

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)

運用報告書(全体版)

第10期（決算日2024年12月6日）

作成対象期間（2023年12月7日～2024年12月6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／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）		
信託期間	2015年4月1日以降、無期限とします。		
運用方針	円建ての外国投資法人であるブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）（以下「クラスS-JPY」といいます。）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、新興国を含む世界各国の投資適格格付債券を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、クラスS-JPY受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。		
主な投資対象	野村ブルーベイ・トータルリターンファンド（野村SMA・EW向け）	クラスS-JPY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、短期金融商品等に直接投資する場合があります。	
	クラスS-JPY	新興国を含む世界各国の投資適格格付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	野村ブルーベイ・トータルリターンファンド（野村SMA・EW向け）	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、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘案して分配します。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 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 込 配 金	期 騰 落 中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
6 期(2020年12月 7 日)	10, 289	10	4. 4	0. 0	—	98. 1	906
7 期(2021年12月 6 日)	10, 182	10	△0. 9	0. 0	—	97. 6	930
8 期(2022年12月 6 日)	10, 221	10	0. 5	0. 0	—	96. 8	1, 484
9 期(2023年12月 6 日)	10, 353	10	1. 4	0. 0	—	97. 8	1, 818
10期(2024年12月 6 日)	10, 465	10	1. 2	0. 0	—	97. 1	1, 992

* 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。

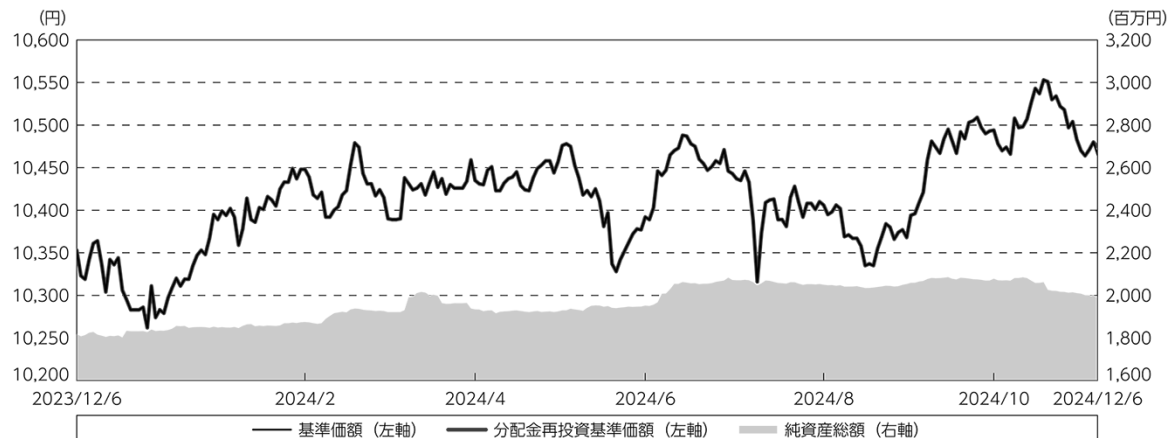
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	託 券 率
		騰 落 率	率				
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2023年12月 6 日	10, 353	—	0. 0	—	97. 8		
12月末	10, 262	△0. 9	0. 0	—	97. 8		
2024年 1 月末	10, 394	0. 4	0. 0	—	98. 0		
2 月末	10, 448	0. 9	0. 0	—	97. 7		
3 月末	10, 390	0. 4	0. 0	—	97. 8		
4 月末	10, 435	0. 8	0. 0	—	97. 7		
5 月末	10, 476	1. 2	0. 0	—	97. 7		
6 月末	10, 392	0. 4	0. 0	—	97. 5		
7 月末	10, 437	0. 8	0. 0	—	97. 8		
8 月末	10, 406	0. 5	0. 0	—	97. 8		
9 月末	10, 377	0. 2	0. 0	—	97. 6		
10月末	10, 494	1. 4	0. 0	—	97. 5		
11月末	10, 483	1. 3	0. 0	—	98. 0		
(期 末)							
2024年12月 6 日	10, 475	1. 2	0. 0	—	97. 1		

* 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

○期中の基準価額等の推移



- （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6日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- （注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- （注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

- ・金利戦略では、日本金利のショート・ポジションなどがプラスに寄与しました。
- ・通貨戦略では、ブラジル・レアルのロング・ポジションなどがマイナスに影響しました。
- ・社債戦略では、個別銘柄選択による寄与がプラスとなりました。

○投資環境

当作成期間の世界債券市場は、当作成期前半、米国債利回りが上昇（価格は下落）する局面もありましたが、その後、インフレが鈍化する中、FRB（米連邦準備制度理事会）が利下げを行なうとの期待などから利回りが低下（価格は上昇）し、当作成期間では米国債利回りはほぼ横ばいとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

【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）】

主要投資対象である円建ての外国投資法人である「ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）」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「ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）」受益証券を高位に組み入れました。

【ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）】

- ・新興国を含む世界各国の投資適格格付債券※を主要投資対象とし、デリバティブ取引および為替予約取引等を活用することで、ユーロの短期金利水準を上回る収益の獲得を目指す運用を行ないました。
- ・効率的な運用を行なうために、為替、債券、金利、クレジット、または各種指数等を参照するデリバティブ取引（オプション取引、先物取引、先渡取引（NDF（ノン・デリバラブル・フォワード）を含みます。）、スワップ取引等）を活用しました。
- ・買い建てによるロング・ポジションだけでなく売り建てによるショート・ポジションを組み合わせて、ポートフォリオの構築を行ないました。
- ・ファンドの全クラスが共有するポートフォリオの通貨配分にかかわらず、当該クラスの純資産総額をユーロ換算した額とほぼ同額程度のユーロ売り円買いの為替取引を行なうことを基本としました。

※債券の投資適格格付は、S&Pグローバル・レーティングもしくはムーディーズ・レーティングス、またはその他の格付機関による投資適格格付（BBB-相当格）以上とします。

