

野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース（米ドル売り円買い）／Bコース（為替ヘッジなし）

野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース／野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース

運用報告書(全体版)

第4期（決算日2024年11月15日）

作成対象期間（2024年5月16日～2024年11月15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。

	Aコース	Bコース
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	2022年12月14日から2032年11月15日までです。	
運用方針	円建ての外国投資信託であるPIMCOバミューダ・トラストIV－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ）／（円ヘッジなし）－リテール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、PIMCOバミューダ・トラストIV－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ）／（円ヘッジなし）－リテールクラス受益証券への投資を中心としますが、各受益証券への投資比率には特に制限は設けず、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。	
	投資する円建ての外国投資信託において、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	
主な投資対象	野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース／Bコース	PIMCOバミューダ・トラストIV－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ）／（円ヘッジなし）－リテール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。
	PIMCOバミューダ・トラストIV－ PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・ フューチャーズ・ストラテジー・ファンド （円ヘッジ）／（円ヘッジなし）－リテールクラス	世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、世界各国（新興国を含みます。）の債券等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PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース／Bコース	株式への直接投資は行ないません。 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、原則として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/>

<Aコース>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 組 入 比 率	券 率	債 先 物 比 率	券 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 期 騰 落 中 率						
(設定日)	円		円	%	%		%		%	百万円
2022年12月14日	10,000		—	—	—		—		—	477
1 期(2023年5月15日)	9,509		0	△4.9	0.0		—		98.6	3,113
2 期(2023年11月15日)	8,870		0	△6.7	0.0		—		96.7	2,418
3 期(2024年5月15日)	8,996		0	1.4	0.0		—		98.7	1,295
4 期(2024年11月15日)	8,283		0	△7.9	0.0		—		98.8	739

*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 証 組 入 比 率
		騰 落 率	率			
(期 首)	円	%	%	%	%	%
2024年5月15日	8,996	—	0.0	—	98.7	
5月末	9,062	0.7	0.0	—	98.8	
6月末	8,745	△2.8	0.0	—	98.9	
7月末	8,666	△3.7	0.0	—	99.4	
8月末	8,320	△7.5	0.0	—	98.8	
9月末	8,432	△6.3	0.0	—	98.6	
10月末	8,091	△10.1	0.0	—	98.7	
(期 末)						
2024年11月15日	8,283	△7.9	0.0	—	98.8	

*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。

<Bコース>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 期 騰 落 中 率				
(設定日)	円		円	%	%	%	%	百万円
2022年12月14日	10,000	—	—	—	—	—	—	2,258
1期(2023年5月15日)	9,608		0	△3.9	0.0	—	98.5	6,375
2期(2023年11月15日)	10,250		10	6.8	0.0	—	97.8	6,048
3期(2024年5月15日)	11,058		10	8.0	0.0	—	98.9	5,730
4期(2024年11月15日)	10,426		10	△5.6	0.0	—	98.9	4,081

