2023年12月26日～ 2024年1月25日	2024年1月26日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月25日	2024年4月26日～ 2024年5月27日	2024年5月28日～ 2024年6月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	729,959	724,367	689,233	689,566	689,589	677,433
受取配当金	730,060	724,378	689,206	689,238	689,240	677,042
受取利息	—	—	56	328	349	391
支払利息	△ 101	△ 11	△ 29	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	8,232,214	10,244,455	11,711,407	2,722,613	12,957,811	11,042,830
売買益	8,273,811	10,273,195	11,840,683	2,722,610	12,957,811	11,076,936
売買損	△ 41,597	△ 28,740	△ 129,276	3	—	△ 34,106
(C) 信託報酬等	△ 343,548	△ 359,027	△ 312,396	△ 346,574	△ 366,725	△ 334,288
(D) 当期損益金 (A+B+C)	8,618,625	10,609,795	12,088,244	3,065,605	13,280,675	11,385,975
(E) 前期繰越損益金	△57,861,762	△49,768,696	△38,214,273	△26,959,600	△24,728,323	△12,054,631
(F) 追加信託差損益金	31,539,268	31,314,065	29,928,241	29,929,241	29,932,085	29,446,826
(配当等相当額)	(72,205,521)	(71,753,470)	(68,628,696)	(68,672,568)	(68,719,883)	(67,660,899)
(売買損益相当額)	(△40,666,253)	(△40,439,405)	(△38,700,455)	(△38,743,327)	(△38,787,798)	(△38,214,073)
(G) 計 (D+E+F)	△17,703,869	△ 7,844,836	3,802,212	6,035,246	18,484,437	28,778,170
(H) 収益分配金	△ 877,706	△ 872,062	△ 833,944	△ 834,328	△ 834,747	△ 821,559
次期繰越損益金 (G+H)	△18,581,575	△ 8,716,898	2,968,268	5,200,918	17,649,690	27,956,611
追加信託差損益金	31,539,268	31,314,065	29,928,241	29,929,241	29,932,085	29,446,826
(配当等相当額)	(72,205,521)	(71,753,470)	(68,628,696)	(68,672,568)	(68,719,883)	(67,660,899)
(売買損益相当額)	(△40,666,253)	(△40,439,405)	(△38,700,455)	(△38,743,327)	(△38,787,798)	(△38,214,073)
分配準備積立金	27,399,195	27,046,841	25,740,782	25,525,672	25,362,070	24,792,112
繰越損益金	△77,520,038	△67,077,804	△52,700,755	△50,253,995	△37,644,465	△26,282,327

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

* 損益の状況の中で (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注) 分配金の計算過程 (2023年12月26日～2024年6月25日) は以下の通りです。

項 目	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2023年12月26日～ 2024年1月25日	2024年1月26日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月25日	2024年4月26日～ 2024年5月27日	2024年5月28日～ 2024年6月25日
a. 配当等収益 (経費控除後)	702,013円	700,700円	671,884円	619,542円	671,145円	658,299円
b. 有価証券売買等損益 (経費控除後・繰越大損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	72,205,521円	71,753,470円	68,628,696円	68,672,568円	68,719,883円	67,660,899円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	27,574,888円	27,218,203円	25,902,842円	25,740,458円	25,525,672円	24,955,372円
e. 分配対象収益 (a+b+c+d)	100,482,422円	99,672,373円	95,203,422円	95,032,568円	94,916,700円	93,274,570円
f. 分配対象収益 (1万円当たり)	2,289円	2,285円	2,283円	2,278円	2,274円	2,270円
g. 分配金	877,706円	872,062円	833,944円	834,328円	834,747円	821,559円
h. 分配金 (1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171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。

2024年11月5日より、ファンドの設定解約の申込締切時間は以下の記載のとおり変更となる予定です。

原則、午後3時30分までに、販売会社が受けた分を当日のお申込み分とします。

（販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。）

アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ – ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオ クラスJ JP/J US/J AU/J BR/J ZA/J CN/J ID シェア

2023年12月31日決算
(計算期間:2023年1月1日～2023年12月31日)

■当ファンドの仕組み

形 態	ルクセンブルグ籍円建外国投資信託
主 要 投 資 対 象	米ドル建ての新興国の国債、政府保証債、政府機関債および社債(以下、「エマージング債券」。)
投 資 方 針	米ドル建てのエマージング債券を主要投資対象とし、値上がり益とインカムゲインからなるトータル・リターンを最大化を追求します。 <ul style="list-style-type: none"> ・通常、純資産総額の80%以上をエマージング債券に投資します。 ・社債への投資割合は、純資産総額の35%以内とします。 ・単一国への投資割合は、純資産総額の30%以内とします。 ・ファンドには7つのクラス(クラスJ JP/J US/J AU/J BR/J ZA/J CN/J ID)があり、クラスJ US以外は、クラスごとに、米ドル建て資産について、原則として、米ドルを売り、各クラスの通貨(円、豪ドル、ブラジルレアル、南アフリカランド、中国元、インドネシアルピア)を買う為替取引を行なうことで、各通貨への投資効果を追求します。クラスJ USについては、対円で為替ヘッジを行わず、米ドルへの投資効果を追求します。
管 理 会 社	アライアンス・バーンスタイン・(ルクセンブルグ)・エス・エイ・アール・エル
投 資 顧 問 会 社	アライアンス・バーンスタイン・エル・ピー
名 義 書 換 代 行 会 社	アライアンス・バーンスタイン・インベスター・サービスズ
保 管 受 託 銀 行 / 管 理 事 務 代 行 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・(ルクセンブルグ)・エス・シー・エイ