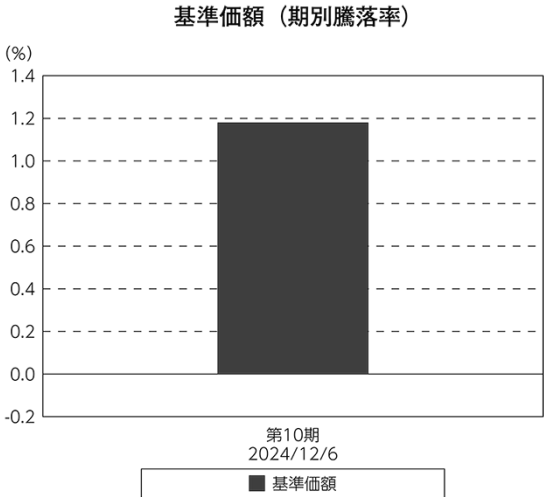
【野村マネー マザーファンド】

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、期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、利子・配当収入や基準価額水準を勘案し、信託報酬など諸経費を差し引いた額をベースに決定しました。

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10期
	2023年12月 7 日～ 2024年12月 6 日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0. 095%
当期の収益	10
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	781

（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

【野村ブルーベイ・トータルリターンファンド（野村SMA・EW向け）】

「ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）」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。通常の状況においては、「ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）」の組み入れを高位に維持します。

【ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド（クラスS-JPY）】

- ・新興国を含む世界各国の投資適格格付債券※を主要投資対象とし、デリバティブ取引および為替予約取引等を活用することで、短期金利水準を上回る収益の獲得を目指す運用を行なっていく方針です。
- ・効率的な運用を行なうために、為替、債券、金利、クレジット、または各種指数等を参照するデリバティブ取引（オプション取引、先物取引、先渡取引（NDF（ノン・デリバラブル・フォワード）を含みます。）、スワップ取引等）を活用します。
- ・ファンドの全クラスが共有するポートフォリオの通貨配分にかかわらず、当該クラスの純資産総額をユーロ換算した額とほぼ同額程度のユーロ売り円買いの為替取引を行なうことを基本としていきます。

※債券の投資適格格付は、S&Pグローバル・レーティングもしくはムーディーズ・レーティングス、またはその他の格付機関による投資適格格付（BBB-相当格）以上とします。

【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受け、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7日～2024年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 44	% 0.418	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(34)	(0.330)	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)	(6)	(0.055)	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)	(0.033)	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＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(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	44	0.420	
期中の平均基準価額は、10,416円です。			

＊期中の費用（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。

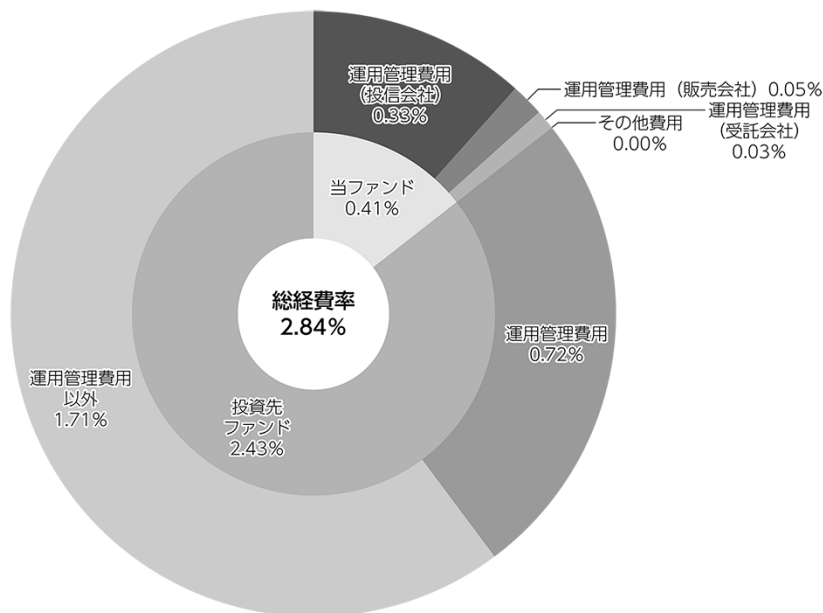
＊各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

＊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）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・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。）を期中の平均受益権口数に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2.84%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	2.84
①当ファンドの費用の比率	0.41
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.72
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	1.71

(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) 投資先ファンドの運用管理費用以外には、デリバティブ取引に係る支払利息が含まれます。

(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7日～2024年12月6日）

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド (クラスS-JPY)	口	千円	口	千円
		30,068	330,000	18,634	205,500

*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7日～2024年12月6日）

利害関係人との取引状況

＜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）＞

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	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 882	百万円 140	% 15.9	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12月6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	期首(前期末)	当		期	末
		口数	口数	評価額	比率	
		口	口	千円		%
ブルーベイ・ファンズ-ブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド (クラスS-JPY)		163,522	174,956	1,935,055		97.1
合 計		163,522	174,956	1,935,055		97.1

*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	期首(前期末)	当		期	末
		口数	口数	評価額		
		千口	千口	千円		
野村マネー マザーファンド		9	9	10		

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年12月6日現在)

項	目	当		期	末
		評価額	比率		
		千円			%
投資信託受益証券		1,935,055			96.4
野村マネー マザーファンド		10			0.0
コール・ローン等、その他		72,943			3.6
投資信託財産総額		2,008,008			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12月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,008,008,708
コール・ローン等	52,442,379
投資信託受益証券(評価額)	1,935,055,986
野村マネー マザーファンド(評価額)	10,001
未収入金	20,500,000
未収利息	342
(B) 負債	15,212,954
未払収益分配金	1,904,258
未払解約金	9,027,517
未払信託報酬	4,258,823
その他未払費用	22,356
(C) 純資産総額(A－B)	1,992,795,754
元本	1,904,258,485
次期繰越損益金	88,537,269
(D) 受益権総口数	1,904,258,485口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,465円

(注) 期首元本額は1,756,440,599円、期中追加設定元本額は573,008,641円、期中一部解約元本額は425,190,755円、1口当たり純資産額は1.0465円です。

○損益の状況（2023年12月7日～2024年12月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	61,671
受取利息	63,439
支払利息	△ 1,768
(B) 有価証券売買損益	28,354,438
売買益	31,548,657
売買損	△ 3,194,219
(C) 信託報酬等	△ 8,254,516
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	20,161,593
(E) 前期繰越損益金	28,587,246
(F) 追加信託差損益金	41,692,688
(配当等相当額)	(102,026,030)
(売買損益相当額)	(△ 60,333,342)
(G) 計(D＋E＋F)	90,441,527
(H) 収益分配金	△ 1,904,258
次期繰越損益金(G＋H)	88,537,269
追加信託差損益金	41,692,688
(配当等相当額)	(102,026,030)
(売買損益相当額)	(△ 60,333,342)
分配準備積立金	46,844,581

