

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

運用報告書(全体版)

第143期 (決算日2024年6月24日) 第144期 (決算日2024年7月22日) 第145期 (決算日2024年8月22日)
第146期 (決算日2024年9月24日) 第147期 (決算日2024年10月22日) 第148期 (決算日2024年11月22日)

作成対象期間 (2024年5月23日～2024年11月22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/国内/株式	
信託期間	2012年6月19日から2027年5月24日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券を通じて、日本の高配当利回り株式(以下、「高配当株」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指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	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	ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス	日本の高配当株を主要投資対象とします。加えて、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用します。
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	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行ないません。
	毎決算時に、原則として、配当等収益等を中心に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があります。なお、市況動向や基準価額水準等によっては、分配金額が大きく変動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。	

野村アセットマネジメント株式会社

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

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			債 組 入 比 率	券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 込 配 金	騰 落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
119期(2022年6月22日)	9,148	40	4.7	0.0	—	98.9	34,395
120期(2022年7月22日)	9,263	40	1.7	0.0	—	98.0	34,258
121期(2022年8月22日)	9,488	40	2.9	0.0	—	98.5	34,667
122期(2022年9月22日)	9,683	40	2.5	0.0	—	97.9	34,978
123期(2022年10月24日)	9,823	40	1.9	0.0	—	96.7	35,136
124期(2022年11月22日)	9,880	40	1.0	0.0	—	99.0	34,899
125期(2022年12月22日)	9,089	40	△ 7.6	0.0	—	98.9	32,028
126期(2023年1月23日)	9,208	40	1.7	0.0	—	98.4	32,288
127期(2023年2月22日)	9,957	40	8.6	0.0	—	96.9	34,780
128期(2023年3月22日)	9,172	40	△ 7.5	0.0	—	98.5	31,931
129期(2023年4月24日)	10,318	40	12.9	0.0	—	97.3	35,717
130期(2023年5月22日)	11,235	40	9.3	0.0	—	97.9	38,601
131期(2023年6月22日)	12,612	40	12.6	0.0	—	96.2	42,804
132期(2023年7月24日)	12,724	40	1.2	0.0	—	94.8	43,004
133期(2023年8月22日)	12,925	40	1.9	0.0	—	95.7	43,325
134期(2023年9月22日)	14,179	40	10.0	0.0	—	96.6	46,844
135期(2023年10月23日)	13,483	40	△ 4.6	0.0	—	96.0	44,109
136期(2023年11月22日)	14,323	40	6.5	0.0	—	95.0	46,332
137期(2023年12月22日)	13,692	40	△ 4.1	0.0	—	95.6	44,160
138期(2024年1月22日)	14,930	40	9.3	0.0	—	94.5	47,918
139期(2024年2月22日)	15,806	40	6.1	0.0	—	94.2	50,637
140期(2024年3月22日)	16,906	40	7.2	0.0	—	94.2	53,511
141期(2024年4月22日)	16,384	40	△ 2.9	0.0	—	95.3	51,604
142期(2024年5月22日)	17,619	40	7.8	0.0	—	94.8	54,942
143期(2024年6月24日)	17,041	40	△ 3.1	0.0	—	96.2	52,474
144期(2024年7月22日)	17,689	40	4.0	0.0	—	97.6	53,712
145期(2024年8月22日)	15,319	40	△ 13.2	0.0	—	95.4	46,100
146期(2024年9月24日)	14,968	40	△ 2.0	0.0	—	94.9	44,706
147期(2024年10月22日)	15,548	40	4.1	0.0	—	96.0	44,964
148期(2024年11月22日)	15,819	40	2.0	0.0	—	96.4	44,782

* 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				債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率
			騰 落 率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率			
第143期	(期首) 2024年5月22日	円 17,619	% -	% 0.0	% -	% 94.8			
	5月末	17,260	△ 2.0	0.0	-	95.4			
	(期末) 2024年6月24日	17,081	△ 3.1	0.0	-	96.2			
第144期	(期首) 2024年6月24日	17,041	-	0.0	-	96.2			
	6月末	17,475	2.5	0.0	-	96.1			
	(期末) 2024年7月22日	17,729	4.0	0.0	-	97.6			
第145期	(期首) 2024年7月22日	17,689	-	0.0	-	97.6			
	7月末	16,782	△ 5.1	0.0	-	99.0			
	(期末) 2024年8月22日	15,359	△13.2	0.0	-	95.4			
第146期	(期首) 2024年8月22日	15,319	-	0.0	-	95.4			
	8月末	15,193	△ 0.8	0.0	-	97.0			
	(期末) 2024年9月24日	15,008	△ 2.0	0.0	-	94.9			
第147期	(期首) 2024年9月24日	14,968	-	0.0	-	94.9			
	9月末	15,526	3.7	0.0	-	95.5			
	(期末) 2024年10月22日	15,588	4.1	0.0	-	96.0			
第148期	(期首) 2024年10月22日	15,548	-	0.0	-	96.0			
	10月末	15,863	2.0	0.0	-	95.1			
	(期末) 2024年11月22日	15,859	2.0	0.0	-	96.4			

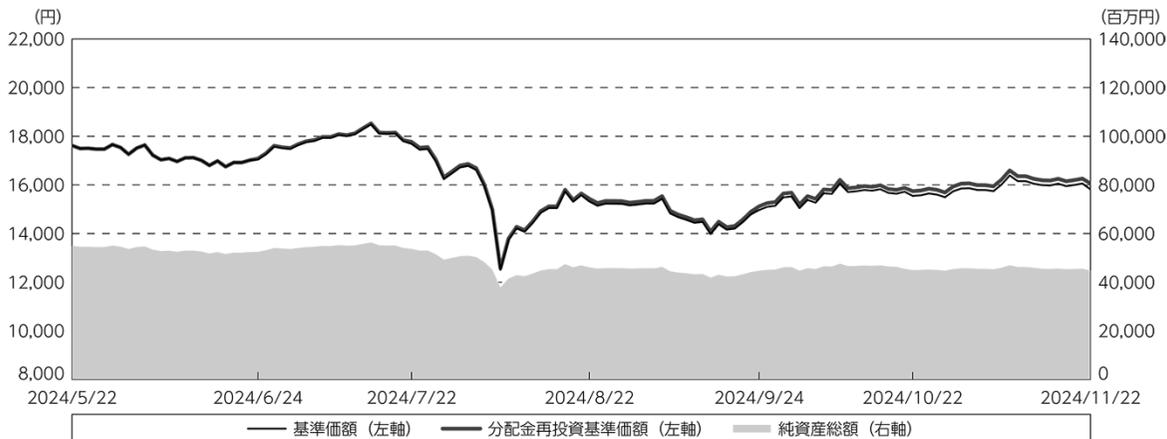
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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143期首：17,619円

第148期末：15,819円（既払分配金（税込み）：240円）

騰落率：△ 8.9%（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（2024年5月22日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

- ・ 実質的に投資している日本の高配当利回り株式（以下、「高配当株」といいます。）からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 実質的に投資している日本の高配当株からのインカムゲイン
- ・ 実質的に保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」による、オプション価値の上昇（または下落）※1

※1 ファンドはコール・オプションの売却を行いませんので、オプションの価値が上昇すれば基準価額の下落要因となり、オプションの価値が下落すればプレミアム収入を上限として基準価額の上昇要因となります。

- ・ 円／選定通貨※2の為替変動

※2 選定通貨は、投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した通貨を指します。

○投資環境

<日本の株式市場>

当作成期における日本の株式市場の株価はほぼ変わらずとなりました。

(当作成期首～2024年7月下旬)

- (上 昇) 為替市場における円安・米ドル高進行が好感されたこと。
- (上 昇) IT関連企業などの決算発表への期待が高まったこと。
- (下 落) 政府・日銀による為替介入への警戒感が強まったこと。
- (下 落) 日銀の早期利上げへの警戒感が強まったこと。
- (下 落) 米国の景気後退懸念が強まったこと。
- (下 落) 米国の中国に対する半導体輸出規制の厳格化が警戒されたこと。

(2024年8月上旬～2024年8月下旬)

- (下 落) 7月末の日銀の利上げ決定などを受けて早期利上げが警戒されたこと。
- (下 落) 主要経済指標の発表を受けて米景気減速懸念が強まったこと。
- (下 落) 為替市場における急速な円高・米ドル安進行が嫌気されたこと。
- (上 昇) 日銀副総裁が、金融市場が不安定な状況で利上げは行なわないと発言したことや、米インフレ率に鈍化の兆しがみられたことなどを受けて、投資家心理の改善が進んだこと。

(2024年9月上旬～当作成期末)

- (下 落) FOMC（米連邦公開市場委員会）による大幅な利下げ観測や日銀による早期利上げ観測が広まるなか、日米金利差の縮小が懸念され円高・米ドル安が進行したこと。
- (上 昇) FOMCにおいて0.5%の大幅な利下げが決定された一方で今後の利下げペースは緩やかになるとの見方が広まったことや、日銀が金融政策決定会合において利上げを急がない姿勢を示したことなどを背景に、日米金利差縮小への警戒感が和らいだこと。為替市場における円安・米ドル高進行が好感されたこと。
- (上 昇) 主要経済指標から堅調な雇用環境が示され米景気減速懸念が和らいだこと。
- (下 落) 欧州の大手半導体製造装置メーカーによる市場予想を下回る決算発表を受け、投資家心理が悪化したこと。
- (下 落) 国内では衆院選にて与党である自民党が議席数を大幅に減らすとの見方や、米国では大統領選挙にてトランプ前大統領が優勢との見方が広がるなど、日米の政治情勢において先行き不透明感が強まったこと。
- (上 昇) 衆院選で与党が大敗し野党が議席数を大きく伸ばす中で、今後の財政拡張的な政策への期待が高まったこと。
- (下 落) 日銀総裁の発言や為替市場における急速な円安・米ドル高進行などを受けて、日銀の早期利上げを警戒する動きが強まったこと。
- (上 昇) 米大統領選挙を巡り、法人税減税や規制緩和を主張するトランプ前大統領による景気と企業業績の押し上げなどが期待されたこと。