*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。

アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ-
ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオ

資産・負債計算書

2023年12月31日現在

	(米ドル)
資 産	
投資有価証券一時価	100,539,175
保管受託銀行およびブローカー預託金	1,010,683
外国為替先渡契約未実現評価益	2,147,104
定期預金	1,824,733
投資有価証券売却未収金	111,360
未収配当金および未収利息	1,602,959
スワップ未実現評価益	231,656
金融先物契約未実現評価益	818,719
スワップ未収利息	68,565
スワップ契約前払プレミアム	11,000
資産合計	108,365,954
負 債	
スワップ未実現評価損	296,350
保管受託銀行およびブローカーへの未払金	967,386
ファンド証券買戻未払金	759,700
外国為替先渡契約未実現評価損	135,909
スワップ未払利息	85,503
スワップ契約前受プレミアム	242,495
投資有価証券購入未払金	22,402
金融先物契約未実現評価損	5,344
未払費用その他債務	146,688
負債合計	2,661,777
純資産合計	105,704,177

受益証券一口当り純資産価額	(米ドル)
クラス: JAU	42.35
JBR	18.47
JCN	78.76
JID	34.25
JJP	30.23
JUS	61.30
JZA	24.78
受益証券発行済口数	(口)
クラス: JAU	216,253
JBR	1,595,988
JCN	68,203
JID	216,206
JJP	766,983
JUS	501,352
JZA	15,012

アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ-
ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオ

損益計算書

2023年12月31日に終了した年度

(米ドル)

投資収益	
利息	7,849,639
スワップ収益	124,314
投資収益合計	<u>7,973,953</u>
費用	
管理報酬	786,193
スワップ関連費用	143,163
保管報酬	48,641
専門家報酬	12,558
会計および管理事務代行報酬	25,361
税金	10,434
AIFM登録費用	10,483
名義書換代理人報酬	9,340
印刷費	2,073
その他	21,953
費用合計	<u>1,070,199</u>
純投資収益	<u><u>6,903,754</u></u>
実現(損)益	
実現益	
投資有価証券	1,344,798
金融先物契約	185,854
外国為替先渡契約	19,924,719
為替取引	210,035
スワップ	341,267
オプション	145,881
	<u>22,152,554</u>
実現損	
投資有価証券	(9,084,454)
金融先物契約	(1,043,922)
外国為替先渡契約	(18,841,166)
為替取引	(222,622)
スワップ	(296,430)
オプション	(149,156)
	<u>(29,637,750)</u>
	<u><u>(7,485,196)</u></u>
未実現(損)益の変動	
投資有価証券	13,195,199
金融先物契約	793,219
外国為替先渡契約	(757,618)
スワップ	(94,453)
為替取引	(602)
	<u>13,135,745</u>
運用による純資産の増(減)額	<u><u>12,554,303</u></u>

アライアンス・バーンスタイン・ファンドⅢ-
ノムラ・エマージング・マーケット・ボンド・ポートフォリオ
純資産額変動計算書

2023年12月31日に終了した年度

(米ドル)

運用

純投資収益	6,903,754
投資有価証券、外国為替先渡契約、スワップ、オプション、金融先物契約および通貨に係る実現(損)益	(7,485,196)
投資有価証券、外国為替先渡契約、スワップ、オプションおよび金融先物契約に係る未実現(損)益	13,135,745
運用による純資産の増(減)額	12,554,303

元本異動等

元本の増(減)額	(5,736,525)
取引手数料	39,708
分配金額	(6,326,187)
元本異動等による純資産の増(減)額	(12,023,004)