* 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(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7日～2024年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年12月7日～ 2024年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	43,518円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	20,104,210円
c. 信託約款に定める収益調整金	102,026,030円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	28,601,111円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	150,774,869円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	791円
g. 分配金	1,904,258円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10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＞

2024年11月5日より、ファンドの設定解約の申込締切時間を以下の記載のとおり変更いたしました。

原則、午後3時30分までに、販売会社が受付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。）

ブルーベイ・ファンズーブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンド(クラスS-JPY)

2024年6月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ルクセンブルグ籍外国投資法人
運 用 方 針	クラスS-JPYを含むブルーベイ・ファンズーブルーベイ・インベストメント・グレード・アブソリュート・リターン・ボンド・ファンドの全クラスが共有するポートフォリオはユーロ建てであり、当該共有ポートフォリオを通じて、新興国を含む世界各国の投資適格格付債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引および為替予約取引等を活用することで、ユーロの短期金利水準を上回る収益の獲得を目指す運用を行ないます。なお、投資適格格付未満の債券等に投資する場合があります。
投 資 対 象	新興国を含む世界各国の投資適格格付債券
管 理 会 社	ブルーベイ・ファンズ・マネージメント・カンパニー・エス・エイ
投 資 顧 問 会 社	RBC グローバル・アセット・マネジメント(UK)リミテッド
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 受 託 銀 行	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。

2024年6月30日に終了した年度の連結損益計算書および純資産変動計算書

	ユーロ		ユーロ
収益		当期末実現評価損益:	
投資有価証券に係る受取利息 (源泉徴収税額控除後)	39,708,617	- 投資有価証券	54,140,175
スワップ契約に係る受取利息	5,718,384	- 外国為替先渡契約	13,103,064
銀行利息	2,506,970	- 先物契約	(1,369,521)
その他収益	125,109	- スワップ契約	5,005,154
		- 外国為替取引	120,403
収益合計	48,059,080	当期損益	35,029,396
費用		資本取引	
運用報酬	5,293,737	受益証券の申込み	187,877,140
成功報酬	3,698	受益証券の買戻し	(249,112,423)
年次税	232,567	分配金	(6,417,563)
取締役報酬	7,194	分配金再投資	1,570,632
管理報酬	313,049	当期純資産の増減額合計	(31,052,818)
預託費用	92,500		
専門家報酬	36,244	期首純資産	896,912,626
取引費用	104,597		
スワップ契約に係る支払利息	14,914,221	期末純資産合計	865,859,808
銀行支払利息	176		
その他費用	140,081		
費用合計	21,138,064		
費用(支払)／費用上限の払戻し	(284,531)		
純投資収益	26,636,485		
当期実現純評価損益:			
- 投資有価証券	(30,193,753)		
- 外国為替先渡契約	(49,462,626)		
- 先物契約	25,914,076		
- スワップ契約	(10,401,706)		
- 外国為替取引	1,537,645		
純投資収益および			
当期実現純評価損益	(35,969,879)		

投資有価証券およびその他純資産明細表(2024年6月30日現在)

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
公的市場に上場している譲渡可能証券						
債券						
オーストラリア						
NBN Co Ltd	4.38%	15/03/33	EUR	4,909	5,173,969	0.60
NBN Co Ltd	3.75%	22/03/34	EUR	4,452	4,465,228	0.51
					<u>9,639,197</u>	<u>1.11</u>
ベルギー						
Anheuser-Busch InBev SA/NV	3.75%	22/03/37	EUR	4,286	4,267,748	0.49
Anheuser-Busch InBev SA/NV	3.95%	22/03/44	EUR	3,117	3,064,646	0.36
Lonza Finance International NV	3.88%	24/04/36	EUR	2,488	2,456,172	0.28
UCB SA	4.25%	20/03/30	EUR	4,800	4,795,078	0.56
					<u>14,583,644</u>	<u>1.69</u>
カナダ						
Alimentation Couche-Tard Inc	3.65%	12/05/31	EUR	2,300	2,282,420	0.26
Alimentation Couche-Tard Inc	4.01%	12/02/36	EUR	1,202	1,186,833	0.14
					<u>3,469,253</u>	<u>0.40</u>
チェコ共和国						
EPH Financing International AS	5.88%	30/11/29	EUR	2,688	2,702,291	0.31
デンマーク						
Orsted AS	3.63%	01/03/26	EUR	4,820	4,828,628	0.56
TDC Net A/S	5.19%	02/08/29	EUR	4,504	4,577,977	0.53
TDC Net A/S	5.62%	06/02/30	EUR	3,730	3,833,904	0.44
Vestas Wind Systems A/S	4.13%	15/06/31	EUR	5,790	5,867,223	0.68
					<u>19,107,732</u>	<u>2.21</u>
フィンランド						
Fortum Oyj	4.50%	26/05/33	EUR	3,392	3,532,968	0.41
Nordea Bank Abp, VRB	3.63%	10/02/26	EUR	5,186	5,178,042	0.60
					<u>8,711,010</u>	<u>1.01</u>
フランス						
Alstom SA, VRB	5.87%	31/12/49†	EUR	2,300	2,337,489	0.27
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.38%	02/05/30	EUR	6,300	6,439,506	0.74
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	4,500	4,701,972	0.54
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	9,500	8,485,264	0.98
BNP Paribas SA, VRB	7.38%	31/12/49†	EUR	2,200	2,290,430	0.27
BNP Paribas SA, VRB	4.04%	10/01/32	EUR	2,600	2,599,650	0.30
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	7,000	7,310,847	0.84
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	2,017	1,903,162	0.22
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	8,600	8,902,824	1.03
BPCE SA, VRB	4.75%	14/06/34	EUR	2,900	3,049,597	0.35
BPCE SA, VRB	4.25%	11/01/35	EUR	3,400	3,440,756	0.40
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	2,800	2,896,051	0.33