<為替レート>

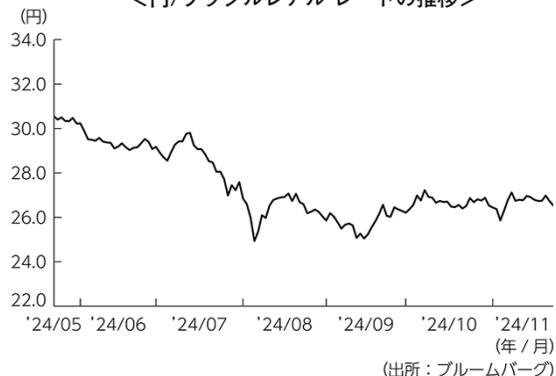
多くの中央銀行がインフレ抑制のため高金利環境を継続する一方、日銀が経済を下支えするために緩和的な金融環境を継続する姿勢を示し、新興国と日本の金利差が意識されたことなどは、新興国通貨高（円安）要因となりました。一方、日銀の早期利上げへの警戒感が強まるなか日本と新興国の金利差の縮小が懸念されたことなどが、円高（新興国通貨安）要因となりました。また、政府・日銀による為替介入への警戒感が強まったことなども円高（新興国通貨安）要因となりました。

通貨セレクトコースについては、選定通貨は対円で異なる動きとなりました。

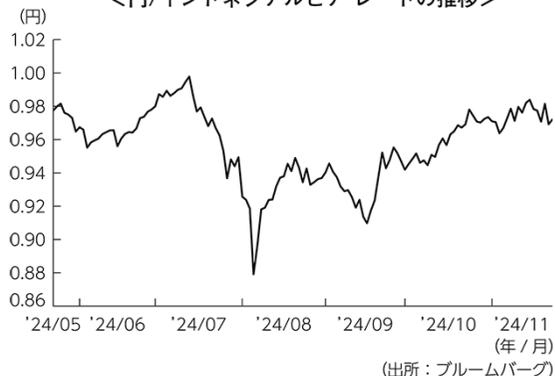
金融政策の方向性の違いから、新興国と日本の金利差が意識されたことなどは、選定通貨高（円安）要因となりました。一方、日銀の早期利上げや政府・日銀による為替介入などに対する警戒感が強まったことなどは、円高（選定通貨安）要因となりました。

メキシコにおいては、大統領選挙や議会選挙において左派与党勢力が勝利したことを受けて国家財政の悪化や国有企業の優遇が続くとの懸念が強まったことなどを背景に、メキシコ・ペソは対円で下落しました。

<円/ブラジルリアル レートの推移>



<円/インドネシアルピア レートの推移>



<円/南アフリカランド レートの推移>



<円/インドルピー レートの推移>



<円/メキシコペソ レートの推移>



<円/ポーランドズロチ レートの推移>



※当作成期間中に一度でも投資した通貨はチャートに含めています。
 ※インドネシアルピアは100ルピアあたりの円価格を表示しています。

○当ファンドのポートフォリオ

[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]

[ノムラ・マネージド・マスター・トラストー ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス] 受益証券および [野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・マネージド・マスター・トラストー ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス] 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

[ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス]

[ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド]の当作成期末現在のポートフォリオ特性値は、下図のようになりました。

ポートフォリオ特性値	
組入比率	92.3%
カバー率	39.4%
平均行使価格	127.5%
平均行使期間	39.1日
配当利回り(年率)	3.1%
プレミアム(年率)	0.2%

- ・ポートフォリオ特性値（カバー率、平均行使価格等）は、ファンドの組入株式の各特性値を、その組入比率で加重平均したものです。
- ・カバー率：純資産に対するオプションのポジション
- ・平均行使価格：原資産価格（株価）に対する平均権利行使価格
- ・平均行使期間：権利行使日までの平均日数
- ・配当利回り：組入銘柄の今期または前期の配当予想（課税前）を、加重平均して算出。（東洋経済新報社データ等を基に野村アセットマネジメントが作成）
- ・プレミアム（年率）：純資産に対する年率調整後のプレミアム収入
- ・プレミアム（年率）については、組み入れたオプションの諸条件により、年率調整後のプレミアム収入が大きく変動する場合があります。

主要投資対象である [ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド] のポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、電気機器11.3%、輸送用機器10.9%、銀行業8.2%となりました。

* 業種は東証33業種分類によります。

また、高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」に則り、現物株の購入とともにコール・オプションの売却を行ない、プレミアム収入の確保を図りました。

なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ（基礎的諸条件）、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定し、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、原則として実質的に円を売り各選定通貨を買う為替取引を行ないました。選定通貨は定期的に見直しを行ないました。当作成期末時点ではブラジルリアル、インドネシアルピア、南アフリカランド、インドルピー、メキシコペソを選定しています。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロードは、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建ての世界主要国の債券、現地通貨建ての新興国の債券をそれぞれ対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

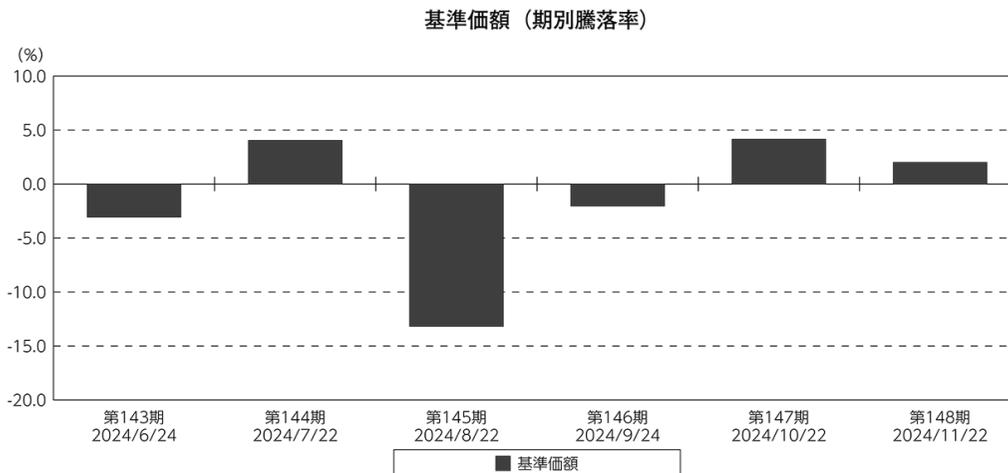
[野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債等の短期有価証券やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配については、各期の分配原資の範囲内で委託会社が決定するものとし、配当等の収入、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143期	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期
	2024年5月23日～ 2024年6月24日	2024年6月25日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月22日	2024年8月23日～ 2024年9月24日	2024年9月25日～ 2024年10月22日	2024年10月23日～ 2024年11月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	40 0.234%	40 0.226%	40 0.260%	40 0.267%	40 0.257%	40 0.252%
当期の収益	40	40	40	40	40	40
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	12,324	12,376	12,385	12,395	12,416	12,435

(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】

〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス〕 受益証券および〔野村マネー マザーファンド〕 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス〕 受益証券への投資比率を高位に維持することを目指します。

【ノムラ・マネージド・マスター・トラストー・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス】

ファンドは、日本の高配当株へ投資することで、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目指します。高配当株からのインカムゲインに加えて、プレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用し、先行き不透明な市場環境であっても、株式プレミアムの安定的な収益化に努めて参ります。

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、組入資産について、原則として実質的に円を売り、各選定通貨を買う為替取引を行ないます。

通貨の選択にあたっては、原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に（原則、毎月）見直すこととします。

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年以内の公社債等の短期有価証券やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図ります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※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

（2024年5月23日～2024年11月22日）

項 目	第143期～第148期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 80	% 0.488	(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 ）	(23)	(0.139)	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 ）	(54)	(0.333)	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 ）	(3)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(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)	(0.002)	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	80	0.490	
作成期間の平均基準価額は、16,349円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

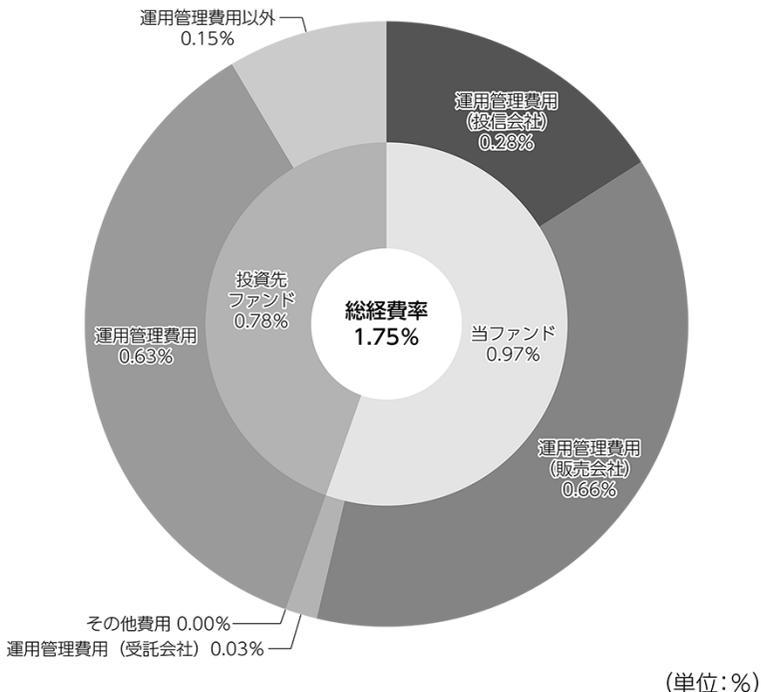
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.75%です。



総経費率 (①+②+③)	1.75
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	0.63
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.15

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（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

(2024年5月23日～2024年11月22日)

投資信託証券

銘柄		第143期～第148期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス	516,982	7,991,723	745,880	11,150,382

*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

(2024年5月23日～2024年11月22日)

利害関係人との取引状況

<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>
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143期～第148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 100	百万円 80	80.0	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11月22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142期末		第148期末	
	口数	口数	評価額	比率
ノムラ・マネージド・マスター・トラストージャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンドー通貨セレクトクラス	3,107,313	2,878,415	43,158,954	96.4
合計	3,107,313	2,878,415	43,158,954	96.4

*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142期末	第148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 1,002

*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11月22日現在)