* 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

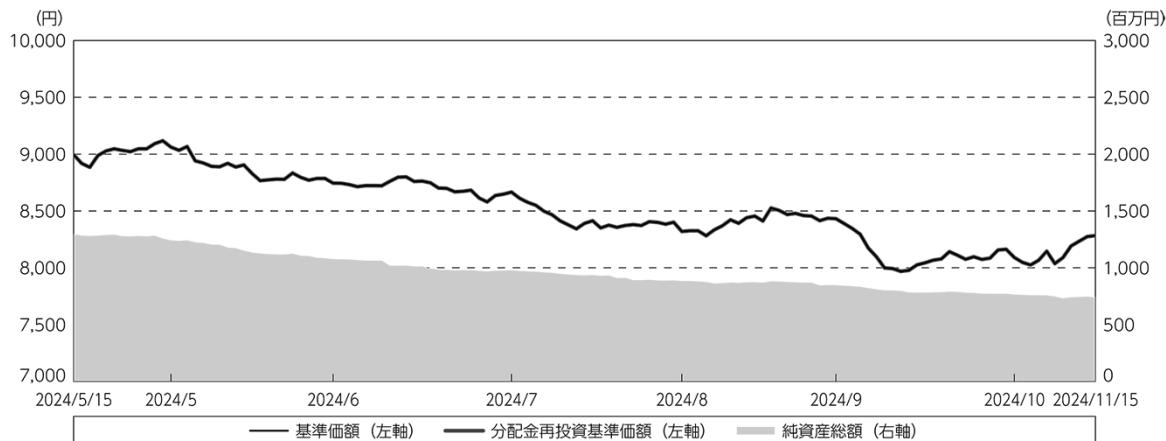
年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首)	円		%	%	%	%
2024年5月15日	11,058	—	—	0.0	—	98.9
5月末	11,184	1.1		0.0	—	98.7
6月末	11,115	0.5		0.0	—	98.4
7月末	10,655	△ 3.6		0.0	—	99.0
8月末	9,673	△12.5		0.0	—	99.2
9月末	9,676	△12.5		0.0	—	99.0
10月末	9,998	△ 9.6		0.0	—	98.7
(期 末)						
2024年11月15日	10,436	△ 5.6		0.0	—	98.9

* 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。

<Aコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：8,996円

期 末：8,283円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△ 7.9%（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。作成年首（2024年5月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

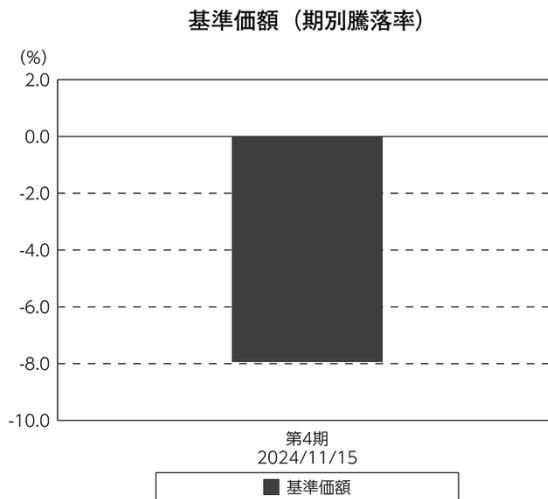
実質的に投資している世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）

<Aコース>

○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、基準価額の水準等を勘案し、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 4 期
	2024年 5 月 16 日～ 2024年 11 月 15 日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	— %
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	296

(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。

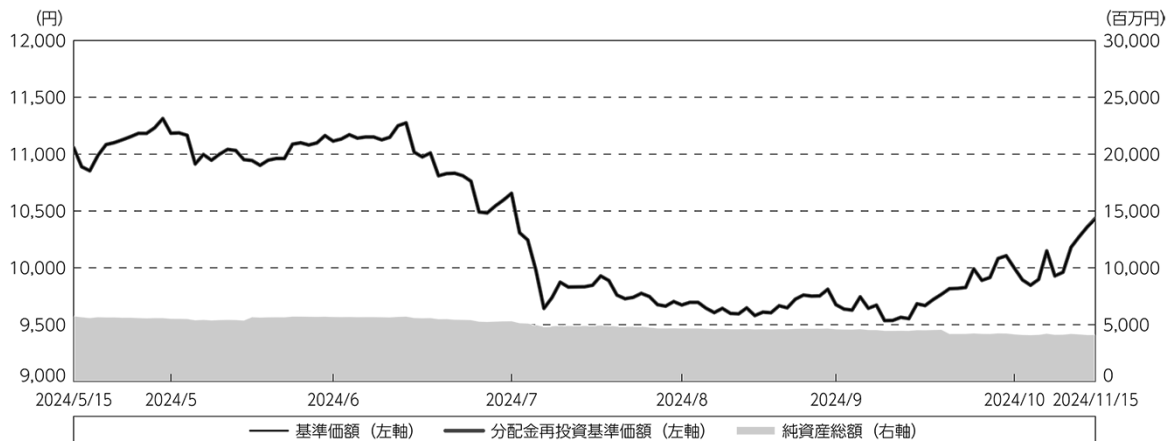
※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