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
Credit Agricole SA	3.75%	22/01/34	EUR	3,100	3,096,750	0.36
Credit Agricole SA	4.13%	26/02/36	EUR	2,800	2,814,088	0.33
Credit Agricole SA, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	4,400	4,406,680	0.51
Electricite de France SA	4.63%	25/01/43	EUR	3,700	3,670,947	0.42
Electricite de France SA	4.75%	17/06/44	EUR	2,900	2,905,566	0.34
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	4,800	5,133,117	0.59
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	2,200	1,924,289	0.22
Electricite de France SA, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	2,700	2,699,499	0.31
Electricite de France SA, VRB	5.00%	31/12/49†	EUR	5,300	5,266,545	0.61
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	3,700	3,780,917	0.44
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	2,800	2,835,726	0.33
Indigo Group SAS	4.50%	18/04/30	EUR	4,000	4,088,891	0.47
Societe Generale SA, VRB	7.88%	31/12/49†	EUR	4,400	4,481,172	0.52
TDF Infrastructure SASU	5.63%	21/07/28	EUR	3,100	3,240,879	0.37
TotalEnergies SE, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	3,848	3,796,610	0.44
					108,499,224	12.53
ドイツ						
Bayer AG	4.63%	26/05/33	EUR	2,111	2,166,175	0.25
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	2,800	2,835,613	0.33
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	2,900	2,998,348	0.35
Commerzbank AG, VRB	4.63%	17/01/31	EUR	2,000	2,039,869	0.24
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	3,000	2,975,870	0.34
Deutsche Bank AG, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	400	385,298	0.04
Deutsche Bank AG, VRB	8.13%	31/12/49†	EUR	2,800	2,822,605	0.33
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	2,200	2,368,890	0.27
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	5,700	5,014,731	0.58
Deutsche Post AG	3.50%	25/03/36	EUR	6,709	6,567,498	0.76
HOCHTIEF AG	4.25%	31/05/30	EUR	7,528	7,580,338	0.87
Volkswagen Financial Services AG	3.88%	10/09/30	EUR	3,548	3,546,764	0.41
Volkswagen Leasing GmbH	3.88%	11/10/28	EUR	4,650	4,665,928	0.54
Volkswagen Leasing GmbH	4.00%	11/04/31	EUR	1,880	1,890,414	0.22
					47,858,341	5.53
アイスランド						
Iceland Rikisbref	7.00%	17/09/35	ISK	1,256,082	8,607,337	0.99
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	499,185	2,672,145	0.31
					11,279,482	1.30
イタリア						
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	3,119	2,739,639	0.32
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	04/12/28	EUR	2,014	1,856,011	0.21
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	15/01/30	EUR	8,898	7,976,154	0.92
Autostrade per l'Italia SpA	4.25%	28/06/32	EUR	1,280	1,263,785	0.15
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	2,830	3,130,328	0.36
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	506	483,892	0.06
UniCredit SpA	4.20%	11/06/34	EUR	6,190	6,072,447	0.70
					23,522,256	2.72

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
ルクセンブルグ						
Becton Dickinson Euro Finance Sarl	4.03%	07/06/36	EUR	5,407	5,417,592	0.63
CK Hutchison Group Telecom Finance SA	2.63%	17/10/34	GBP	3,037	2,616,398	0.30
Eurofins Scientific SE	4.75%	06/09/30	EUR	2,784	2,796,625	0.32
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	3,559	3,598,137	0.42
					<u>14,428,752</u>	<u>1.67</u>
メキシコ						
Mexican Bonos	5.50%	04/03/27	MXN	831,800	37,789,178	4.37
Mexican Bonos	8.50%	01/03/29	MXN	131,860	6,336,356	0.73
Mexican Bonos	8.50%	31/05/29	MXN	133,650	6,430,722	0.74
Mexican Bonos	7.75%	29/05/31	MXN	155,960	7,118,443	0.82
Mexican Bonos	7.50%	26/05/33	MXN	62,720	2,757,149	0.32
Mexico Government International Bond	4.00%	15/03/15^	EUR	22,229	16,383,335	1.89
					<u>76,815,183</u>	<u>8.87</u>
多国籍						
Aptiv Plc / Aptiv Global Financing Ltd	4.25%	11/06/36	EUR	4,728	4,681,270	0.54
オランダ						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	2,600	2,537,248	0.29
Achmea BV, VRB	5.63%	02/11/44	EUR	3,000	3,014,860	0.35
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	1,600	1,499,599	0.17
ING Groep NV, VRB	4.75%	23/05/34	EUR	1,200	1,270,332	0.15
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	3,600	3,808,375	0.44
JAB Holdings BV	4.38%	25/04/34	EUR	4,700	4,723,978	0.55
Pluxee NV	3.75%	04/09/32	EUR	7,100	6,981,705	0.81
Prosus NV	1.29%	13/07/29	EUR	2,712	2,330,549	0.27
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	3,265	2,575,988	0.30
RELX Finance BV	3.38%	20/03/33	EUR	2,843	2,791,367	0.32
Sartorius Finance BV	4.25%	14/09/26	EUR	8,300	8,402,468	0.97
Siemens Financieringsmaatschappij NV	3.38%	22/02/37	EUR	3,700	3,612,626	0.42
Siemens Financieringsmaatschappij NV	3.63%	22/02/44	EUR	2,700	2,617,469	0.30
Stellantis NV	3.75%	19/03/36	EUR	2,420	2,340,059	0.27
Swisscom Finance BV	3.50%	29/11/31	EUR	3,383	3,391,480	0.39
Swisscom Finance BV	3.63%	29/11/36	EUR	4,433	4,397,539	0.51
TenneT Holding BV, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	6,094	6,078,360	0.70
Upjohn Finance BV	1.91%	23/06/32	EUR	10,369	8,692,176	1.00
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	2.50%	31/12/49†	EUR	3,600	3,374,043	0.39
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	4,900	4,359,173	0.50
Wintershall Dea Finance BV	1.33%	25/09/28	EUR	4,300	3,857,212	0.44
Wintershall Dea Finance BV	1.82%	25/09/31	EUR	1,500	1,262,766	0.15
					<u>83,919,372</u>	<u>9.69</u>
ノルウェー						
Var Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	4,290	4,661,971	0.54
ルーマニア						
Romanian Government International Bond	6.63%	17/02/28	USD	2,680	2,555,702	0.30