項 目	第148期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 43,158,954	% 95.7
野村マネー マザーファンド	1,002	0.0
コール・ローン等、その他	1,940,286	4.3
投資信託財産総額	45,100,242	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143期末	第144期末	第145期末	第146期末	第147期末	第148期末
	2024年6月24日現在	2024年7月22日現在	2024年8月22日現在	2024年9月24日現在	2024年10月22日現在	2024年11月22日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	52,668,711,001	54,023,082,077	46,586,295,927	44,880,796,754	46,378,712,994	45,100,242,094
コール・ローン等	1,909,164,577	1,570,842,681	2,329,755,699	1,284,590,418	2,498,205,353	1,765,254,304
投資信託受益証券(評価額)	50,474,539,672	52,433,232,124	43,982,514,414	42,440,181,069	43,151,483,700	43,158,954,510
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,001,670	1,001,768	1,001,866	1,002,063	1,002,259	1,002,456
未収入金	284,000,661	18,001,824	273,008,835	1,155,014,849	728,005,440	175,019,282
未収利息	4,421	3,680	15,113	8,355	16,242	11,542
(B) 負債	194,194,110	310,462,689	485,994,193	174,464,327	1,414,159,125	317,273,543
未払金	—	9,997,387	245,997,786	—	148,994,829	—
未払収益分配金	123,175,164	121,460,705	120,376,286	119,475,558	115,678,798	113,241,495
未払解約金	24,344,952	138,369,070	81,053,247	15,971,777	1,115,041,829	166,408,849
未払信託報酬	46,515,432	40,497,477	38,435,852	38,884,443	34,326,658	37,495,386
その他未払費用	158,562	138,050	131,022	132,549	117,011	127,813
(C) 純資産総額(A-B)	52,474,516,891	53,712,619,388	46,100,301,734	44,706,332,427	44,964,553,869	44,782,968,551
元本	30,793,791,226	30,365,176,421	30,094,071,740	29,868,889,513	28,919,699,595	28,310,373,850
次期繰越損益金	21,680,725,665	23,347,442,967	16,006,229,994	14,837,442,914	16,044,854,274	16,472,594,701
(D) 受益権総口数	30,793,791,226口	30,365,176,421口	30,094,071,740口	29,868,889,513口	28,919,699,595口	28,310,373,850口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,041円	17,689円	15,319円	14,968円	15,548円	15,819円

(注) 第143期首元本額は31,183,160,982円、第143～148期中追加設定元本額は278,029,657円、第143～148期中一部解約元本額は3,150,816,789円、1口当たり純資産額は、第143期1.7041円、第144期1.7689円、第145期1.5319円、第146期1.4968円、第147期1.5548円、第148期1.5819円です。

○損益の状況

項 目	第143期	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期
	2024年5月23日～ 2024年6月24日	2024年6月25日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月22日	2024年8月23日～ 2024年9月24日	2024年9月25日～ 2024年10月22日	2024年10月23日～ 2024年11月22日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	222,142,928	216,353,560	186,264,857	186,188,276	174,507,703	173,264,628
受取配当金	221,976,164	216,217,240	186,116,336	185,890,055	174,098,942	172,849,786
受取利息	166,764	136,320	148,521	298,221	408,761	414,842
(B) 有価証券売買損益	△ 1,835,066,572	1,907,688,514	△ 7,154,912,321	△ 1,074,275,427	1,649,911,182	740,395,768
売買益	15,452,932	1,945,524,756	70,398,965	17,150,670	1,703,908,915	763,031,880
売買損	△ 1,850,519,504	△ 37,836,242	△ 7,225,311,286	△ 1,091,426,097	△ 53,997,733	△ 22,636,112
(C) 信託報酬等	△ 46,673,994	△ 40,635,527	△ 38,566,874	△ 39,016,992	△ 34,443,669	△ 37,623,199
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,659,597,638	2,083,406,547	△ 7,007,214,338	△ 927,104,143	1,789,975,216	876,037,197
(E) 前期繰越損益金	16,637,010,632	14,621,776,997	16,417,133,217	9,202,626,756	7,893,676,748	9,361,704,727
(F) 追加信託差損益金	6,826,487,835	6,763,720,128	6,716,687,401	6,681,395,859	6,476,881,108	6,348,094,272
(配当等相当額)	(21,261,779,298)	(20,997,314,409)	(20,829,795,908)	(20,707,014,682)	(20,063,353,765)	(19,652,978,586)
(売買損益相当額)	(△14,435,291,463)	(△14,233,594,281)	(△14,113,108,507)	(△14,025,618,823)	(△13,586,472,657)	(△13,304,884,314)
(G) 計(D+E+F)	21,803,900,829	23,468,903,672	16,126,606,280	14,956,918,472	16,160,533,072	16,585,836,196
(H) 収益分配金	△ 123,175,164	△ 121,460,705	△ 120,376,286	△ 119,475,558	△ 115,678,798	△ 113,241,495
次期繰越損益金(G+H)	21,680,725,665	23,347,442,967	16,006,229,994	14,837,442,914	16,044,854,274	16,472,594,701
追加信託差損益金	6,826,487,835	6,763,720,128	6,716,687,401	6,681,395,859	6,476,881,108	6,348,094,272
(配当等相当額)	(21,261,779,298)	(20,997,314,409)	(20,829,795,908)	(20,707,014,682)	(20,063,353,765)	(19,652,978,586)
(売買損益相当額)	(△14,435,291,463)	(△14,233,594,281)	(△14,113,108,507)	(△14,025,618,823)	(△13,586,472,657)	(△13,304,884,314)
分配準備積立金	16,689,304,591	16,583,722,839	16,444,454,982	16,317,335,498	15,843,957,514	15,553,458,506
繰越損益金	△ 1,835,066,761	-	△ 7,154,912,389	△ 8,161,288,443	△ 6,275,984,348	△ 5,428,958,077

* 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(2024年5月23日～2024年11月22日)は以下の通りです。

項 目	第143期	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期
	2024年5月23日～ 2024年6月24日	2024年6月25日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月22日	2024年8月23日～ 2024年9月24日	2024年9月25日～ 2024年10月22日	2024年10月23日～ 2024年11月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	175,469,123円	212,212,894円	147,698,051円	147,171,536円	171,211,654円	166,131,450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	65,121,465円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	21,261,779,298円	20,997,314,409円	20,829,795,908円	20,707,014,682円	20,063,353,765円	19,652,978,586円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	16,637,010,632円	16,427,849,185円	16,417,133,217円	16,289,639,520円	15,788,424,658円	15,500,568,551円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	38,074,259,053円	37,702,497,953円	37,394,627,176円	37,143,825,738円	36,022,990,077円	35,319,678,587円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,364円	12,416円	12,425円	12,435円	12,456円	12,475円
g. 分配金	123,175,164円	121,460,705円	120,376,286円	119,475,558円	115,678,798円	113,241,495円
h. 分配金(1万口当たり)	40円	40円	40円	40円	40円	40円

○分配金のお知らせ

	第143期	第144期	第145期	第146期	第147期	第148期
1万円当たり分配金（税込み）	40円	40円	40円	40円	40円	40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

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する必要の約款変更を行ないました。

＜変更適用日：2024年7月4日＞

ノムラ・マネージド・マスター・トラスト
ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスド・ファンド
(日本円クラス、通貨セレクトクラス)

2024年3月31日決算

(計算期間:2023年4月1日～2024年3月31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	日本の高配当株を主要投資対象とし、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指して運用を行なうことを基本とします。
投 資 対 象	日本の高配当株を主要投資対象とします。加えて、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用します。
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	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド
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

2024年3月31日に終了する計測期間
(円)

収益

銀行口座利息	169,499,010
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	1,500,979,249
収益合計	1,670,478,259

費用

投資顧問報酬	278,807,207
事務管理代行報酬	58,250,289
保管費用	17,519,840
取引銀行報酬	17,555,796
受託報酬	11,655,359
法務報酬	159,035
立替費用	4,700,499
専門家報酬	2,759,183
当座借越利息	3,417,128
雑費用	66,104,217
費用合計	460,928,553

純投資損益

純投資損益	1,209,549,706
投資有価証券売買に係る損益	9,289,065,797
オプション契約に係る損益	(1,303,338,161)
外国通貨に係る損益	11,359,562,323

当期実現純損益

当期実現純損益	19,345,289,959
---------	----------------

投資有価証券評価差損益	10,855,591,271
オプション契約に係る評価差損益	(159,081,315)
外国為替先渡し契約に係る評価差損益	96,889,300

当期評価差損益

当期評価差損益	10,793,399,256
---------	----------------

為替差額	163,638,037
------	-------------

運用の結果による純資産の増減額

運用の結果による純資産の増減額	31,511,876,958
-----------------	----------------

	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産
JPY Class Units (in JPY)	19,998	448,045	8,960,179,083
CRS Class Units (in JPY)	15,956	3,773,466	60,211,133,229

組入資産明細
2024年3月31日現在
(円)

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
	日本		
普通株			
1,070,000	HONDA MOTOR CO LTD	1,993,945,000	2.89
409,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	1,932,525,000	2.80
577,000	ORIX CORP	1,902,946,000	2.76
485,000	TOYOTA MOTOR CORP	1,845,910,000	2.67
244,000	MITSUI & CO LTD	1,718,492,000	2.48
9,100,000	NIPPON TELG & TEL CORP	1,638,000,000	2.37
183,000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	1,616,256,000	2.34
357,000	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	1,601,859,000	2.32
545,000	DENSO CORP	1,572,325,000	2.27
897,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	1,376,895,000	1.99
192,000	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	1,268,352,000	1.83
195,000	ITOCHEM CORP	1,260,480,000	1.82
616,000	ISUZU MOTORS LTD	1,256,024,000	1.82
760,000	ASTELLAS PHARMA INC	1,235,000,000	1.79
30,400	TOKYO ELECTRON LTD	1,193,504,000	1.73
250,000	KOMATSU LTD	1,115,750,000	1.61
375,000	MURATA MANUFACTURING CO LTD	1,062,937,500	1.54
212,000	CANON INC	954,212,000	1.38
192,300	MITSUI CHEMICALS INC	851,119,800	1.23
333,000	SUMCO CORP	793,039,500	1.15
762,000	IDEMITSU KOSAN CO LTD	787,146,000	1.14
304,000	KUBOTA CORP	719,416,000	1.04
403,000	AMADA CO LTD	694,973,500	1.00
102,500	BRIDGESTONE CORP	685,827,500	0.99
124,000	AGC INC	679,768,000	0.98
162,000	NICHIREI CORP	659,016,000	0.95
60,000	TOYOTA TSUSHO CORP	619,800,000	0.90
473,000	CASIO COMPUTER CO LTD	616,792,000	0.89
322,000	SG HOLDINGS CO L	616,469,000	0.89
459,000	RICOH CO LTD	615,748,500	0.89
79,500	NIPPON EXPRESS H	612,865,500	0.89
335,000	OBAYASHI CORP	600,822,500	0.87
213,000	MABUCHI MOTOR CO LTD	585,856,500	0.85
409,000	KYUSHU ELEC PWR	554,195,000	0.80
159,000	MITSUBISHI CORP	553,797,000	0.80
131,000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	527,668,000	0.76
361,000	PANASONIC HOLDINGS	519,298,500	0.75