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。

<Bコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：11,058円

期 末：10,426円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△ 5.6%（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。作成年首（2024年5月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

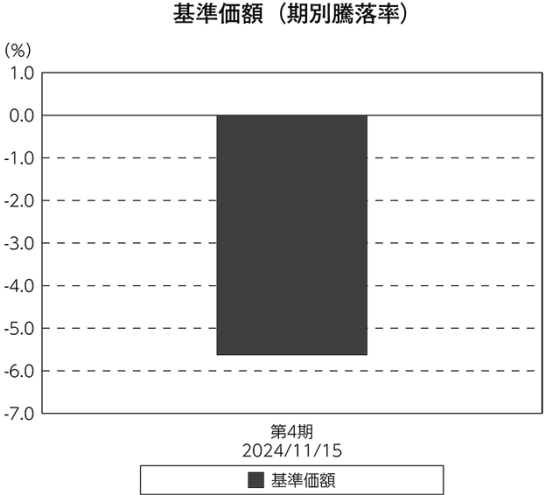
実質的に投資している世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）円／米ドルの為替変動

<Bコース>

○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、基準価額の水準等を勘案し、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 4 期
	2024年 5 月16日～ 2024年11月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.096%
当期の収益	10
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,207

(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。

※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。

<Aコース／Bコース>

○投資環境

【世界株式市場】

期初から2024年7月半ばにかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）のパウエル議長がインフレ率の鈍化が継続するとの見通しを示したことや、景気が緩やかに減速することへの期待が高まったことなどから、株式市場は概ね上昇基調で推移しました。その後、8月前半にかけて、7月の米ISM製造業景況指数が景気判断の節目となる50を4ヵ月連続で下回ったことや、7月の米失業率が4.3%と約3年ぶりの高水準となったことなどから景気悪化懸念が強まったことなどを背景に下落しました。その後は、7月の米小売売上高が市場予想を上回り景気悪化懸念が和らいだことや、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の0.5%引き下げが決定され、FRBが労働市場を下支えする姿勢を明確化したこと、9月の米雇用統計において非農業部門雇用者数が市場予想を上回り景気の底堅さが意識されたことなどを受けて、株式市場は概ね上昇基調で推移しました。

【世界債券市場】

期初から2024年7月にかけては、6月の米CPI（消費者物価指数）が市場予想を下回ったこと等を受け、米国での9月の利下げ開始への思惑が高まったことや、6月のPCE（個人消費支出）物価指数が市場予想と一致したことなどを背景に上昇基調で推移しました。8月には、7月の米雇用統計において非農業部門の雇用者数が市場予想を下回ったことで労働市場の軟化と景気の減速が意識され、FRBによる利下げ幅が想定よりも拡大するとの見方が強まったことなどから上昇しました。10月以降、9月の米ISM非製造業景況指数や米雇用統計における非農業部門の雇用者数が市場予想を上回ったことなどを背景に、下落基調で推移しました。

【為替市場】

期初から2024年6月にかけては、FRB高官の利下げに対する慎重な発言を受け、米国の利下げ観測が後退したことにより日米金利差が意識され、円安・ドル高となりました。7月から9月にかけては、7月の米雇用統計において、非農業部門の雇用者数が市場予想を下回ったことや、8月の米ISM製造業景況指数が市場予想を下回ったこと、7月の米JOLTS（雇用動態調査）における非農業部門の求人件数が低水準となったことで、9月のFOMCにおいてFRBが大幅な利下げを行なうとの期待が高まり、円高・ドル安基調で推移しました。10月以降は、9月の米雇用統計において非農業部門の雇用者数が市場予想を上回り、FRBによる大幅利下げ観測が後退したことなどを背景に、円安・ドル高基調で推移しました。

＜Aコース／Bコース＞

○当ファンドのポートフォリオ

【野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース】

〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）－リテールクラス〕 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〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）－リテールクラス〕 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

【PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）－リテールクラス】

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指して運用を行ないました。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

当作成期におけるファンドの騰落率はマイナスとなりました。共通ポートフォリオにおいて、資産別でファンドに対するマイナスの影響が大きかったのは、株式、通貨などとなりました。個別の寄与度では、FTSE中国A50指数やTOPIXのポジションなどが下位となりました。

【野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース】

〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジなし）－リテールクラス〕 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〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジなし）－リテールクラス〕 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

【PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジなし）－リテールクラス】

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指して運用を行ないました。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

＜Aコース／Bコース＞

当作成期におけるファンドの騰落率はマイナスとなりました。共通ポートフォリオにおいて、資産別でファンドに対するマイナスの影響が大きかったのは、株式、通貨などとなりました。個別の寄与度では、FTSE中国A50指数やTOPIXのポジションなどが下位となりました。

〔野村マネー マザーファンド〕

残存1年以内の公社債等の短期有価証券やコール・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。

◎今後の運用方針

〔野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース〕

〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）－リテールクラス〕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〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）－リテールクラス〕受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジ）－リテールクラス〕

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指します。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

また、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行ないます。

〔野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース〕

〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジなし）－リテールクラス〕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〔PIMCOバミューダ・トラストⅣ－PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジなし）－リテールクラス〕受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

<Aコース/Bコース>

[PIMCOバミューダ・トラストⅣーPIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー（円ヘッジなし）-リテールクラス]

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指します。

※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。

また、組入資産について、原則として対円で為替ヘッジを行ないません。

[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。

<Aコース>

○ 1 万口当たりの費用明細 (2024年 5 月16日～2024年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 44	% 0. 510	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(12)	(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)	(31)	(0. 360)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(1)	(0. 011)	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. 512	
期中の平均基準価額は、8, 552円です。			

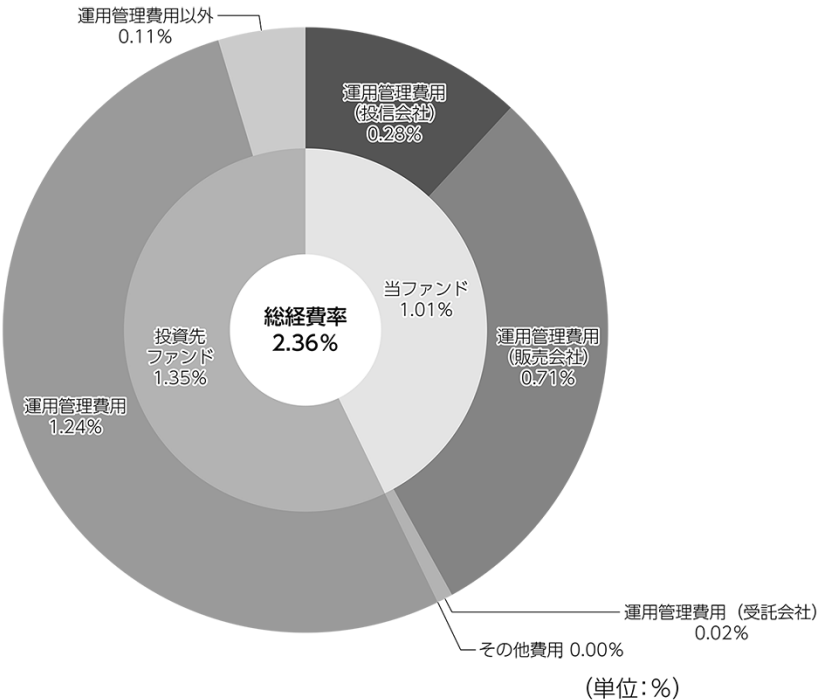
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
* 各比率は1 万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3 位未満は四捨五入してあります。

<Aコース>

(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2.36%です。



総経費率①+②+③)	2.36
①当ファンドの費用の比率	1.01
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.24
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11

(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。

<Aコース>

○売買及び取引の状況

(2024年5月16日～2024年11月15日)