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
Romanian Government International Bond	5.88%	30/01/29	USD	4,470	4,145,717	0.48
Romanian Government International Bond	1.75%	13/07/30	EUR	4,128	3,372,934	0.39
Romanian Government International Bond	2.12%	16/07/31	EUR	3,623	2,921,064	0.34
Romanian Government International Bond	2.00%	28/01/32	EUR	2,300	1,798,265	0.21
Romanian Government International Bond	2.00%	14/04/33	EUR	5,186	3,896,080	0.45
Romanian Government International Bond	3.88%	29/10/35	EUR	1,075	907,933	0.10
Romanian Government International Bond	5.63%	22/02/36	EUR	3,639	3,553,828	0.41
Romanian Government International Bond	2.63%	02/12/40	EUR	11,525	7,513,060	0.87
Romanian Government International Bond	2.75%	14/04/41	EUR	6,419	4,167,404	0.48
Romanian Government International Bond	2.88%	13/04/42	EUR	8,291	5,397,024	0.62
Romanian Government International Bond	4.63%	03/04/49	EUR	3,360	2,768,727	0.32
Romanian Government International Bond	3.38%	28/01/50	EUR	2,408	1,603,138	0.18
					<u>44,600,876</u>	<u>5.15</u>
南アフリカ						
Republic of South Africa Government Bond	9.00%	31/01/40	ZAR	53,336	2,149,718	0.25
Republic of South Africa Government Bond	8.75%	31/01/44	ZAR	459,897	17,625,514	2.03
					<u>19,775,232</u>	<u>2.28</u>
スペイン						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	6.03%	13/03/35	USD	4,400	4,099,941	0.47
Banco de Sabadell SA, VRB	5.75%	31/12/49†	EUR	4,600	4,500,189	0.52
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	5,900	6,235,108	0.72
CaixaBank SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	2,800	2,917,118	0.34
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	2,800	2,744,932	0.32
Cepsa Finance SA	4.13%	11/04/31	EUR	4,600	4,509,681	0.52
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	5.25%	30/10/29	EUR	1,140	1,206,016	0.14
Iberdrola Finanzas SA, VRB	4.87%	31/12/49†	EUR	3,500	3,558,726	0.41
Werfen SA/Spain	4.25%	03/05/30	EUR	3,900	3,926,402	0.45
					<u>33,698,113</u>	<u>3.89</u>
スイス						
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	2,279	2,575,450	0.30
UBS Group AG, VRB	2.88%	02/04/32	EUR	10,109	9,454,237	1.09
					<u>12,029,687</u>	<u>1.39</u>
イギリス						
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	2,630	3,216,867	0.37
Barclays Plc, VRB	4.51%	31/01/33	EUR	4,060	4,138,171	0.48
Barclays Plc, VRB	5.26%	29/01/34	EUR	3,730	3,988,392	0.46
Barclays Plc, VRB	5.85%	21/03/35	GBP	3,180	3,747,331	0.43
Barclays Plc, VRB	4.35%	08/05/35	EUR	2,430	2,434,149	0.28
Barclays Plc, VRB	4.97%	31/05/36	EUR	2,010	2,019,677	0.23
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	4,068	4,676,565	0.54
Centrica Plc, VRB	6.50%	21/05/55	GBP	2,048	2,441,579	0.28
DS Smith Plc	4.50%	27/07/30	EUR	2,859	2,956,701	0.34
HSBC Holdings Plc, VRB	4.79%	10/03/32	EUR	2,800	2,935,030	0.34
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	5,640	5,952,657	0.69
HSBC Holdings Plc, VRB	4.60%	22/03/35	EUR	2,880	2,885,501	0.33

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
Motability Operations Group Plc	4.00%	17/01/30	EUR	2,980	3,017,118	0.35
Motability Operations Group Plc	3.88%	24/01/34	EUR	3,042	3,010,034	0.35
Motability Operations Group Plc	4.25%	17/06/35	EUR	4,822	4,883,497	0.57
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	965	1,072,264	0.12
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	4,213	5,336,138	0.62
					<u>58,711,671</u>	<u>6.78</u>
アメリカ						
AGCO Corp	5.80%	21/03/34	USD	2,990	2,780,803	0.32
AT&T Inc	4.30%	18/11/34	EUR	929	961,342	0.11
Bank of America Corp, FRB	4.70%	22/09/26	EUR	8,715	8,778,486	1.01
Becton Dickinson & Co	3.83%	07/06/32	EUR	2,932	2,947,562	0.34
DAE Funding LLC	1.55%	01/08/24	USD	7,915	7,355,156	0.85
Ford Motor Credit Co LLC	4.45%	14/02/30	EUR	3,432	3,458,218	0.40
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	5,849	6,043,514	0.70
Humana Inc	5.75%	15/04/54	USD	1,740	1,566,174	0.18
IWG US Finance LLC	6.50%	28/06/30	EUR	3,526	3,531,960	0.41
JPMorgan Chase & Co, VRB	3.76%	21/03/34	EUR	4,550	4,521,686	0.52
Medtronic Inc	4.15%	15/10/43	EUR	5,207	5,304,484	0.61
Medtronic Inc	4.15%	15/10/53	EUR	3,461	3,510,049	0.41
Morgan Stanley, VRB	3.96%	21/03/35	EUR	2,960	2,943,893	0.34
National Grid North America Inc	4.67%	12/09/33	EUR	6,146	6,389,257	0.74
Tapestry Inc	7.70%	27/11/30	USD	2,813	2,742,207	0.32
Tapestry Inc	7.85%	27/11/33	USD	2,600	2,554,387	0.29
Veralto Corp	4.15%	19/09/31	EUR	3,857	3,908,798	0.45
					<u>69,297,976</u>	<u>8.00</u>
債券合計					<u>671,992,533</u>	<u>77.61</u>
公的市場に上場している譲渡可能証券合計					<u>671,992,533</u>	<u>77.61</u>
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券						
債券						
カナダ						
Enbridge Inc, VRB	8.50%	15/01/84	USD	3,720	3,751,729	0.43
ケイマン諸島						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	2.13%	21/02/26	USD	11,097	9,738,032	1.12
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	4.25%	15/04/26	USD	4,651	4,216,542	0.49
					<u>13,954,574</u>	<u>1.61</u>
フランス						
Engie SA 144A	5.63%	10/04/34	USD	1,900	1,761,049	0.20
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	2,377	2,252,396	0.26
					<u>4,013,445</u>	<u>0.46</u>
ドイツ						
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	3,700	3,770,333	0.43
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	4,300	4,380,684	0.51
					<u>8,151,017</u>	<u>0.94</u>