純資産の増(減)額合計

期首純資産	105,172,878
期末純資産	105,704,177

アラライアンス・バーンスタイン・ファンド Ⅲ
ノムラ・エマーゼィンク・マーケツツ・ボンド・ポートフォリオ

投資有価証券明細表
2023年12月31日現在

	利 率	満期日	元本価格 (千米ドル)	時 価 (米ドル)	純資産に 対する比率 %
証券取引所またはその他規制市場で上場または取引される譲渡可能有価証券					
国 債					
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	10/11/2027	USD 291	\$ 278,950	0.3%
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	09/30/2049	391	286,548	0.3
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	1,160	1,029,500	1.0
Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028	647	595,240	0.6
Argentine Republic Government International Bond	0.75%	07/09/2030	3,080	1,229,945	1.2
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	748	296,233	0.3
Argentine Republic Government International Bond	3.63%	07/09/2035	2,113	715,084	0.7
Argentine Republic Government International Bond	4.25%	01/09/2038	442	174,280	0.2
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	272	223,394	0.2
Bahrain Government International Bond	6.25%	01/25/2051	785	648,116	0.6
Brazilian Government International Bond	6.00%	04/07/2026	430	441,395	0.4
Chile Electricity Lux MPC SARL	6.01%	01/20/2033	535	549,885	0.5
Chile Government International Bond	5.33%	01/05/2054	728	723,677	0.7
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	1,070	869,709	0.8
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	280	222,512	0.2
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	611	471,616	0.4
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	199	180,530	0.2
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	286	296,278	0.3
Colombia Government International Bond	7.50%	02/02/2034	750	790,078	0.7
Colombia Government International Bond	8.00%	04/20/2033	690	753,178	0.7
Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	225	245,883	0.2
Costa Rica Government International Bond	6.55%	04/03/2034	371	384,170	0.4
Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045	405	428,640	0.4
Costa Rica Government International Bond	7.30%	11/13/2054	250	270,975	0.3
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	540	490,936	0.5
Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025	125	124,186	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,519	2,634,874	2.5
Egypt Government International Bond	5.25%	10/06/2025	274	250,025	0.2
Egypt Government International Bond	5.80%	09/30/2027	419	321,975	0.3
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	314	240,112	0.2
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	224	130,270	0.1
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	607	364,390	0.3
Egypt Government International Bond	8.15%	11/20/2059	201	122,987	0.1
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	648	402,165	0.4
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	1,141	724,178	0.7
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	292	256,412	0.2
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	1,384	1,233,057	1.2
Ghana Government International Bond (a)	7.88%	02/11/2035	469	203,429	0.2
Ghana Government International Bond (a)	8.75%	03/11/2061	310	132,816	0.1
Ghana Government International Bond (a)	8.95%	03/26/2051	1,154	495,499	0.5
Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027	1,164	1,113,948	1.1
Guatemala Government Bond	6.13%	06/01/2050	415	392,590	0.4
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	01/14/2029	200	212,100	0.2
Hungary Government International Bond	2.13%	09/22/2031	841	677,905	0.6
Hungary Government International Bond	5.25%	06/16/2029	319	320,764	0.3
Hungary Government International Bond	5.50%	06/16/2034	628	636,227	0.6
Hungary Government International Bond	6.75%	09/25/2052	260	291,000	0.3
Indonesia Government International Bond	1.85%	03/12/2031	1,081	898,700	0.9
Indonesia Government International Bond	3.55%	03/31/2032	340	313,687	0.3
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	510	468,244	0.4
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	853	836,207	0.8
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	225	274,837	0.3
Jordan Government International Bond	7.38%	10/10/2047	700	620,200	0.6
Jordan Government International Bond	7.50%	01/13/2029	547	553,154	0.5
Lebanon Government International Bond (a)	6.65%	04/22/2024	488	28,670	0.0
Lebanon Government International Bond (a)	6.85%	03/23/2027	370	21,853	0.0
Lebanon Government International Bond (b)	8.25%	04/12/2021	709	41,432	0.0
Lebanon Government International Bond, Series E (b)	6.10%	10/04/2022	890	52,287	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G (a)	1.00%	11/27/2026	904	53,392	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G (a)	6.20%	02/26/2025	788	46,541	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G (a)	6.65%	11/03/2028	899	53,378	0.1
Mexico Government International Bond	2.66%	05/24/2031	700	590,406	0.6
Morocco Government International Bond	2.38%	12/15/2027	438	391,736	0.4
Morocco Government International Bond	6.50%	09/08/2033	251	264,570	0.3
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	2,070	1,831,950	1.7
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	317	289,064	0.3
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	245	220,270	0.2
Nigeria Government International Bond	7.38%	09/28/2033	537	456,953	0.4
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	200	163,750	0.2
Nigeria Government International Bond	8.38%	03/24/2029	279	267,230	0.3
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	570	579,975	0.5
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	439	461,087	0.4