投資信託証券

銘柄		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
国内	PIMCOバミューダ・トラストIV-PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・	口	千円	口	千円
	フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー (円ヘッジ) -リテールクラス	—	—	54,545	454,561

*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16日～2024年11月15日)

利害関係人との取引状況

<野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース>

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 210	百万円 130	% 61.9	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11月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
PIMCOバミューダ・トラストⅣ-PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・ フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー (円ヘッジ) -リテールクラス		口 145,923	口 91,378	千円 729,927	% 98.8
		合 計 145,923	91,378	729,927	98.8

*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。

<Aコース>

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 98	千口 98	千円 100

*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15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 729,927	% 96.9
野村マネー マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	23,488	3.1
投資信託財産総額	753,515	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

<Aコース>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	753,515,882
コール・ローン等	16,090,804
投資信託受益証券(評価額)	729,927,464
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,049
未収入金	7,397,460
未収利息	105
(B) 負債	14,398,671
未払解約金	9,462,927
未払信託報酬	4,919,762
その他未払費用	15,982
(C) 純資産総額(A－B)	739,117,211
元本	892,367,186
次期繰越損益金	△153,249,975
(D) 受益権総口数	892,367,186口
1万口当たり基準価額(C／D)	8,283円

(注) 期首元本額は1,439,867,789円、期中追加設定元本額は4,303,168円、期中一部解約元本額は551,803,771円、1口当たり純資産額は0.8283円です。

○損益の状況 (2024年 5月16日～2024年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	11,917,479
受取配当金	11,901,238
受取利息	16,241
(B) 有価証券売買損益	△ 70,458,578
売買益	21,871,787
売買損	△ 92,330,365
(C) 信託報酬等	△ 4,935,744
(D) 当期繰越損益金(A＋B＋C)	△ 63,476,843
(E) 前期繰越損益金	△ 80,970,922
(F) 追加信託差損益金	△ 8,802,210
(配当等相当額)	(1,059,599)
(売買損益相当額)	(△ 9,861,809)
(G) 計(D＋E＋F)	△153,249,975
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	△153,249,975
追加信託差損益金	△ 8,802,210
(配当等相当額)	(1,059,599)
(売買損益相当額)	(△ 9,861,809)
分配準備積立金	25,421,136
繰越損益金	△169,868,901

* 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 (2024年 5月16日～2024年11月15日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2024年 5月16日～ 2024年11月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	6,981,812円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,059,599円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	18,439,324円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	26,480,735円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	296円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

<Aコース>

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	0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>

<Bコース>

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年 5 月16日～2024年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 53	% 0. 510	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(14)	(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)	(37)	(0. 360)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(1)	(0. 011)	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	53	0. 512	
期中の平均基準価額は、10, 383円です。			

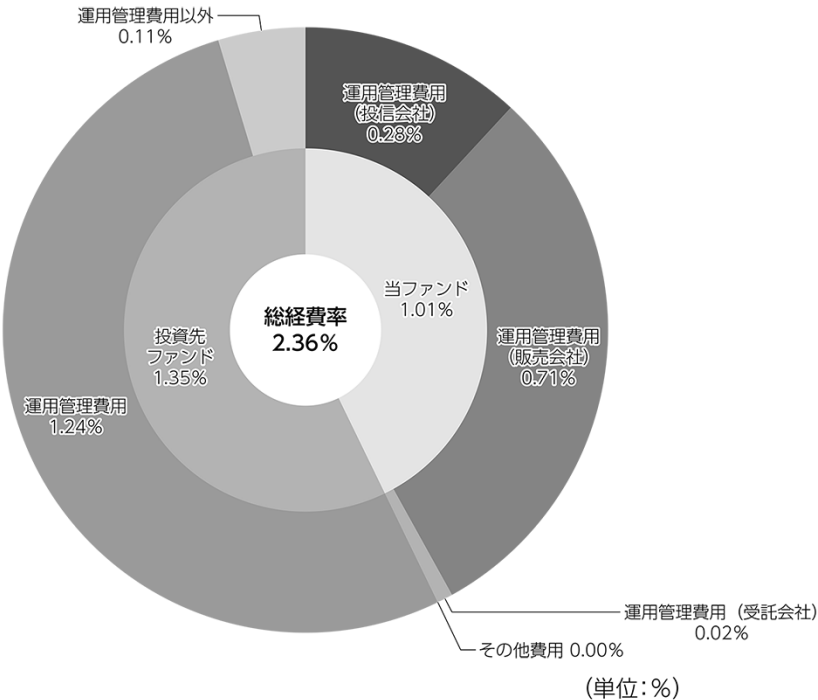
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
* 各比率は1 万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3 位未満は四捨五入してあります。