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
アイルランド						
Smurfit Kappa Treasury ULC 144A	5.44%	03/04/34	USD	2,940	2,718,876	0.31
Smurfit Kappa Treasury ULC 144A	5.78%	03/04/54	USD	1,849	1,713,787	0.20
					<u>4,432,663</u>	<u>0.51</u>
イタリア						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	3,900	4,179,466	0.48
Intesa Sanpaolo SpA	5.63%	08/03/33	EUR	5,400	5,912,988	0.69
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	8.25%	21/11/33	USD	4,963	5,131,853	0.59
					<u>15,224,307</u>	<u>1.76</u>
日本						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	788	816,641	0.10
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.81%	17/09/30	USD	2,705	2,347,527	0.27
					<u>3,164,168</u>	<u>0.37</u>
ルクセンブルグ						
Bevco Lux Sarl	1.00%	16/01/30	EUR	2,032	1,731,815	0.20
オランダ						
MSD Netherlands Capital BV	3.50%	30/05/37	EUR	3,874	3,817,998	0.44
MSD Netherlands Capital BV	3.70%	30/05/44	EUR	3,631	3,550,179	0.41
MSD Netherlands Capital BV	3.75%	30/05/54	EUR	2,018	1,959,838	0.23
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	2,800	2,869,066	0.33
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	1,100	1,131,150	0.13
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	2,100	2,186,263	0.25
					<u>15,514,494</u>	<u>1.79</u>
ルーマニア						
Romanian Government International Bond	2.88%	26/05/28	EUR	1,256	1,184,320	0.14
Romanian Government International Bond	3.38%	08/02/38	EUR	1,591	1,216,410	0.14
					<u>2,400,730</u>	<u>0.28</u>
スペイン						
CaixaBank SA 144A, VRB	6.84%	13/09/34	USD	6,790	6,700,084	0.78
スイス						
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	1,950	2,196,242	0.25
アメリカ						
Bank of America Corp, VRB	5.47%	23/01/35	USD	4,100	3,822,813	0.44
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	6.55%	01/06/34	USD	3,480	3,254,437	0.38
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.50%	01/06/41	USD	3,270	2,053,371	0.24
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.85%	01/04/61	USD	3,291	1,801,356	0.21
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4.40%	01/12/61	USD	5,307	3,239,223	0.37
Comerica Inc, VRB	5.98%	30/01/30	USD	3,000	2,759,980	0.32
Foundry JV Holdco LLC 144A	6.25%	25/01/35	USD	5,760	5,501,279	0.64
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	3,570	3,283,488	0.38
Utah Acquisition Sub Inc	5.25%	15/06/46	USD	3,643	2,800,807	0.32

銘柄	利率	満期日	通貨	額面 (千)	市場価格 (ユーロ)	純資産に 占める割合 (%)
Viatis Inc	4.00%	22/06/50	USD	1,071	674,754	0.08
Warnermedia Holdings Inc	5.05%	15/03/42	USD	1,973	1,497,523	0.17
Warnermedia Holdings Inc	5.14%	15/03/52	USD	3,573	2,596,568	0.30
Warnermedia Holdings Inc	5.39%	15/03/62	USD	3,226	2,350,261	0.27
					<u>35,635,860</u>	<u>4.12</u>
債券合計					<u>116,871,128</u>	<u>13.50</u>
他の規制市場で取引されている譲渡可能証券合計					<u>116,871,128</u>	<u>13.50</u>
その他の有価証券						
請求権						
スイス						
Credit Suisse Group AG, FTB ^{±α}	9.75%	31/12/49 [†]	USD	3,540	<u>396,361</u>	<u>0.04</u>
請求権合計					<u>396,361</u>	<u>0.04</u>
その他の有価証券合計					<u>396,361</u>	<u>0.04</u>
投資有価証券合計					789,260,022	91.15
<i>(取得原価 EUR 809,898,837)</i>						
その他の資産(負債控除後)					<u>76,599,786</u>	<u>8.85</u>
純資産合計					<u>865,859,808</u>	<u>100.00</u>

用語

FTB - フラット・トレーディング債

FRB - 変動利付債

VRB - 変動金利債

± 債務不履行証券

† 無期限

^ 満期日は2115年3月15日

α 有価証券の価格は公正価値に基づく。

◎デリバティブ取引への投資

●外国為替先渡契約

外国為替先渡契約

購入通貨	購入通貨金額	売却通貨	売却通貨金額	満期日	未実現評価損益 (ユーロ)
EUR	71,121,338	MXN	(1,287,832,670)	17/07/24	5,606,612
USD	21,404,837	COP	(81,898,826,389)	17/07/24	1,586,946
USD	13,844,345	MXN	(231,641,686)	17/07/24	1,124,182
EUR	34,861,915	JPY	(5,843,042,260)	17/07/24	915,012
ZAR	327,841,530	USD	(17,540,000)	17/07/24	367,073
USD	32,198,222	EUR	(29,673,283)	17/07/24	347,893
MXN	203,707,308	USD	(10,863,467)	17/07/24	234,068
USD	8,490,000	KRW	(11,423,986,833)	17/07/24	181,635
USD	9,380,000	CLP	(8,718,025,225)	17/07/24	135,873
CNY	66,725,773	USD	(9,290,000)	17/07/24	56,868
MXN	52,740,266	EUR	(2,642,235)	17/07/24	40,772
USD	11,673,248	GBP	(9,205,596)	17/07/24	33,003
CLP	5,018,224,736	USD	(5,298,432)	17/07/24	15,807
USD	3,060,000	ZAR	(55,740,960)	17/07/24	10,107
COP	32,825,246,043	USD	(7,887,163)	17/07/24	9,110
CHF	8,402,730	EUR	(8,730,000)	17/07/24	4,737
GBP	650,563	EUR	(762,992)	17/07/24	3,851
未実現評価益合計					10,673,549
EUR	145,811,550	USD	(157,850,732)	17/07/24	(1,366,286)
BRL	114,266,702	USD	(21,815,744)	02/08/24	(1,230,059)
JPY	5,131,567,330	EUR	(31,005,312)	17/07/24	(1,191,934)
EUR	31,970,239	ZAR	(647,770,399)	17/07/24	(1,068,439)
MXN	298,877,176	USD	(17,246,533)	17/07/24	(875,926)
COP	37,184,202,755	USD	(9,661,158)	17/07/24	(667,187)
EUR	39,414,671	GBP	(33,919,371)	17/07/24	(567,331)
USD	14,940,000	ZAR	(280,974,939)	17/07/24	(400,908)
KRW	11,590,821,079	USD	(8,647,930)	17/07/24	(215,936)
IDR	114,248,582,348	USD	(7,140,000)	17/07/24	(145,545)
ZAR	231,552,680	EUR	(11,912,392)	17/07/24	(102,352)
USD	9,333,228	CNY	(67,311,426)	17/07/24	(93,087)
GBP	9,205,596	USD	(11,730,000)	17/07/24	(85,918)
MXN	61,032,000	EUR	(3,175,770)	17/07/24	(70,945)
EUR	8,700,000	CHF	(8,414,979)	17/07/24	(47,471)
GBP	9,690,556	EUR	(11,449,957)	17/07/24	(27,344)
USD	1,200,000	EUR	(1,119,141)	17/07/24	(278)
未実現評価損合計					(8,156,946)