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
234,000	SEKISUI CHEM CO	516,672,000	0.75
139,200	AICA KOGYO CO	513,926,400	0.74
31,800	HIROSE ELECTRIC	492,900,000	0.71
120,000	IHI CORPORATION	483,960,000	0.70
414,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	471,132,000	0.68
387,500	SHIKOKU ELEC PWR	457,056,250	0.66
219,000	NOK	453,549,000	0.66
95,000	MITSUI MINING & SMELTING CO LTD	438,805,000	0.63
171,000	TOKYO TATEMONO CO LTD	435,280,500	0.63
37,000	TOKYO SEIMITSU CO LTD	432,345,000	0.63
93,000	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	423,801,000	0.61
161,400	SUMITOMO WAREHOU	409,956,000	0.59
162,000	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	408,483,000	0.59
195,000	NISSHIN SEIFUN GROUP INC	405,990,000	0.59
321,000	CHIBA BANK LTD	403,657,500	0.58
100,000	SOJITZ CORPORATION	397,600,000	0.57
52,500	COSMO ENERGY HD	397,530,000	0.57
69,000	KAO CORP	390,264,000	0.56
94,000	NIPPON YUSEN KK	390,100,000	0.56
319,500	NISSHINBO HOLDINGS INC	387,713,250	0.56
131,500	YOKOGAWA BRIDGE	383,059,500	0.55
610,000	OJI HOLDINGS CORPORATION	382,836,000	0.55
287,000	ZEON CORPORATION	377,261,500	0.55
111,000	OSAKA GAS CO LTD	377,178,000	0.55
180,000	SEINO HOLDINGS	373,590,000	0.54
83,000	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	372,089,000	0.54
292,000	USS CO LTD	364,854,000	0.53
69,000	SANKYU INC	358,386,000	0.52
48,000	TDK CORP	354,816,000	0.51
190,000	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	354,635,000	0.51
173,000	NGK INSULATORS LTD	351,363,000	0.51
91,000	SUMITOMO OSAKA CEMENT CO LTD	344,253,000	0.50
436,000	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	331,011,200	0.48
143,000	INPEX CORP	328,828,500	0.48
342,000	NISSUI CORP	324,045,000	0.47
16,600	SCREEN HOLDINGS CO LTD	323,534,000	0.47
100,500	ADEKA CORP	319,791,000	0.46
282,000	SENKO GROUP HOLDINGS	318,942,000	0.46
125,000	NABTESCO CORP	316,187,500	0.46
88,000	COMSYS HOLDINGS CORP	310,992,000	0.45
56,000	ASAHI GROUP HOLDINGS	310,464,000	0.45
331,000	RESONA HOLDINGS INC	308,492,000	0.45
86,000	RINNAI CORP	297,990,000	0.43
105,000	BROTHER INDS LTD	293,895,000	0.42

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
105,500	DIP CORP	291,391,000	0.42
124,200	SATO HOLDINGS CORP	286,529,400	0.41
377,000	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	285,803,700	0.41
84,000	TAIYO HOLDINGS CO LTD	278,880,000	0.40
160,000	SUZUKI MOTOR CORP	275,360,000	0.40
84,500	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	275,301,000	0.40
46,100	HANWA CO LTD	271,529,000	0.39
57,500	SUNDRUG CO LTD	269,560,000	0.39
72,500	TAIYO YUDEN CO LTD	258,897,500	0.37
77,000	INABATA & CO	244,860,000	0.35
54,500	NIPPON SHINYAKU CO LTD	244,541,500	0.35
69,000	INABA DENKISANGYO CO LTD	241,500,000	0.35
81,300	MARUHA NICHIRO CORP	240,363,450	0.35
69,000	FUJIMI INC	238,395,000	0.34
87,000	NET ONE SYSTEMS	231,507,000	0.33
89,000	MORINAGA & CO	230,866,000	0.33
51,000	BIPROGY INC	228,633,000	0.33
25,000	YAMATO KOGYO	214,550,000	0.31
45,000	SUMITOMO HEAVY IND	213,525,000	0.31
136,000	BELLSYSTEM24 HOLDINGS INC	212,840,000	0.31
97,000	SANKI ENGINEERING CO LTD	203,797,000	0.29
62,000	MEITEC GROUP HOL	181,009,000	0.26
110,000	KOEI TECMO HOLDI	176,935,000	0.26
67,000	SANWA HOLDINGS CORP	176,411,000	0.26
94,000	STAR MICRONICS CO LTD	173,712,000	0.25
37,000	NET ONE SYSTEMS	170,644,000	0.25
50,000	OTSUKA CORP	160,050,000	0.23
30,700	NOEVIR HOLDING CO LTD	159,333,000	0.23
62,000	DENKA CO LTD	146,010,000	0.21
51,000	T&D HOLDINGS INC	133,951,500	0.19
108,000	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	131,490,000	0.19
44,500	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	124,511,000	0.18
40,000	KAJIMA CORP	123,800,000	0.18
27,000	SUMITOMO BAKELIT	122,580,000	0.18
4,200	HIKARI TSUSHIN INC	118,986,000	0.17
72,700	ITOCHU ENEX CO	113,193,900	0.16
53,500	FURUKAWA CO	97,049,000	0.14
80,000	NET ONE SYSTEMS	84,200,000	0.12
52,000	PIGEON CORP	75,764,000	0.11
29,000	TOYO SEIKAN GROUP HOLDINGS LTD	69,005,500	0.10
22,000	TOYO TIRE CORP	62,634,000	0.09
20,000	KANAMOTO CO LTD	53,960,000	0.08
12,500	DENTSU GROUP INC	52,375,000	0.08
20,000	EXEO GROUP INC	32,060,000	0.05

数量	銘柄	評価額	純資産比率(%)
23,000	RENGO CO LTD	26,507,500	0.04
		<u>63,733,046,350</u>	<u>92.14</u>
	日本計	<u>63,733,046,350</u>	<u>92.14</u>
	組入資産合計	<u>63,733,046,350</u>	<u>92.14</u>

外国為替先渡し契約

2024年3月31日現在

通貨(買い)	通貨(売り)	満期日	未実現損益(円)		
USD	47,309,276	JPY	6,930,000,000	April 10, 2024	220,097,559
USD	48,204,000	JPY	7,065,000,000	May 15, 2024	180,615,400
MXN	348,000,000	USD	20,131,199	April 12, 2024	120,027,753
MXN	334,500,000	USD	19,396,139	April 26, 2024	101,650,826
USD	41,958,980	JPY	6,200,000,000	May 22, 2024	99,237,256
USD	48,186,002	JPY	7,160,000,000	May 08, 2024	90,610,659
USD	42,162,226	JPY	6,270,000,000	April 24, 2024	88,644,979
USD	47,644,227	JPY	7,100,000,000	May 01, 2024	77,324,268
USD	41,370,715	JPY	6,170,000,000	April 17, 2024	75,774,743
MXN	356,000,000	USD	20,748,212	June 07, 2024	69,939,349
MXN	339,500,000	USD	19,898,368	May 24, 2024	56,503,288
BRL	121,700,000	USD	23,947,736	June 07, 2024	39,707,574
ZAR	284,000,000	USD	14,656,523	May 15, 2024	31,032,985
USD	26,120,422	PLN	103,800,000	April 05, 2024	27,363,101
USD	23,138,051	ZAR	438,000,000	April 05, 2024	21,628,416
PLN	85,800,000	USD	21,352,940	April 05, 2024	13,410,421
MXN	38,000,000	USD	2,207,049	April 26, 2024	11,002,416
BRL	91,000,000	USD	18,131,824	April 12, 2024	10,025,903
ZAR	310,000,000	USD	16,213,084	April 22, 2024	6,058,563
PLN	51,300,000	USD	12,783,240	April 22, 2024	5,266,145
ZAR	41,000,000	USD	2,116,329	April 22, 2024	5,038,413
MXN	28,000,000	USD	1,648,251	April 26, 2024	4,775,012
MXN	24,000,000	USD	1,411,950	May 24, 2024	3,193,142
PLN	18,000,000	USD	4,482,991	April 05, 2024	2,305,605
USD	17,012,903	INR	1,418,000,000	April 05, 2024	2,029,950
BRL	6,100,000	USD	1,212,863	May 24, 2024	330,661
INR	82,000,000	USD	986,994	April 22, 2024	(657,444)
BRL	20,000,000	USD	3,998,760	April 26, 2024	(784,123)
USD	10,592,577	JPY	1,600,000,000	April 17, 2024	(890,435)
INR	110,000,000	USD	1,324,248	May 15, 2024	(1,050,551)
INR	1,418,000,000	USD	17,009,638	April 05, 2024	(1,535,509)
INR	1,418,000,000	USD	16,978,294	June 14, 2024	(2,308,102)

	通貨(買い)		通貨(売り)		満期日	未実現損益(円)
	PLN	9,100,000	USD	2,291,503	April 22, 2024	(2,686,592)
	BRL	10,000,000	USD	2,015,722	April 26, 2024	(2,866,717)
	INR	1,271,500,000	USD	15,269,843	April 22, 2024	(4,956,548)
	USD	49,422,640	JPY	7,420,000,000	May 29, 2024	(9,657,090)
	INR	1,437,500,000	USD	17,286,827	May 15, 2024	(10,898,923)
	INR	1,055,000,000	USD	12,712,497	May 30, 2024	(12,895,789)
	PLN	59,200,000	USD	14,910,164	May 15, 2024	(18,448,210)
	BRL	83,100,000	USD	16,725,369	April 26, 2024	(19,993,595)
	ZAR	438,000,000	USD	23,005,175	June 14, 2024	(21,809,534)
	PLN	103,800,000	USD	26,101,493	June 14, 2024	(27,483,562)
	BRL	115,900,000	USD	23,318,981	May 24, 2024	(35,294,898)
	ZAR	438,000,000	USD	23,246,949	April 05, 2024	(38,118,300)
	PLN	65,300,000	USD	16,565,781	May 31, 2024	(38,873,116)
	ZAR	300,000,000	USD	15,954,502	May 31, 2024	(41,945,270)
						1,070,440,079