	利 率	満期日	元本価格 (千米ドル)	時 価 (米ドル)	純資産に 対する比率 %
Pakistan Government International Bond	8.88%	04/08/2051	USD 1,097	\$ 658,200	0.6%
Panama Bonos del Tesoro, Series DOM	3.36%	06/30/2031	132	103,434	0.1
Panama Government International Bond	3.87%	07/23/2060	725	432,961	0.4
Panama Government International Bond	4.50%	04/01/2056	410	274,956	0.3
Panama Government International Bond	6.40%	02/14/2035	202	196,950	0.2
Panama Government International Bond	6.85%	03/28/2054	529	493,954	0.5
Panama Government International Bond	6.88%	01/31/2036	353	351,897	0.3
Paraguay Government International Bond	3.85%	06/28/2033	470	415,480	0.4
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	454	443,104	0.4
Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	573	439,957	0.4
Philippine Government International Bond	3.23%	03/29/2027	200	191,438	0.2
Philippine Government International Bond	3.56%	09/29/2032	435	401,288	0.4
Philippine Government International Bond	3.75%	01/14/2029	308	296,258	0.3
Philippine Government International Bond	4.20%	03/29/2047	513	454,646	0.4
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	205	207,194	0.2
Republic of Azerbaijan International Bond	3.50%	09/01/2032	460	398,188	0.4
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	930	871,875	0.8
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	405	370,575	0.4
Republic of Poland Government International Bond	4.88%	10/04/2033	524	529,633	0.5
Republic of Poland Government International Bond	5.50%	04/04/2053	194	201,840	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	265	248,106	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	201	160,298	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	960	765,581	0.7
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	04/20/2032	366	346,675	0.3
Romanian Government International Bond	3.00%	02/14/2031	310	263,553	0.2
Romanian Government International Bond	3.63%	03/27/2032	300	258,984	0.2
Romanian Government International Bond	4.00%	02/14/2051	420	302,585	0.3
Romanian Government International Bond	5.25%	11/25/2027	936	927,492	0.9
Romanian Government International Bond	6.00%	05/25/2034	692	695,598	0.7
Saudi Government International Bond	2.25%	02/02/2033	235	194,242	0.2
Saudi Government International Bond	3.25%	10/26/2026	725	697,813	0.7
Saudi Government International Bond	3.45%	02/02/2061	646	453,209	0.4
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	367	346,012	0.3
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	473	462,505	0.4
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	761	677,766	0.6
Serbia International Bond	6.50%	09/26/2033	965	987,089	0.9
Sri Lanka Government International Bond (a)	6.83%	07/18/2026	796	405,960	0.4
Sri Lanka Government International Bond (a)	6.85%	11/03/2025	385	196,230	0.2
Sri Lanka Government International Bond (a)	7.55%	03/28/2030	310	155,097	0.1
Sri Lanka Government International Bond (a)	7.85%	03/14/2029	368	184,000	0.2
Turkiye Government International Bond	4.88%	10/09/2026	565	543,191	0.5
Turkiye Government International Bond	4.88%	04/16/2043	331	241,663	0.2
Turkiye Government International Bond	5.25%	03/13/2030	730	669,775	0.6
Turkiye Government International Bond	5.75%	05/11/2047	409	319,020	0.3
Turkiye Government International Bond	5.88%	06/26/2031	331	308,658	0.3
Turkiye Government International Bond	6.13%	10/24/2028	525	515,156	0.5
Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2031	646	146,359	0.1
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	1,515	352,238	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	871	238,654	0.2
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	581	155,127	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	773	209,676	0.2
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2030	1,030	292,263	0.3
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	280	273,420	0.3
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	325	325,420	0.3
Uruguay Government International Bond	7.75%	10/13/2019	784	105,065	0.1
Venezuela Government International Bond (b)	7.75%	09/15/2027	2,192	409,630	0.4
Venezuela Government International Bond (a)	9.25%	09/15/2027	509	313,671	0.3
Zambia Government International Bond (a)	8.97%	07/30/2027	509	313,671	0.3
				55,539,134	52.6

準ソブリン債

Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	825	621,390	0.6
Banco Nacional de Panama	2.50%	08/11/2030	470	349,130	0.3
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	05/22/2033	430	435,439	0.4
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	260	244,481	0.2
Comision Federal de Electricidad	5.00%	09/29/2036	424	352,647	0.3
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.00%	09/30/2029	925	822,672	0.8
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	430	388,747	0.4
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.13%	02/02/2033	1,000	965,300	0.9
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	786	795,039	0.7
Danjian Haiyu Ltd. (c)	4.25%	01/14/2027	689	659,717	0.6
DP World Ltd./United Arab Emirates	6.85%	07/02/2037	580	638,742	0.6
DP World Salaam (c)	6.00%	10/01/2025	475	472,939	0.4
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050	200	165,026	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047	200	172,726	0.2
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	298	297,721	0.3