ヘッジ付き投資証券クラス外国為替先渡契約

購入通貨	購入通貨金額	売却通貨	売却通貨金額	投資証券クラス	満期日	未実現評価損益 (ユーロ)
USD	80,286,981	EUR	(74,706,335)	I - USD	22/07/24	133,644
USD	12,305,906	EUR	(11,450,498)	S - USD	22/07/24	20,524
EUR	818,285	JPY	(138,606,420)	S - JPY	22/07/24	12,569
USD	4,599,352	EUR	(4,279,642)	C - USD	22/07/24	7,671
USD	3,409,707	EUR	(3,171,858)	M - USD	22/07/24	6,520
USD	3,884,851	EUR	(3,614,807)	R - USD	22/07/24	6,480
USD	3,300,094	EUR	(3,070,698)	B - USD	22/07/24	5,505
USD	2,291,739	EUR	(2,132,435)	I - USD (AIDiv)	22/07/24	3,822
USD	383,680	EUR	(357,009)	C - USD (AIDiv)	22/07/24	640
USD	180,551	EUR	(168,001)	X - USD	22/07/24	302
USD	168,204	EUR	(156,512)	R - USD (AIDiv)	22/07/24	280
EUR	10,456	CHF	(10,010)	I - CHF	22/07/24	47
NOK	2,424,048	EUR	(212,307)	I - NOK	22/07/24	24
EUR	7,464	USD	(7,997)	R - USD	22/07/24	10
EUR	2,061	USD	(2,204)	S - USD	22/07/24	7
JPY	9	EUR	—	S - JPY	22/07/24	0
未実現評価益合計						198,045
JPY	41,435,780,970	EUR	(244,957,246)	S - JPY	22/07/24	(4,091,955)
CHF	4,421,561	EUR	(4,660,110)	I - CHF	22/07/24	(62,090)
GBP	7,730,850	EUR	(9,137,684)	C - GBP	22/07/24	(27,015)
CHF	917,018	EUR	(966,379)	S - CHF	22/07/24	(12,764)
CHF	559,347	EUR	(589,456)	B - CHF	22/07/24	(7,787)
USD	1,579,624	EUR	(1,474,069)	I - USD	22/07/24	(1,614)
GBP	455,502	EUR	(538,384)	D - GBP (QIDiv)	22/07/24	(1,584)
GBP	422,907	EUR	(499,859)	C - GBP (AIDiv)	22/07/24	(1,471)
CHF	66,991	EUR	(70,597)	S - CHF (AIDiv)	22/07/24	(932)
GBP	145,194	EUR	(171,615)	X - GBP	22/07/24	(506)
CHF	32,055	EUR	(33,781)	Q - CHF	22/07/24	(447)
GBP	123,929	EUR	(146,479)	B - GBP	22/07/24	(431)
USD	40,691	EUR	(38,042)	S - USD	22/07/24	(111)
GBP	10,792	EUR	(12,756)	Q - GBP (AIDiv)	22/07/24	(37)
GBP	10,304	EUR	(12,179)	S - GBP (AIDiv)	22/07/24	(36)
GBP	5,933	EUR	(7,012)	S - GBP	22/07/24	(21)
USD	17,389	EUR	(16,229)	M - USD	22/07/24	(20)
USD	29,255	EUR	(27,287)	C - USD	22/07/24	(17)
USD	23,715	EUR	(22,120)	R - USD	22/07/24	(14)
USD	20,708	EUR	(19,315)	B - USD	22/07/24	(12)
USD	14,456	EUR	(13,484)	I - USD (AIDiv)	22/07/24	(8)
NOK	53,114	EUR	(4,659)	I - NOK	22/07/24	(7)
USD	2,440	EUR	(2,276)	C - USD (AIDiv)	22/07/24	(1)
未実現評価損合計						(4,208,880)

●先物契約

契約数	銘柄	満期日	通貨	コミットメント* (ユーロ)	未実現評価損益 (ユーロ)
1,112 (375)	US 2YR Note (CBT) September Futures 24 Euro-Oat September Futures 24	30/09/24 06/09/24	USD EUR	207,073,362 36,962,250	632,259 526,889
(208)	JPN 10Y Bond (Ose) September Futures 24	12/09/24	JPY	114,909,212	322,766
96	US 10YR Ultra September Futures 24	19/09/24	USD	8,682,995	98,670
41	US 10YR Note (CBT) September Futures 24	19/09/24	USD	3,882,304	37,060
未実現評価益合計					1,617,644
(1,708)	Euro-Bobl September Futures 24	06/09/24	EUR	167,454,028	(1,679,995)
(1,743)	Euro-Bund September Futures 24	06/09/24	EUR	175,419,006	(737,936)
(476)	US Ultra Bond (CBT) September Futures 24	19/09/24	USD	45,759,622	(621,093)
(302)	Euro-Buxl 30Y Bond September Futures 24	06/09/24	EUR	28,756,440	(564,200)
(269)	US Long Bond (CBT) September Futures 24	19/09/24	USD	25,432,485	(529,217)
(766)	Long Gilt September Futures 24	26/09/24	GBP	89,869,679	(293,317)
(301)	Euro-Schatz September Futures 24	06/09/24	EUR	30,102,107	(139,965)
(139)	US 5YR Note (CBT) September Futures 24	30/09/24	USD	12,958,297	(115,076)
未実現評価損合計					(4,680,799)