オプション契約

2024年3月31日現在

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
		売建ポジション				
JPY	(33,000)	C 1925 JT 5405.108 04/04/24 OTC	April 04, 2024	(105,811)	0	105,811
JPY	(17,000)	C 4183 JT 5513.04 04/04/24 OTC	April 04, 2024	(52,907)	0	52,907
JPY	(10,000)	C 6762 JT 9344.66 03/04/24 OTC	April 03, 2024	(73,580)	0	73,580
JPY	(58,000)	C 6981 JT 3801.25 02/04/24 OTC	April 02, 2024	(158,740)	0	158,740
JPY	(48,000)	C 6981 JT 3805.56 09/04/24 OTC	April 09, 2024	(147,312)	0	147,312
JPY	(26,000)	C 9101 JT 6239.9143 09/04/24 OTC	April 09, 2024	(100,612)	0	100,612
JPY	(15,000)	C 9104 JT 6775.2534 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(166,735)	0	166,735
JPY	(9,000)	C 9147 JT 10044.1 05/04/24 OTC	April 05, 2024	(78,606)	0	78,606
JPY	(1,150,000)	C 9432 JT 200.133 03/04/24 OTC	April 03, 2024	(186,645)	0	186,645
JPY	(800,000)	C 9432 JT 207.903 08/04/24 OTC	April 08, 2024	(149,840)	0	149,840
JPY	(83,000)	C 1332 JT 1098.196 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(60,266)	(9,033)	51,233
JPY	(80,000)	C 1332 JT 1104.32 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(111,360)	(35,636)	75,724
JPY	(79,000)	C 1332 JT 1108.025 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(53,285)	(19,285)	34,000
JPY	(80,000)	C 1332 JT 1119.79 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(112,920)	(25,905)	87,015
JPY	(62,000)	C 1605 JT 2590.5795 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(224,117)	(1,310,410)	(1,086,293)
JPY	(23,000)	C 1721 JT 3754.24 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(61,676)	(223,621)	(161,945)
JPY	(23,000)	C 1721 JT 3844.6494 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(83,853)	(381,061)	(297,208)
JPY	(22,000)	C 1721 JT 3859.47 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(61,195)	(341,997)	(280,802)
JPY	(56,000)	C 1802 JT 1648.9175 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(60,060)	(8,313,441)	(8,253,381)
JPY	(56,000)	C 1802 JT 1661.8254 02/04/24 OTC	April 02, 2024	(52,533)	(7,383,731)	(7,331,198)
JPY	(55,000)	C 1802 JT 1695.4285 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(85,475)	(6,168,286)	(6,082,811)

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(44,000)	C 1802 JT 1923.35 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(230,802)	(247,150)	(16,348)
JPY	(42,000)	C 1802 JT 2058.84 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(113,778)	(83,601)	30,177
JPY	(28,000)	C 1812 JT 3346.875 13/05/24 OTC	May 13, 2024	(157,500)	(679,962)	(522,462)
JPY	(23,000)	C 1925 JT 4910.98 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(99,958)	(298,231)	(198,273)
JPY	(23,000)	C 1925 JT 4922.52 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(99,314)	(263,535)	(164,221)
JPY	(23,000)	C 1925 JT 4950.53 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(100,763)	(140,317)	(39,554)
JPY	(23,000)	C 1925 JT 5045.1732 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(121,083)	(129,454)	(8,371)
JPY	(28,000)	C 1925 JT 5279.1235 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(138,972)	(949)	138,023
JPY	(26,000)	C 2201 JT 3377.305 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(66,411)	(35)	66,376
JPY	(14,000)	C 2502 JT 6461.5016 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(68,415)	(241,745)	(173,330)
JPY	(14,000)	C 2502 JT 6708.6433 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(85,383)	(4,972)	80,411
JPY	(14,000)	C 2502 JT 6749.2 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(86,615)	(4,853)	81,762
JPY	(22,000)	C 2768 JT 4199.7324 04/04/24 OTC	April 04, 2024	(67,606)	(21,982)	45,624
JPY	(20,000)	C 2768 JT 4303.2686 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(89,034)	(164,770)	(75,736)
JPY	(21,000)	C 2768 JT 4310.553 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(147,000)	(84,840)	62,160
JPY	(20,000)	C 2768 JT 4318.785 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(140,268)	(231,753)	(91,485)
JPY	(20,000)	C 2871 JT 4239.0196 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(232,584)	(1,076,244)	(843,660)
JPY	(21,000)	C 2871 JT 4266.6192 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(200,825)	(1,495,176)	(1,294,351)
JPY	(20,000)	C 2871 JT 4275.25 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(76,344)	(737,941)	(661,597)
JPY	(20,000)	C 2871 JT 4302.1759 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(91,374)	(1,293,074)	(1,201,700)
JPY	(20,000)	C 2871 JT 4320.96 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(115,740)	(1,168,344)	(1,052,604)
JPY	(20,000)	C 2871 JT 4387.112 08/04/24 OTC	April 08, 2024	(38,824)	(90,654)	(51,830)
JPY	(21,000)	C 2871 JT 4388.1658 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(114,237)	(321,356)	(207,119)
JPY	(75,000)	C 3289 JT 1217.965 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(230,287)	(4,350,389)	(4,120,102)
JPY	(34,000)	C 3436 JT 2940.7392 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(69,220)	(691)	68,529
JPY	(33,000)	C 3436 JT 2971.66 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(47,450)	(19)	47,431
JPY	(33,000)	C 3436 JT 3012.0436 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(77,655)	(1,021)	76,634
JPY	(33,000)	C 3436 JT 3101.7595 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(115,440)	(968)	114,472
JPY	(30,000)	C 3436 JT 3173.6983 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(82,467)	(468)	81,999
JPY	(31,000)	C 3436 JT 3203.6571 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(124,142)	(1,354)	122,788
JPY	(130,000)	C 3861 JT 670.596 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(112,736)	(569,838)	(457,102)
JPY	(130,000)	C 3861 JT 672.486 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(38,350)	(214,458)	(176,108)
JPY	(125,000)	C 3861 JT 699.66 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(60,837)	(201,145)	(140,308)
JPY	(130,000)	C 3861 JT 708.3036 02/04/24 OTC	April 02, 2024	(52,832)	(350)	52,482
JPY	(25,000)	C 4063 JT 7090.64 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(217,950)	(1,225,143)	(1,007,193)
JPY	(21,000)	C 4063 JT 7154.73 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(248,346)	(870,125)	(621,779)
JPY	(26,000)	C 4063 JT 7168.192 03/04/24 OTC	April 03, 2024	(225,451)	(20,403)	205,048
JPY	(25,000)	C 4063 JT 7215.56 10/04/24 OTC	April 10, 2024	(247,307)	(156,736)	90,571
JPY	(26,000)	C 4063 JT 7279.9 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(227,133)	(325,029)	(97,896)
JPY	(25,000)	C 4063 JT 7309.89 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(163,432)	(518,715)	(355,283)
JPY	(18,000)	C 4063 JT 7787.34 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(86,070)	(53,861)	32,209
JPY	(18,000)	C 4183 JT 4895.28 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(37,656)	(75,287)	(37,631)
JPY	(18,000)	C 4183 JT 5081.3 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(92,232)	(129,073)	(36,841)
JPY	(17,000)	C 4183 JT 5126.9568 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(92,558)	(94,709)	(2,151)
JPY	(17,000)	C 4183 JT 5165.8466 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(77,033)	(70,946)	6,087

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(17,000)	C 4183 JT 5402.8571 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(58,782)	(1,598)	57,184
JPY	(18,000)	C 4183 JT 5466.6675 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(109,333)	(5,851)	103,482
JPY	(11,000)	C 4186 JT 4552.281 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(89,281)	(2,258,396)	(2,169,115)
JPY	(11,000)	C 4186 JT 4587.52 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(78,848)	(1,864,008)	(1,785,160)
JPY	(21,000)	C 4186 JT 4780.2999 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(123,551)	(2,528,619)	(2,405,068)
JPY	(19,000)	C 4186 JT 5385.6 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(54,264)	(49,970)	4,294
JPY	(19,000)	C 4186 JT 5466.5 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(159,790)	(56,356)	103,434
JPY	(17,000)	C 4452 JT 6487.15 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(67,127)	(42,289)	24,838
JPY	(18,000)	C 4452 JT 6550.4 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(82,022)	(27,307)	54,715
JPY	(18,000)	C 4452 JT 6560.75 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(102,690)	(30,612)	72,078
JPY	(24,000)	C 4768 JT 3893.085 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(78,516)	(22,165)	56,351
JPY	(24,000)	C 4768 JT 3924.5182 17/05/24 OTC	May 17, 2024	(123,525)	(76,348)	47,177
JPY	(120,000)	C 5019 JT 1068.07 05/04/24 OTC	April 05, 2024	(70,644)	(345,403)	(274,759)
JPY	(89,000)	C 5019 JT 1078.0578 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(86,508)	(1,334,461)	(1,247,953)
JPY	(81,000)	C 5019 JT 1104.2686 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(73,920)	(421,305)	(347,385)
JPY	(80,000)	C 5019 JT 1120.385 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(225,960)	(528,986)	(303,026)
JPY	(80,000)	C 5019 JT 1142.3293 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(76,152)	(231,519)	(155,367)
JPY	(76,000)	C 5019 JT 1156.872 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(111,765)	(43,617)	68,148
JPY	(77,000)	C 5019 JT 1178.52 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(151,243)	(72,815)	78,428
JPY	(75,000)	C 5019 JT 1214.754 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(74,677)	(47,063)	27,614
JPY	(45,000)	C 5019 JT 991.86 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(54,877)	(2,520,517)	(2,465,640)
JPY	(16,000)	C 5021 JT 7739.4599 10/04/24 OTC	April 10, 2024	(108,107)	(1,352,281)	(1,244,174)
JPY	(12,000)	C 5021 JT 8090 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(93,196)	(1,364,791)	(1,271,595)
JPY	(11,000)	C 5021 JT 8534.763 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(119,342)	(431,872)	(312,530)
JPY	(10,000)	C 5021 JT 8631.07 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(72,530)	(340,499)	(267,969)
JPY	(20,000)	C 5108 JT 7291.554 14/05/24 OTC	May 14, 2024	(191,884)	(645,608)	(453,724)
JPY	(16,000)	C 5108 JT 7347.6 10/04/24 OTC	April 10, 2024	(80,384)	(10,878)	69,506
JPY	(24,000)	C 5108 JT 7365.15 02/04/24 OTC	April 02, 2024	(135,972)	(26)	135,946
JPY	(14,000)	C 5201 JT 6109.44 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(77,056)	(92,477)	(15,421)
JPY	(14,000)	C 5201 JT 6169.68 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(75,768)	(92,520)	(16,752)
JPY	(14,000)	C 5201 JT 6191.397 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(76,035)	(87,505)	(11,470)
JPY	(14,000)	C 5201 JT 6407.6083 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(85,806)	(9,990)	75,816
JPY	(14,000)	C 5201 JT 6412.9261 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(69,657)	(2,974)	66,683
JPY	(14,000)	C 5201 JT 6432.525 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(101,802)	(10,794)	91,008
JPY	(38,000)	C 5333 JT 2195.3241 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(66,443)	(475,912)	(409,469)
JPY	(39,000)	C 5333 JT 2209.9668 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(38,824)	(467,498)	(428,674)
JPY	(39,000)	C 5333 JT 2272.44 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(53,480)	(265,914)	(212,434)
JPY	(39,000)	C 5333 JT 2279.17 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(52,731)	(229,180)	(176,449)
JPY	(16,000)	C 5706 JT 6056.5666 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(155,344)	(46)	155,298
JPY	(16,000)	C 5706 JT 6326.2082 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(115,899)	(905)	114,994
JPY	(16,000)	C 5706 JT 6372.364 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(85,612)	(42)	85,570
JPY	(29,000)	C 5929 JT 3062.2 14/05/24 OTC	May 14, 2024	(72,790)	(171,968)	(99,178)
JPY	(31,000)	C 5929 JT 3137.73 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(118,621)	(76,084)	42,537
JPY	(22,000)	C 5947 JT 3792.0531 05/04/24 OTC	April 05, 2024	(152,341)	(3,829)	148,512
JPY	(21,000)	C 5947 JT 4028.9792 13/05/24 OTC	May 13, 2024	(192,966)	(89,928)	103,038