	利 率	満期日	元本価格 (千米ドル)	時 価 (米ドル)	純資産に 対する比率 %
Gacfi First Investment Co.	4.75%	02/14/2030	USD 708	\$ 707,022	0.7%
Gacfi First Investment Co.	4.88%	02/14/2035	405	395,300	0.4
Gacfi First Investment Co.	5.25%	10/13/2032	565	585,173	0.5
Indonesia Asahan Aluminium PT/Mineral Industri Indonesia Persero PT	5.45%	05/15/2030	330	331,547	0.3
Lamar Funding Ltd.	3.96%	05/07/2025	717	697,060	0.7
Magyar Export-Import Bank Zrt	6.13%	12/04/2027	540	549,369	0.5
MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt	6.50%	06/29/2028	309	317,457	0.3
Oil & Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	793	834,633	0.8
Pertamina Persero PT	2.30%	02/09/2031	1,754	1,477,745	1.4
Petroleos de Venezuela SA (a)	5.38%	04/12/2027	842	85,948	0.1
Petroleos de Venezuela SA (a)	5.50%	04/12/2037	3,634	378,163	0.4
Petroleos de Venezuela SA (b)	9.00%	11/17/2021	2,878	315,646	0.3
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027	2,327	2,162,656	2.0
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	423	350,033	0.3
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	264	172,722	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	730	479,975	0.4
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	11	7,824	0.0
Petroleos Mexicanos	8.75%	06/02/2029	844	813,194	0.8
Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd. (c)	3.08%	04/01/2026	490	464,275	0.4
QatarEnergy	3.13%	07/12/2041	1,738	1,334,089	1.3
QatarEnergy	3.30%	07/12/2051	1,515	1,103,829	1.0
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd., Series E	2.38%	09/23/2031	200	162,966	0.2
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.70%	05/13/2030	421	382,504	0.4
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	479	485,736	0.5
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	6.95%	03/18/2030	375	393,867	0.4
Transnet SOC Ltd.	8.25%	02/06/2028	560	562,450	0.5
Turkiye Ithracat Kredi Bankasi AS	9.00%	01/28/2027	293	304,812	0.3
Turkiye Ithracat Kredi Bankasi AS	9.38%	01/31/2026	327	341,408	0.3
				23,579,119	22.3

社 債

Absa Group Ltd. (c)	6.38%	05/27/2026	300	283,125	0.3
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	299	282,772	0.3
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	305	294,325	0.3
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	3.83%	02/02/2032	315	243,830	0.2
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	200	187,000	0.2
Alfa Desarrollo SpA	4.55%	09/27/2051	336	262,029	0.2
Aris Mining Corp.	6.88%	08/09/2026	260	224,770	0.2
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	500	468,018	0.4
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	527	297,818	0.3
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	240	194,880	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	257	196,656	0.2
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	200	187,155	0.2
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	270	251,100	0.2
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	200	146,194	0.1
China Great Wall International Holdings V Ltd.	2.88%	11/23/2026	200	178,125	0.2
China Modern Dairy Holdings Ltd.	2.13%	07/14/2026	200	176,500	0.2
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	292	278,559	0.3
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	160	154,305	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	272	220,853	0.2
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	49	41,451	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	148	145,780	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	1,130	1,204,862	1.1
Embraer Netherlands Finance BV	7.00%	07/28/2030	270	282,778	0.3
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	421	358,119	0.3
Falsabella SA	3.75%	10/30/2027	200	175,187	0.2
First Abu Dhabi Bank PJSC	6.32%	04/04/2034	200	205,875	0.2
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/2031	240	204,375	0.2
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	200	176,178	0.2
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	250	237,187	0.2
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	5.50%	01/16/2025	218	214,526	0.2
IIRSA Norte Finance Ltd.	8.75%	05/30/2024	35	35,032	0.0
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	250	219,687	0.2
Iochepe-Maxion Austria GmbH/Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV	5.00%	05/07/2028	235	210,466	0.2
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	3.75%	02/22/2032	200	168,648	0.2
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.	4.50%	03/20/2029	200	187,336	0.2
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	270	234,145	0.2
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	200	185,000	0.2
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	850	840,969	0.8
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	245	215,909	0.2
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	110	100,780	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	459	418,015	0.4
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	246	242,644	0.2