<Bコース>

(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2.36%です。



総経費率①+②+③)	2.36
①当ファンドの費用の比率	1.01
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.24
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11

(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。

<Bコース>

○売買及び取引の状況

(2024年5月16日～2024年11月15日)

投資信託証券

銘柄		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
国内	PIMCOバミューダ・トラストIVーPIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・	口	千円	口	千円
	フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー (円ヘッジなし) -リテールクラス				
		26,674	282,797	152,376	1,508,739

*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16日～2024年11月15日)

利害関係人との取引状況

<野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース>

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 210	百万円 130	% 61.9	百万円 ー	百万円 ー	% ー

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15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	柄	期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
PIMCOバミューダ・トラストIVーPIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・	フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー (円ヘッジなし) -リテールクラス	口	口	千円	%
		526,033	400,331	4,036,937	98.9
合	計	526,033	400,331	4,036,937	98.9

*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。

<Bコース>

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 98	千口 98	千円 100

*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15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 4,036,937	% 93.8
野村マネー マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	265,024	6.2
投資信託財産総額	4,302,061	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

<Bコース>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,302,061,258
コール・ローン等	239,528,917
投資信託受益証券(評価額)	4,036,937,804
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,049
未収入金	25,492,923
未収利息	1,565
(B) 負債	220,124,538
未払収益分配金	3,915,023
未払解約金	190,744,718
未払信託報酬	25,382,094
その他未払費用	82,703
(C) 純資産総額(A－B)	4,081,936,720
元本	3,915,023,726
次期繰越損益金	166,912,994
(D) 受益権総口数	3,915,023,726口
1万円当たり基準価額(C／D)	10,426円

(注) 期首元本額は5,181,889,678円、期中追加設定元本額は357,931,515円、期中一部解約元本額は1,624,797,467円、1口当たり純資産額は1.0426円です。

○損益の状況 (2024年5月16日～2024年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	52,259,906
受取配当金	52,180,946
受取利息	78,960
(B) 有価証券売買損益	△267,153,438
売買益	120,866,512
売買損	△388,019,950
(C) 信託報酬等	△25,464,797
(D) 当期繰越損益金(A＋B＋C)	△240,358,329
(E) 前期繰越損益金	396,526,326
(F) 追加信託差損益金	14,660,020
(配当等相当額)	(53,418,514)
(売買損益相当額)	(△38,758,494)
(G) 計(D＋E＋F)	170,828,017
(H) 収益分配金	△3,915,023
次期繰越損益金(G＋H)	166,912,994
追加信託差損益金	14,660,020
(配当等相当額)	(53,418,514)
(売買損益相当額)	(△38,758,494)
分配準備積立金	419,406,492
繰越損益金	△267,153,518

* 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(2024年5月16日～2024年11月15日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2024年5月16日～ 2024年11月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	26,795,189円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	53,418,514円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	396,526,326円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	476,740,029円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,217円
g. 分配金	3,915,023円
h. 分配金(1万円当たり)	10円

<Bコース>

○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>

PIMCOバミューダ・トラストⅣー
PIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドー
(円ヘッジ)ーリテールクラス／(円ヘッジなし)ーリテールクラス