ノムラ・マネージド・マスター・トラスト・ジャパン・ハイ・インカム・ストック・エンハンスト・ファンド

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(21,000)	C 5947 JT 4082.5 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(104,370)	(42,391)	61,979
JPY	(46,000)	C 6113 JT 1855.2375 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(118,735)	(508,092)	(389,357)
JPY	(47,000)	C 6113 JT 1860.6228 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(164,434)	(897,848)	(733,414)
JPY	(47,000)	C 6113 JT 1888.0524 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(151,687)	(695,244)	(543,557)
JPY	(46,000)	C 6113 JT 1891.4214 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(83,223)	(162,881)	(79,658)
JPY	(46,000)	C 6113 JT 1891.96 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(82,528)	(585,546)	(503,018)
JPY	(47,000)	C 6113 JT 1922.2751 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(156,801)	(226,480)	(69,679)
JPY	(46,000)	C 6113 JT 1938.9206 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(117,939)	(56,088)	61,851
JPY	(46,000)	C 6113 JT 1956.2786 10/04/24 OTC	April 10, 2024	(118,992)	(9,003)	109,989
JPY	(32,000)	C 6301 JT 4775.69 08/04/24 OTC	April 08, 2024	(125,264)	(166,967)	(41,703)
JPY	(23,000)	C 6301 JT 4956.68 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(98,279)	(222,752)	(124,473)
JPY	(24,000)	C 6301 JT 4959.63 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(152,604)	(246,550)	(93,946)
JPY	(30,000)	C 6301 JT 5009.647 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(137,766)	(68,591)	69,175
JPY	(28,000)	C 6301 JT 5099.2162 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(263,958)	(93,851)	170,107
JPY	(29,000)	C 6301 JT 5099.4475 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(260,971)	(97,041)	163,930
JPY	(29,000)	C 6301 JT 5176.764 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(125,106)	(25,211)	99,895
JPY	(22,000)	C 6301 JT 5189.95 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(69,500)	(48,547)	20,953
JPY	(34,000)	C 6326 JT 2618.42 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(98,079)	(344,120)	(246,041)
JPY	(33,000)	C 6326 JT 2622.7582 05/04/24 OTC	April 05, 2024	(51,344)	(3,775)	47,569
JPY	(33,000)	C 6326 JT 2655 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(66,825)	(23,228)	43,597
JPY	(34,000)	C 6326 JT 2658.4865 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(84,979)	(351,491)	(266,512)
JPY	(34,000)	C 6326 JT 2664.2939 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(74,864)	(318,777)	(243,913)
JPY	(34,000)	C 6326 JT 2665.2 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(83,065)	(331,864)	(248,799)
JPY	(33,000)	C 6326 JT 2729.7492 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(77,655)	(171,422)	(93,767)
JPY	(31,000)	C 6448 JT 2981.198 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(99,289)	(689,347)	(590,058)
JPY	(29,000)	C 6448 JT 3075.62 05/04/24 OTC	April 05, 2024	(58,487)	(29,276)	29,211
JPY	(29,000)	C 6448 JT 3129.105 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(61,004)	(478,441)	(417,437)
JPY	(58,000)	C 6503 JT 2607.0222 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(138,608)	(2,173,723)	(2,035,115)
JPY	(47,000)	C 6503 JT 2621.3493 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(111,084)	(1,736,797)	(1,625,713)
JPY	(57,000)	C 6503 JT 2660.185 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(213,037)	(892,585)	(679,548)
JPY	(10,000)	C 6762 JT 9141 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(109,692)	(5,381)	104,311
JPY	(10,000)	C 6762 JT 9256.275 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(102,848)	(212)	102,636
JPY	(10,000)	C 6762 JT 9771.6666 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(117,260)	(1,796)	115,464
JPY	(32,000)	C 6902 JT 2893.125 03/04/24 OTC	April 03, 2024	(51,846)	(1,226,345)	(1,174,499)
JPY	(45,000)	C 6902 JT 2898.7969 10/04/24 OTC	April 10, 2024	(105,196)	(2,505,323)	(2,400,127)
JPY	(32,000)	C 6902 JT 2989.5512 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(85,555)	(1,176,129)	(1,090,574)
JPY	(40,000)	C 6902 JT 3072.3382 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(120,880)	(988,974)	(868,094)
JPY	(29,000)	C 6902 JT 3074.96 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(89,923)	(336,467)	(246,544)
JPY	(40,000)	C 6902 JT 3095.18 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(153,480)	(965,985)	(812,505)
JPY	(29,000)	C 6902 JT 3106.8 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(150,162)	(611,404)	(461,242)
JPY	(29,000)	C 6902 JT 3109.47 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(151,554)	(317,768)	(166,214)
JPY	(30,000)	C 6902 JT 3115.75 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(61,800)	(432,479)	(370,679)
JPY	(29,000)	C 6902 JT 3197.7045 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(187,026)	(339,328)	(152,302)
JPY	(26,000)	C 6902 JT 3201.5949 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(116,831)	(168,532)	(51,701)
JPY	(28,000)	C 6902 JT 3207.6316 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(82,328)	(121,420)	(39,092)

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(28,000)	C 6902 JT 3239.17 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(59,964)	(33,869)	26,095
JPY	(28,000)	C 6902 JT 3271.2 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(76,328)	(78,451)	(2,123)
JPY	(27,000)	C 6902 JT 3273.475 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(115,284)	(155,998)	(40,714)
JPY	(27,000)	C 6902 JT 3285.505 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(74,544)	(116,440)	(41,896)
JPY	(27,000)	C 6902 JT 3305.4 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(52,061)	(44,171)	7,890
JPY	(40,000)	C 6981 JT 3618.6365 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(179,436)	(759)	178,677
JPY	(42,000)	C 6981 JT 3695.3572 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(181,074)	(347)	180,727
JPY	(48,000)	C 6981 JT 3749.3754 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(160,948)	(69)	160,879
JPY	(23,000)	C 7013 JT 4093.44 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(229,632)	(3,652,969)	(3,423,337)
JPY	(23,000)	C 7013 JT 4282.86 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(120,129)	(1,064,392)	(944,263)
JPY	(22,000)	C 7013 JT 4421.0163 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(86,983)	(1,271,603)	(1,184,620)
JPY	(21,000)	C 7013 JT 4438.75 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(74,571)	(652,156)	(577,585)
JPY	(20,000)	C 7013 JT 4461.6233 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(129,530)	(783,802)	(654,272)
JPY	(47,000)	C 7202 JT 2478.92 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(80,351)	(85,244)	(4,893)
JPY	(62,000)	C 7202 JT 2543.5156 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(138,774)	(18,035)	120,739
JPY	(47,000)	C 7202 JT 2571.6 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(70,504)	(30,194)	40,310
JPY	(62,000)	C 7202 JT 2634.7582 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(177,282)	(2,128)	175,154
JPY	(58,000)	C 7202 JT 2647.7369 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(99,881)	(13,308)	86,573
JPY	(12,000)	C 7203 JT 3591.4238 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(52,988)	(2,900,991)	(2,848,003)
JPY	(12,000)	C 7203 JT 3660.48 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(53,568)	(2,455,657)	(2,402,089)
JPY	(45,000)	C 7203 JT 3961.0043 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(299,574)	(3,724,940)	(3,425,366)
JPY	(45,000)	C 7203 JT 3970.147 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(354,361)	(3,444,353)	(3,089,992)
JPY	(47,000)	C 7203 JT 4000.78 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(395,035)	(2,624,930)	(2,229,895)
JPY	(30,000)	C 7203 JT 4047.05 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(212,469)	(953,396)	(740,927)
JPY	(45,000)	C 7203 JT 4068.957 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(323,122)	(2,324,354)	(2,001,232)
JPY	(35,000)	C 7203 JT 4216.14 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(150,066)	(87,467)	62,599
JPY	(30,000)	C 7203 JT 4224 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(211,200)	(384,179)	(172,979)
JPY	(35,000)	C 7203 JT 4229.0413 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(88,557)	(156,794)	(68,237)
JPY	(34,000)	C 7203 JT 4288.05 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(436,135)	(600,635)	(164,500)
JPY	(30,000)	C 7203 JT 4291.2 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(214,560)	(401,511)	(186,951)
JPY	(34,000)	C 7203 JT 4319.84 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(189,924)	(105,549)	84,375
JPY	(35,000)	C 7203 JT 4357.9676 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(318,321)	(452,613)	(134,292)
JPY	(94,000)	C 7267 JT 1960.7568 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(163,503)	(1,384,550)	(1,221,047)
JPY	(94,000)	C 7267 JT 1988.75 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(119,643)	(494,073)	(374,430)
JPY	(110,000)	C 7267 JT 2033.905 05/04/24 OTC	April 05, 2024	(176,165)	(32,588)	143,577
JPY	(90,000)	C 7267 JT 2040.06 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(227,610)	(1,152,329)	(924,719)
JPY	(90,000)	C 7267 JT 2047.0375 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(221,076)	(617,751)	(396,675)
JPY	(70,000)	C 7267 JT 2090.0396 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(126,126)	(130,687)	(4,561)
JPY	(70,000)	C 7267 JT 2091.3054 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(137,634)	(558,664)	(421,030)
JPY	(70,000)	C 7267 JT 2101.6098 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(307,020)	(452,008)	(144,988)
JPY	(69,000)	C 7267 JT 2128.72 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(124,476)	(93,740)	30,736
JPY	(67,000)	C 7267 JT 2139.34 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(121,471)	(276,222)	(154,751)
JPY	(86,000)	C 7267 JT 2161.2 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(309,772)	(325,968)	(16,196)
JPY	(67,000)	C 7267 JT 2208.4426 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(102,047)	(143,106)	(41,059)
JPY	(72,000)	C 7269 JT 2193.4375 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(126,342)	(4,718)	121,624