	利 息	満期日	口数/元本額 (一/千米ドル)	時 価 (米ドル)	純資産に 対する比率 %
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co., Series E.....	4.88%	07/25/2033	USD 275	\$ 271,219	0.3%
Medco Maple Tree Pte Ltd.	8.96%	04/27/2029	250	254,687	0.2
Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS	8.25%	11/15/2028	200	208,790	0.2
Minejesa Capital BV	5.63%	08/10/2037	270	233,381	0.2
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	574	614	0.0
OEC Finance Ltd. (d)	5.25%	12/27/2033	824	32,960	0.0
OEC Finance Ltd. (d)	7.13%	12/26/2046	222	13,566	0.0
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	210	168,788	0.2
ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt. Ltd.	4.50%	07/14/2028	200	177,720	0.2
Sasol Financing USA LLC	8.75%	05/03/2029	200	204,088	0.2
Saudi Arabian Oil Co.	1.63%	11/24/2025	465	436,809	0.4
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	1,300	1,111,906	1.0
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	375	312,225	0.3
Standard Chartered PLC	1.46%	01/14/2027	215	197,045	0.2
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	200	177,000	0.2
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	200	184,688	0.2
TAV Havalimanları Holding AS	8.50%	12/07/2028	307	313,620	0.3
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	560	459,200	0.4
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	167	146,265	0.1
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	200	180,125	0.2
Türkiye Vakıflar Bankası TAO	9.00%	10/12/2028	260	272,594	0.3
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	240	211,200	0.2
Vale Overseas Ltd.	3.75%	07/08/2030	115	105,225	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	466	281,930	0.3
Yangco Justice International Ltd. (b)	9.25%	04/15/2023	200	500	0.0
Yapı ve Kredi Bankası AS	9.25%	10/16/2028	300	317,250	0.3
Ziraat Katılım Varlık Kiralama AS	9.38%	11/12/2026	254	267,097	0.3
				<u>17,373,455</u>	<u>16.5</u>
買戻オプション・スワップ					
スワップオプション					
OTC-10 Year Interest Rate Swap					
Expiration: Apr 2024, Exercise Price: 4.45 (e)			2,430,000	4,466	0.0
				<u>96,496,174</u>	<u>91.4</u>
米国財務省証券					
短期国債					
U.S. Treasury Bill	0.00%	02/15/2024	600	596,143	0.6
				<u>97,092,317</u>	<u>92.0</u>
その他の譲渡可能有価証券					
ソブリン債					
Ecuador Government International Bond	3.50%	07/31/2035	2,267	803,737	0.7
Ecuador Government International Bond	6.00%	07/31/2030	675	312,504	0.3
Ghana Government International Bond (a)	8.63%	06/16/2049	506	213,785	0.2
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	347	329,650	0.3
Venezuela Government International Bond (b)	9.00%	05/07/2023	1,542	226,540	0.2
				<u>1,886,216</u>	<u>1.7</u>
社 債					
BBFI Liquidating Trust (f)	0.00%	12/30/2099	1,487	660,076	0.6
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	435	465	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	274	256,190	0.2
Tonon Luxembourg SA (a)	6.50%	10/31/2024	993	99	0.0
Virgolmo de Oliveira Finance SA (b) (f)	10.50%	01/28/2018	536	54	0.0
Virgolmo de Oliveira Finance SA (b) (f)	10.88%	01/13/2020	1,042	104	0.0
Virgolmo de Oliveira Finance SA (b) (f)	11.75%	02/09/2022	4,305	431	0.0
				<u>917,419</u>	<u>0.8</u>
準ソブリン債					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2028	304	139,840	0.1
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC (f)	7.65%	07/19/2025	580	396,958	0.4
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	430	106,425	0.1
				<u>643,223</u>	<u>0.6</u>
				<u>3,446,858</u>	<u>3.1</u>
投資有価証券合計					
(取得価格 119,733,139米ドル)				<u>\$100,539,175</u>	<u>95.1%</u>

	利 率	満期日	時 価 (米ドル)	純資産に 対する比率 %
定期預金				
SEB, Stockholm (g)	(0.40)%	—	\$ 125,980	0.1%
SEB, Stockholm (g)	4.68%	—	1,698,753	1.6
定期預金合計			1,824,733	1.7
その他の資産 (負債控除後)			3,340,269	3.2
純 資 産			\$105,704,177	100.0%

金融先物契約

タイプ	満期日 (月/日/年)	契約高	当初価額 (米ドル)	時 価 (米ドル)	未実現 評価(損)益 (米ドル)
ロング					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	03/19/2024	18	\$2,027,266	\$ 2,124,281	\$ 97,016
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	03/28/2024	30	3,268,547	3,263,203	(5,344)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	03/19/2024	78	8,494,883	8,805,469	310,586
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	03/19/2024	38	4,665,445	5,076,563	411,117
					\$813,375
				益	\$818,719
				損	\$ (5,344)

外国為替先渡契約

カウンターパーティー	約定引渡通貨 および金額 (単位:千)	交換通貨 および金額 (単位:千)	決済日 (月/日/年)	未実現 評価(損)益 (米ドル)
Barclays Bank PLC+	USD 28,560	BRL 140,445	01/03/2024	\$ 352,467
Barclays Bank PLC+	USD 6,838	IDR 106,875,902	01/25/2024	105,226
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 21,266	JPY 3,137,409	01/12/2024	1,017,444
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 557	AUD 843	01/25/2024	17,614
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 353	ZAR 6,767	02/07/2024	15,562
Goldman Sachs Bank USA+	USD 179	IDR 2,781,123	01/25/2024	1,666
HSBC Bank USA+	USD 5,240	CNY 37,083	03/20/2024	9,755
Morgan Stanley & Co., International PLC+	BRL 144,896	USD 29,999	01/03/2024	170,450
Morgan Stanley & Co., International PLC+	JPY 88,599	USD 599	01/12/2024	(29,262)
Morgan Stanley & Co., International PLC+	USD 1,053	JPY 156,541	01/12/2024	58,808
Morgan Stanley & Co., International PLC+	IDR 3,010,941	USD 192	01/25/2024	(3,178)
Morgan Stanley & Co., International PLC+	USD 8,263	AUD 12,671	01/25/2024	378,054
Morgan Stanley & Co., International PLC+	USD 186	IDR 2,892,691	01/25/2024	1,914
Morgan Stanley & Co., International PLC+	USD 29,880	BRL 144,896	02/02/2024	(103,469)
Morgan Stanley & Co., International PLC+	USD 120	CNY 848	03/20/2024	20
UBS AG+	USD 900	BRL 4,451	01/03/2024	16,223
UBS AG+	USD 213	IDR 3,308,126	01/25/2024	1,901
				\$2,011,195
			益	\$2,147,104
			損	\$ (135,909)