●金利スワップ契約

通貨	額面* (千)	満期日	サブファン드가 受け取る金利	固定金利 (%)	変動金利指標	未実現評価損益 (ユーロ)
USD	202,000	19/04/26	固定	4.88	USD-SOFR-OIS COMPOUND	708,578
未実現評価益合計						708,578
BRL	106,788	04/01/27	固定	9.81	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(688,158)
BRL	220,000	04/01/27	固定	10.96	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(559,067)
BRL	97,000	04/01/27	固定	10.42	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(413,669)
JPY	6,300,000	30/10/33	変動	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(348,603)
MXN	484,300	15/05/29	固定	9.28	MXIBTIIE 28 DAY	(263,572)
BRL	51,302	04/01/27	固定	10.20	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(257,597)
BRL	43,410	04/01/27	固定	10.03	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(244,822)
BRL	110,000	04/01/27	固定	11.11	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(229,131)
BRL	58,713	04/01/27	固定	10.71	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(194,911)
BRL	92,460	04/01/27	固定	11.24	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(157,721)
BRL	43,287	04/01/27	固定	10.73	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(140,161)
BRL	45,540	04/01/27	固定	11.16	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(88,352)
未実現評価損合計						(3,585,764)

●クレジット・デフォルト・スワップ契約

プロテクション・ ポジション	銘柄	利率 (%)	満期日	通貨	額面*	未実現評価損益 (ユーロ)
フランス 買い	Valeo SE	1.00	20/06/29	EUR	4,550,000	212,582
					未実現評価益合計	212,582
フランス 買い	WPP Finance SA	1.00	20/06/29	EUR	8,000,000	(107,048)
ドイツ 買い	Bertelsmann SE & Co KGaA	1.00	20/06/29	EUR	8,000,000	(245,713)
オランダ 買い	Stellantis NV	5.00	20/06/29	EUR	4,990,000	(885,413)
イギリス 買い	British Telecommunications Plc	1.00	20/06/29	EUR	8,600,000	(105,610)
買い	Marks & Spencer Plc	1.00	20/06/29	EUR	4,320,000	(14,324)
買い	Rentokil Initial Plc	1.00	20/06/29	EUR	8,750,000	(178,248)
						(298,182)
アメリカ 買い	Avnet Inc	1.00	20/06/28	USD	7,276,000	(96,043)
買い	Eastman Chemical Co	1.00	20/06/28	USD	17,710,000	(284,311)
						(380,354)
					未実現評価損合計	(1,916,710)

●クレジット・デフォルト・インデックス・スワップ契約

プロテクション・ ポジション	銘柄	利率 (%)	満期日	通貨	額面*	未実現評価損益 (ユーロ)
アメリカ 買い	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/06/29	USD	53,000,000	1,577,010
					未実現評価益合計	1,577,010
アメリカ 買い	CDX North America High Yield Index	5.00	20/06/29	USD	11,370,000	(664,274)
買い	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/29	USD	48,093,000	(924,343)
買い	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/29	USD	133,862,000	(2,572,816)
買い	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/29	USD	152,335,000	(2,927,865)
買い	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/29	USD	168,407,000	(3,236,768)
買い	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/06/29	EUR	28,367,000	(2,101,150)
買い	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/29	EUR	91,100,000	(1,620,928)
						(14,048,144)
					未実現評価損合計	(14,048,144)

* 潜在的なエクスポージャーに相当。

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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		騰 落 率	中 率			
	円		%	%	%	百万円
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
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。

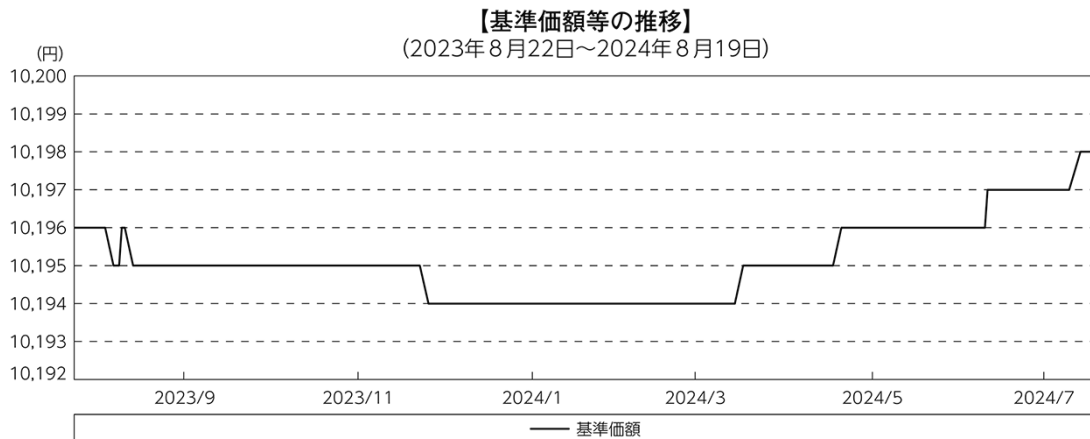
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰 落 率	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。

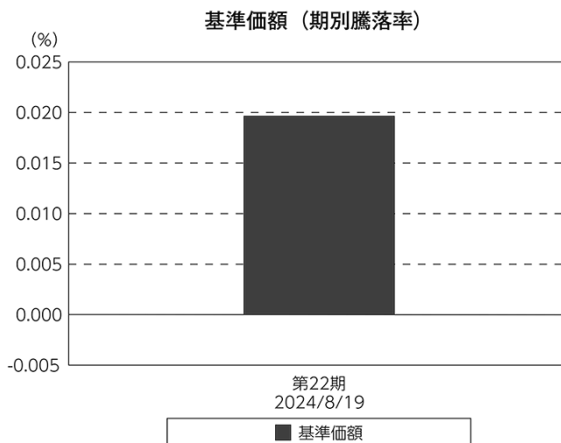
○当ファンドのポートフォリオ

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
国 内	国債証券	千円 217, 190, 000	千円 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B B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
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			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
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(道格機関投資家販売制限付)	1,110,121,107
ノムラ・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)2402(道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(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PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(中国元コース) 毎月分配型	982,607
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(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

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）のむらッパ・ファンド（普通型）	98,001
（年6%目標払出）のむらッパ・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
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
野村ブルーベイク・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

○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＞