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(28,000)	C 7518 JT 3231.78 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(163,178)	(2,886)	160,292
JPY	(28,000)	C 7518 JT 3307.3794 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(91,089)	(219)	90,870
JPY	(28,000)	C 7518 JT 3323.8183 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(137,312)	(473)	136,839
JPY	(3,500)	C 7729 JT 12305 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(51,681)	(694,914)	(643,233)
JPY	(8,000)	C 7729 JT 12716.1125 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(86,078)	(392,328)	(306,250)
JPY	(8,500)	C 7729 JT 14418 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(122,553)	(42,301)	80,252
JPY	(6,000)	C 7729 JT 14988.165 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(182,782)	(17)	182,765
JPY	(3,000)	C 7735 JT 20016 08/04/24 OTC	April 08, 2024	(51,840)	(805,379)	(753,539)
JPY	(5,000)	C 7735 JT 22379 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(79,925)	(187,869)	(107,944)
JPY	(4,500)	C 7735 JT 23522.9 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(84,991)	(82,460)	2,531
JPY	(4,100)	C 7735 JT 26639.35 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(78,576)	(144)	78,432
JPY	(40,000)	C 7751 JT 4619.9875 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(151,476)	(1,448,889)	(1,297,413)
JPY	(37,000)	C 7751 JT 4681.1091 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(161,456)	(1,685,587)	(1,524,131)
JPY	(37,000)	C 7751 JT 4745.0284 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(119,029)	(837,526)	(718,497)
JPY	(25,000)	C 7751 JT 4792.57 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(111,692)	(614,296)	(502,604)
JPY	(29,000)	C 7751 JT 4977.81 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(75,977)	(187,395)	(111,418)
JPY	(63,000)	C 7752 JT 1476.0113 09/04/24 OTC	April 09, 2024	(73,798)	(37,135)	36,663
JPY	(60,000)	C 7752 JT 1491.652 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(67,686)	(320,423)	(252,737)
JPY	(59,000)	C 7752 JT 1509.15 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(74,198)	(307,566)	(233,368)
JPY	(60,000)	C 7752 JT 1512.6923 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(114,408)	(310,889)	(196,481)
JPY	(60,000)	C 7752 JT 1529.1939 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(121,326)	(147,512)	(26,186)
JPY	(60,000)	C 7752 JT 1537.4951 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(76,242)	(66,070)	10,172
JPY	(63,000)	C 7752 JT 1568.2423 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(47,804)	(8,036)	39,768
JPY	(23,000)	C 8001 JT 7910.4 09/04/24 OTC	April 09, 2024	(318,393)	(48)	318,345
JPY	(19,000)	C 8001 JT 7924.21 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(253,042)	(62,098)	190,944
JPY	(19,000)	C 8001 JT 7980.5 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(315,894)	(5,124)	310,770
JPY	(19,000)	C 8001 JT 8035.61 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(126,179)	(619)	125,560
JPY	(18,000)	C 8001 JT 8073.8182 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(254,325)	(3,566)	250,759
JPY	(19,000)	C 8001 JT 8076.024 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(139,494)	(63)	139,431
JPY	(19,000)	C 8001 JT 8084.844 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(140,810)	(3,536)	137,274
JPY	(8,000)	C 8015 JT 11405.88 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(85,060)	(291,803)	(206,743)
JPY	(8,000)	C 8015 JT 11419.2 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(76,128)	(487,120)	(410,992)
JPY	(7,800)	C 8015 JT 11559.66 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(113,653)	(385,352)	(271,699)
JPY	(7,700)	C 8015 JT 11869.65 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(117,174)	(220,132)	(102,958)
JPY	(11,000)	C 8015 JT 12195.81 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(84,506)	(32,480)	52,026
JPY	(7,700)	C 8015 JT 12227.84 08/04/24 OTC	April 08, 2024	(58,846)	(1,884)	56,962
JPY	(7,000)	C 8031 JT 7004.79 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(46,100)	(1,504,160)	(1,458,060)
JPY	(8,000)	C 8031 JT 7017.43 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(70,764)	(1,477,964)	(1,407,200)
JPY	(25,000)	C 8031 JT 7030.9166 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(457,895)	(5,433,677)	(4,975,782)
JPY	(25,000)	C 8031 JT 7114.9192 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(316,552)	(5,803,775)	(5,487,223)
JPY	(30,000)	C 8031 JT 7120.8 04/04/24 OTC	April 04, 2024	(409,446)	(2,590,177)	(2,180,731)
JPY	(25,000)	C 8031 JT 7199.7996 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(238,010)	(4,281,660)	(4,043,650)
JPY	(19,000)	C 8031 JT 7515.25 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(310,412)	(1,879,749)	(1,569,337)
JPY	(19,000)	C 8031 JT 7650.76 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(379,211)	(1,140,020)	(760,809)
JPY	(18,000)	C 8031 JT 7931.1879 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(218,644)	(419,482)	(200,838)

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(18,000)	C 8031 JT 8080.0029 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(308,899)	(305,328)	3,571
JPY	(19,000)	C 8031 JT 8234.84 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(229,297)	(272,682)	(43,385)
JPY	(2,200)	C 8035 JT 39038.8 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(101,042)	(4,258,499)	(4,157,457)
JPY	(3,800)	C 8035 JT 42547.2 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(442,092)	(2,982,253)	(2,540,161)
JPY	(3,600)	C 8035 JT 45111.3 17/04/24 OTC	April 17, 2024	(214,016)	(311,887)	(97,871)
JPY	(2,700)	C 8035 JT 45937.5 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(119,070)	(46,206)	72,864
JPY	(3,600)	C 8035 JT 46028.8 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(517,824)	(685,003)	(167,179)
JPY	(3,600)	C 8035 JT 46193.4 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(277,160)	(567,165)	(290,005)
JPY	(2,800)	C 8035 JT 47749.5 22/04/24 OTC	April 22, 2024	(122,472)	(100,276)	22,196
JPY	(3,000)	C 8035 JT 48008.4 10/04/24 OTC	April 10, 2024	(87,288)	(5,702)	81,586
JPY	(2,500)	C 8035 JT 49400 15/04/24 OTC	April 15, 2024	(148,200)	(7,778)	140,422
JPY	(2,600)	C 8035 JT 50154 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(300,924)	(131,062)	169,862
JPY	(11,000)	C 8058 JT 3302.6134 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(60,548)	(2,610,556)	(2,550,008)
JPY	(13,000)	C 8058 JT 3352.69 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(72,041)	(2,354,828)	(2,282,787)
JPY	(33,000)	C 8058 JT 3810 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(314,325)	(726,027)	(411,702)
JPY	(24,000)	C 8058 JT 3855.9675 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(76,483)	(521,667)	(445,184)
JPY	(38,000)	C 8058 JT 4048.668 24/05/24 OTC	May 24, 2024	(412,767)	(562,786)	(150,019)
JPY	(36,000)	C 8058 JT 4081.4711 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(127,767)	(131,163)	(3,396)
JPY	(81,000)	C 8306 JT 1843.82 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(154,499)	(591)	153,908
JPY	(80,000)	C 8306 JT 1856 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(89,600)	(10,846)	78,754
JPY	(81,000)	C 8306 JT 1859.165 19/04/24 OTC	April 19, 2024	(136,906)	(4,199)	132,707
JPY	(30,000)	C 8309 JT 3883.98 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(81,768)	(9,326)	72,442
JPY	(45,000)	C 8591 JT 3446.52 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(140,994)	(2,130,197)	(1,989,203)
JPY	(45,000)	C 8591 JT 3461.5983 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(141,610)	(1,602,160)	(1,460,550)
JPY	(41,000)	C 8591 JT 3493.62 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(122,426)	(1,829,869)	(1,707,443)
JPY	(42,000)	C 8591 JT 3544.72 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(126,168)	(1,288,355)	(1,162,187)
JPY	(40,000)	C 8591 JT 3559.0931 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(86,656)	(341,236)	(254,580)
JPY	(41,000)	C 8591 JT 3569.6 16/04/24 OTC	April 16, 2024	(254,528)	(313,591)	(59,063)
JPY	(40,000)	C 8591 JT 3569.6 23/04/24 OTC	April 23, 2024	(99,328)	(545,670)	(446,342)
JPY	(44,000)	C 8591 JT 3589.6588 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(159,271)	(1,064,245)	(904,974)
JPY	(31,000)	C 8591 JT 3596.79 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(98,673)	(510,932)	(412,259)
JPY	(32,000)	C 8591 JT 3610.77 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(80,377)	(526,818)	(446,441)
JPY	(31,000)	C 8591 JT 3627.9846 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(68,457)	(567,698)	(499,241)
JPY	(32,000)	C 8591 JT 3660.54 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(102,752)	(538,828)	(436,076)
JPY	(30,000)	C 8591 JT 3678.0558 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(156,237)	(304,698)	(148,461)
JPY	(32,000)	C 8591 JT 3685.32 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(101,664)	(441,227)	(339,563)
JPY	(30,000)	C 8591 JT 3826.98 10/05/24 OTC	May 10, 2024	(100,710)	(167,426)	(66,716)
JPY	(11,000)	C 8766 JT 4611.6557 02/04/24 OTC	April 02, 2024	(33,539)	(1,466,373)	(1,432,834)
JPY	(9,000)	C 8766 JT 4622.2124 18/04/24 OTC	April 18, 2024	(45,445)	(1,643,825)	(1,598,380)
JPY	(9,000)	C 8766 JT 4630.2242 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(41,328)	(1,401,928)	(1,360,600)
JPY	(9,000)	C 8766 JT 4630.29 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(70,038)	(1,744,410)	(1,674,372)
JPY	(19,000)	C 8766 JT 4664.7411 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(109,871)	(3,671,721)	(3,561,850)
JPY	(38,000)	C 8766 JT 4691.0547 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(206,252)	(6,622,474)	(6,416,222)
JPY	(35,000)	C 8766 JT 5121.72 13/05/24 OTC	May 13, 2024	(218,610)	(1,903,997)	(1,685,387)
JPY	(37,000)	C 8766 JT 5159.624 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(250,367)	(1,500,470)	(1,250,103)