+ クラス証券へのヘッジ目的で使用。

中央清算機関で清算されるクレジット・デフォルト・スワップ

清算ブローカー／(取引所)	参照債券	終了日 (月/日/年)	名目元本 (単位：千)	時 価 (米ドル)	未実現 評価(損)益 (米ドル)
購入契約					
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	State of Qatar	12/20/2028	USD 8,050	\$ (195,389)	\$(55,885)
販売契約					
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	CDX-EMS40V1-5Y	12/20/2028	340	(9,864)	2,947
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	12/20/2028	350	(4,918)	2,137
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	People's Republic of China	12/20/2028	350	6,357	(179)
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	Republic of Colombia	12/20/2028	360	(8,909)	6,063
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	Republic of Indonesia	12/20/2028	350	4,602	672
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	Republic of South Africa	12/20/2028	440	(20,056)	4,619
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	Republic of Turkey	12/20/2028	460	(35,404)	8,074
Citigroup Global Markets, Inc./ (INTRCONX)	United Mexican States	12/20/2028	350	1,822	1,288
Citigroup Global Markets, Inc./				\$ (261,759)	\$(30,264)
合計					\$ 25,800
				益	
				損	\$(56,064)

中央清算機関で清算される金利スワップ

清算ブローカー／(取引所)	名目元本 (単位：千)	終了日 (月/日/年)	金利タイプ		未実現 評価(損)益
			ファンドが 行った 支払い	ファンドが 受領した 支払い	
Citigroup Global Markets, Inc./ (CME Group)	USD 4,380	10/27/2028	1 Day SOFR	4.611%	\$ 205,856
Citigroup Global Markets, Inc./ (LCH Group)	750	03/21/2033	1 Day SOFR	3.209%	(15,924)
Citigroup Global Markets, Inc./ (CME Group)	1,170	10/27/2053	4.353%	1 Day SOFR	(224,362)
合計					\$ (34,430)
				益	\$ 205,856
				損	\$(240,286)
スワップ用合計					\$ (64,694)

- (a) 債務不履行証券。
 (b) 償還日到来済み債務不履行証券。
 (c) 永久債のため、あらかじめ定められた償還日はない。日付が表示される場合は、次のコール日を表す。
 (d) 現物支給 (PIK)。
 (e) 1 契約につき 1 株
 (f) AIFMの取締役会の全般的監督の下で確立された手続きに従い決定された通り、公正に評価された。
 (g) 翌日物預金。

通貨略称:

AUD - オーストラリアドル
 BRL - ブラジルレアル
 CNY - 中国元
 IDR - インドネシアルピア
 JPY - 日本円
 USD - 米ドル
 ZAR - 南アフリカランド

用語解説:

- CBT - Chicago Board of Trade (シカゴ商品取引所)
- CJSC - Closed Joint Stock Company (非公開株式会社)
- CME - Chicago Mercantile Exchange (シカゴ・マーカントイル取引所)
- INTRCONX - Intercontinental Exchange (インターコンチネンタル取引所)
- JSC - Joint Stock Company (株式会社)
- LCH - London Clearing House (ロンドン・クリアリング・ハウス)
- OTC - Over-the-Counter (店頭取引)
- PJSC - Public Joint Stock Company (公開株式会社)
- SOFR - Secured Overnight Financing Rate (担保付翌日物調達金利)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日2023年8月21日）

作成対象期間（2022年8月20日～2023年8月21日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行ないません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

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

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

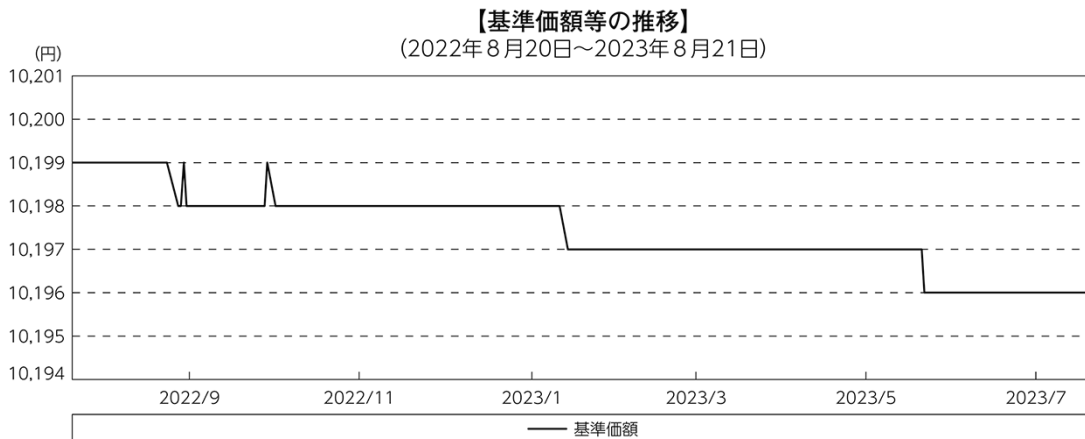
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2022年8月19日	円 10,199		% —	% 57.5	% —
8月末	10,199		0.0	58.4	—
9月末	10,198		△0.0	48.5	—
10月末	10,198		△0.0	44.4	—
11月末	10,198		△0.0	34.4	—
12月末	10,198		△0.0	20.7	—
2023年1月末	10,198		△0.0	16.4	—
2月末	10,197		△0.0	25.4	—
3月末	10,197		△0.0	22.8	—
4月末	10,197		△0.0	26.2	—
5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

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

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

○投資環境

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

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

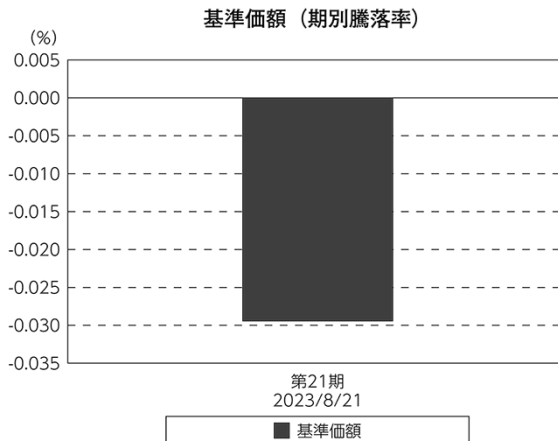
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年8月20日～2023年8月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年8月20日～2023年8月21日)

公社債

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

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

○利害関係人との取引状況等

(2022年8月20日～2023年8月21日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2023年8月21日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	230,000	230,079	3.4	—	—	—	3.4
	(230,000)	(230,079)	(3.4)	(—)	(—)	(—)	(3.4)
特殊債券 (除く金融債)	54,000	54,051	0.8	—	—	—	0.8
	(54,000)	(54,051)	(0.8)	(—)	(—)	(—)	(0.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	100,000	100,043	1.5	—	—	—	1.5
	(100,000)	(100,043)	(1.5)	(—)	(—)	(—)	(1.5)
合 計	384,000	384,175	5.7	—	—	—	5.7
	(384,000)	(384,175)	(5.7)	(—)	(—)	(—)	(5.7)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円		
東京都 公募第724回	0.7	10,000	10,005		2023/9/20
大阪府 公募(5年)第155回	0.001	100,000	100,000		2023/10/30
京都府 公募平成25年度第7回	0.8	90,000	90,058		2023/9/19
愛知県 公募平成25年度第15回	0.699	10,000	10,012		2023/10/25
福岡県 公募平成25年度第4回	0.816	20,000	20,003		2023/8/25
小 計		230,000	230,079		
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第200回	0.801	34,000	34,030		2023/9/29
地方公共団体金融機構債券 第54回	0.73	10,000	10,019		2023/11/28
西日本高速道路 第47回	0.07	10,000	10,002		2023/12/20
小 計		54,000	54,051		
普通社債券(含む投資法人債券)					
三井住友ファイナンス&リース 第21回社債間限定同順位特約付	0.18	100,000	100,043		2023/11/27
小 計		100,000	100,043		
合 計		384,000	384,175		

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 384,175	% 5.7
コール・ローン等、その他	6,358,969	94.3
投資信託財産総額	6,743,144	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,743,144,910
コール・ローン等	6,358,433,056
公社債(評価額)	384,175,187
未収利息	210,342
前払費用	326,325
(B) 負債	10,011,425
未払金	10,002,200
未払利息	9,225
(C) 純資産総額(A-B)	6,733,133,485
元本	6,603,862,387
次期繰越損益金	129,271,098
(D) 受益権総口数	6,603,862,387口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,196円

(注) 期首元本額は7,697,164,972円、期中追加設定元本額は6,899,643,779円、期中一部解約元本額は7,992,946,364円、1口当たり純資産額は1.0196円です。

○損益の状況 (2022年8月20日～2023年8月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	10,224,214
受取利息	11,704,539
その他収益金	26,370
支払利息	△ 1,506,695
(B) 有価証券売買損益	△ 12,018,108
売買損	△ 12,018,108
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,793,894
(D) 前期繰越損益金	153,116,866
(E) 追加信託差損益金	135,776,221
(F) 解約差損益金	△ 157,828,095
(G) 計(C+D+E+F)	129,271,098
次期繰越損益金(G)	129,271,098

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	2,663,398,020
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Kプライス(適格機関投資家専用)	1,486,454,639
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	1,248,281,712
野村アンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2210(適格機関投資家転売制限付)	730,584,834
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	158,756,834
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	68,496,125
野村世界高金利通貨投信	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
ネクストコア	2,282,012

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608
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(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608

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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98,078
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース	98,078
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース	98,059
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース	98,059
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
マイライフ・エール(資産成長型)	98,049
マイライフ・エール(年2%目標払出型)	98,049
マイライフ・エール(年6%目標払出型)	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドルピアコース)年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	13,042
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド(米ドル売り円買い)(野村SMA・EW向け)	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

〇お知らせ

該当事項はございません。