通貨	契約数	銘柄	満期日	費用(円)	評価額(円)	未実現損益(円)
JPY	(34,000)	C 8766 JT 5321.274 15/05/24 OTC	May 15, 2024	(291,811)	(957,795)	(665,984)
JPY	(35,000)	C 8766 JT 5413.6214 14/05/24 OTC	May 14, 2024	(415,926)	(664,528)	(248,602)
JPY	(28,000)	C 8766 JT 5427.48 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(147,067)	(157,944)	(10,877)
JPY	(26,000)	C 8766 JT 5441.8257 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(99,288)	(191,888)	(92,600)
JPY	(34,000)	C 8766 JT 5486.8646 12/04/24 OTC	April 12, 2024	(229,367)	(10,214)	219,153
JPY	(33,000)	C 8766 JT 5511.63 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(443,619)	(100,935)	342,684
JPY	(26,000)	C 8766 JT 5608.5771 30/04/24 OTC	April 30, 2024	(99,707)	(76,970)	22,737
JPY	(33,000)	C 8804 JT 2742.56 08/05/24 OTC	May 08, 2024	(89,020)	(1,086,628)	(997,608)
JPY	(31,000)	C 8804 JT 2881.585 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(52,548)	(182,903)	(130,355)
JPY	(8,500)	C 9147 JT 10030.99 11/04/24 OTC	April 11, 2024	(81,556)	(58)	81,498
JPY	(670,000)	C 9432 JT 200.53 09/05/24 OTC	May 09, 2024	(122,141)	(139,668)	(17,527)
JPY	(680,000)	C 9432 JT 202.371 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(87,584)	(56,726)	30,858
JPY	(810,000)	C 9432 JT 204.6967 07/05/24 OTC	May 07, 2024	(102,708)	(63,715)	38,993
JPY	(800,000)	C 9432 JT 207.312 02/05/24 OTC	May 02, 2024	(148,080)	(20,816)	127,264
JPY	(2,800)	C 9435 JT 33179.25 15/05/24 OTC	May 15, 2024	(67,977)	(71,380)	(3,403)
JPY	(62,000)	C 9508 JT 1494.6 24/04/24 OTC	April 24, 2024	(61,776)	(129,426)	(67,650)
JPY	(57,000)	C 9508 JT 1538.511 26/04/24 OTC	April 26, 2024	(187,381)	(47,971)	139,410
JPY	(57,000)	C 9508 JT 1547.581 25/04/24 OTC	April 25, 2024	(60,317)	(33,665)	26,652
				(41,803,703)	(202,721,989)	(160,918,286)
				(41,803,703)	(202,721,989)	(160,918,286)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日2024年8月19日）

作成対象期間（2023年8月22日～2024年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<https://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			
18期(2020年8月19日)	円 10,203		% △0.0	% 68.2	% —	百万円 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
22期(2024年8月19日)	10,198		0.0	67.7	—	3,413

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

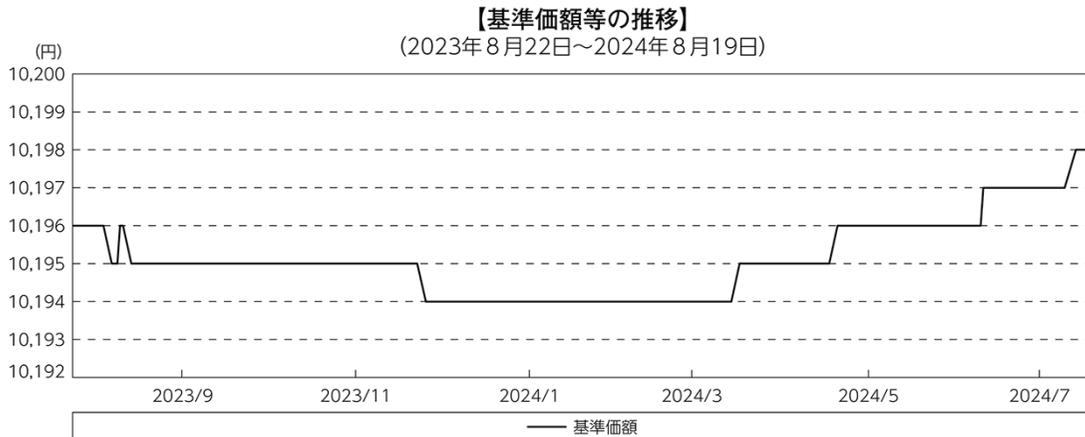
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰	落率			
(期首) 2023年8月21日	円 10,196		% —	% 5.7	% —	% —
8月末	10,196		0.0	5.3	—	—
9月末	10,195		△0.0	10.5	—	—
10月末	10,195		△0.0	9.3	—	—
11月末	10,195		△0.0	12.6	—	—
12月末	10,194		△0.0	10.1	—	—
2024年1月末	10,194		△0.0	4.3	—	—
2月末	10,194		△0.0	5.6	—	—
3月末	10,194		△0.0	11.7	—	—
4月末	10,195		△0.0	28.1	—	—
5月末	10,196		0.0	64.1	—	—
6月末	10,196		0.0	55.7	—	—
7月末	10,197		0.0	3.8	—	—
(期末) 2024年8月19日	10,198		0.0	67.7	—	—

*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のインカムゲイン（利子収入）等。

○投資環境

国内経済は、緩やかな回復が続きました。このような中、日銀は2023年10月に実質的な長期金利の上限+1%を「上限の目途」と変更しました。また2024年3月にはイールドカーブ・コントロールの運用やマイナス金利政策を解除するとともに、無担保コール翌日物レートの誘導目標を0～0.1%程度とし、7月には0～0.1%程度から0.25%程度への引き上げを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りおよび無担保コール翌日物レートは期首よりそれぞれ-0.3%～-0.1%程度、-0.1%～0%程度で推移しましたが、上記のような環境のもとで、期末にかけてはそれぞれ0.1%前後、0.23%程度で推移しました。

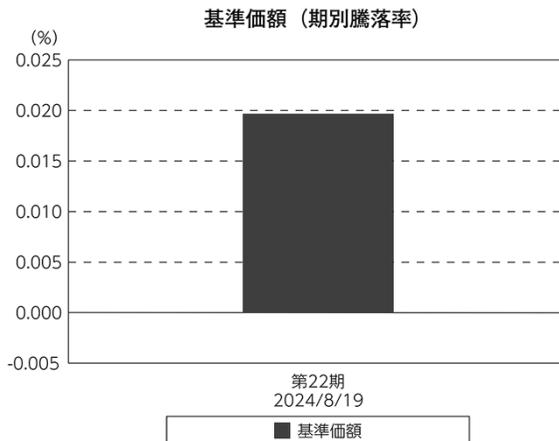
○当ファンドのポートフォリオ

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。

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

(2023年8月22日～2024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

(2023年8月22日～2024年8月19日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	217,190,000	215,090,584
	地方債証券	570,798	(720,000)
	特殊債券	1,241,289	(1,164,000)
	社債券 (投資法人債券を含む)	120,046	(220,000)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分です。

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

○ 利害関係人との取引状況等

(2023年8月22日～2024年8月19日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 1,932	百万円 157	8.1	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

(2024年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	2,100,000	2,100,000	61.5	—	61.5	—	—
	(2,100,000)	(2,100,000)	(61.5)	(—)	(61.5)	(—)	(—)
地方債証券	80,000	80,030	2.3	—	—	—	2.3
	(80,000)	(80,030)	(2.3)	(—)	(—)	(—)	(2.3)
特殊債券 (除く金融債)	130,000	130,078	3.8	—	—	—	3.8
	(130,000)	(130,078)	(3.8)	(—)	(—)	(—)	(3.8)
合 計	2,310,000	2,310,108	67.7	—	61.5	—	6.2
	(2,310,000)	(2,310,108)	(67.7)	(—)	(61.5)	(—)	(6.2)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期		末		償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	額	
国債証券	%	千円	千円		
国債バスケット(変動利付・利付・国庫短期証券)※	—	2,100,000	2,100,000		—
小 計		2,100,000	2,100,000		
地方債証券					
相模原市 公募平成26年度第1回	0.529	80,000	80,030		2024/9/20
小 計		80,000	80,030		
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225回	0.556	50,000	50,007		2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	0.539	80,000	80,071		2024/10/31
小 計		130,000	130,078		
合 計		2,310,000	2,310,108		

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

**※印は現先で保有している債券です。

○投資信託財産の構成

(2024年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,310,108	55.3
コール・ローン等、その他	1,867,200	44.7
投資信託財産総額	4,177,308	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 (2024年8月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,177,308,064
コール・ローン等	1,785,184,058
公社債(評価額)	2,310,108,969
未収利息	174,151
前払費用	71,886
差入委託証拠金	81,769,000
(B) 負債	763,418,000
未払解約金	763,418,000
(C) 純資産総額(A-B)	3,413,890,064
元本	3,347,617,461
次期繰越損益金	66,272,603
(D) 受益権総口数	3,347,617,461口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,198円

(注) 期首元本額は6,603,862,387円、期中追加設定元本額は23,993,903,041円、期中一部解約元本額は27,250,147,967円、1口当たり純資産額は1.0198円です。

○損益の状況 (2023年8月22日～2024年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,208,786
受取利息	3,779,241
その他収益金	175,069
支払利息	△ 745,524
(B) 有価証券売買損益	△ 2,200,748
売買益	45,802
売買損	△ 2,246,550
(C) 当期損益金(A+B)	1,008,038
(D) 前期繰越損益金	129,271,098
(E) 追加信託差損益金	467,816,959
(F) 解約差損益金	△531,823,492
(G) 計(C+D+E+F)	66,272,603
次期繰越損益金(G)	66,272,603

*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)	1,407,593,108
野村アンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2210(適格機関投資家販売制限付)	1,110,121,107
ムラ・プライベート・シリーズDCアンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2012(適格機関投資家販売制限付)	351,175,044
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	241,254,938
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投信	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
ネクストコア	2,282,012
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834

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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(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
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース) 年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資(円コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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PMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(中国元コース) 毎月分配型	982,607
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 毎月分配型	982,607
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム(円コース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(円コース) 年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース) 年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村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
野村日本高配当株エンハンス戦略(除く金融)オープン(適格機関投資家専用)	931,647
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
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(豪ドルコース) 年2回決算型	132,547
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(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(トルコリラコース) 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PMCO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PMCO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PMCO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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	98,261
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
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
ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA向け）	10,000
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（米ドルコース）年2回決算型	9,809
野村アバンティス米国小型株ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	9,809
野村アバンティス米国小型株ファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	9,809
野村アバンティス新興国株ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	9,809
野村アバンティス新興国株ファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村アジアハイ・イールド債券投信（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（メキシコベソコース）毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコベソコース）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
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース（野村SMA・EW向け）	9,806
ウェリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース（野村SMA・EW向け）	9,806
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

〇お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する所要の約款変更を行ないました。

＜変更適用日：2024年7月4日＞