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	英領バミューダ諸島籍円建外国投資信託
運 用 方 針	世界各国(新興国を含みます。)の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、投資顧問会社が独自に開発した定量モデルを用いたトレーディング戦略の活用によって絶対収益※の獲得を目指します。 ※絶対収益とは、特定の市場等の動きに対する超過収益ではなく、投資元本に対しての収益を意味します。また「絶対に収益が得られる」という意味ではありません。
投 資 対 象	世界各国(新興国を含みます。)の株式、債券、金利、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を主要取引対象とし、世界各国(新興国を含みます。)の債券等
管 理 会 社 投 資 顧 問 会 社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受 託 会 社	メイプルズ・トラスティ・サービシーズ(バミューダ)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・アンド・カンパニー
名 義 書 換 事 務 受 託 会 社	ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ)エス・シー・エー

* 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6月30日に終了した期間

(単位:千)		
収益:		
利息(外国税額控除後)*	\$	4,390
収益		3
収益合計		4,393
費用:		
投資顧問報酬 ― (日本円、為替ヘッジあり) ― 機関		335
投資顧問報酬 ― (日本円、為替ヘッジあり) ― 小売		186
投資顧問報酬 ― (日本円、為替ヘッジなし) ― 小売		509
管理費用 ― (日本円、為替ヘッジあり) ― 機関		58
支払利息		95
雑費用		0
費用合計		1,183
純投資損益		3,210
当期実現損益:		
投資有価証券(外国税額控除後)*		(1,053)
上場又は中央清算された金融デリバティブ商品		(845)
店頭金融デリバティブ商品		(6,105)
外貨通貨		82
当期実現損益		(7,921)
当期末実現評価損益:		
投資有価証券		614
上場又は中央清算された金融デリバティブ商品		(3,267)
店頭金融デリバティブ商品		(1,907)
外貨建資産および負債		(6)
当期末実現評価損益		(4,566)
当期実現および未実現評価損益		(12,487)
運用の結果による純資産の増減額	\$	(9,277)
* 外国税	\$	0

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

期末純資産総額		(単位:千)
(JPY-Hedged)-Retail	\$	8,477
(JPY-Unhedged)-Retail		34,739
期末現在発行済受益証券数		(単位:千)
(JPY-Hedged)-Retail		160
(JPY-Unhedged)-Retail		516
期末1口当たり純資産価格		
(JPY-Hedged)-Retail	\$	52.89
(JPY-Unhedged)-Retail		67.35

※PIMCOバミューダ・トラストⅣーPIMCOバミューダ・トレンド・マネージド・フューチャーズ・ストラテジー・ファンドの期末純資産額は64,768千米ドル。

組入資産の明細

(金額は千単位※、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)

2024年6月30日現在

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券101.6%			フランス3.2%		
カナダ10.1%			社債等3.2%		
資産担保証券1.3%			Banque Federative du Credit Mutuel S.A.		
Trillium Credit Card Trust II			5.410% due 05/24/2027	AUD 700	468
6.196% due 08/26/2028	\$ 800	\$ 804	BNP Paribas S.A.		
			3.375% due 01/09/2025	\$ 700	691
社債等3.2%			Credit Agricole S.A.		
Bank of Montreal			3.250% due 10/04/2024	600	596
5.674% due 07/09/2024	400	400	Electricite de France S.A.		
6.082% due 12/12/2024	100	100	3.625% due 10/13/2025	300	293
Federation des Caisses Desjardins du Quebec			フランス合計		2,048
2.050% due 02/10/2025	700	685	(取得原価\$2,048)		
National Bank of Canada			アイルランド0.9%		
5.853% due 08/06/2024	400	400	社債等0.9%		
Rogers Communications, Inc.			AerCap Ireland Capital DAC		
2.950% due 03/15/2025	500	490	3.500% due 01/15/2025	600	593
		2,075	アイルランド合計		593
			(取得原価\$593)		
ソブリン債5.6%			日本3.7%		
CPPIB Capital, Inc.			社債等3.7%		
6.621% due 03/11/2026	2,800	2,847	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.		
PSP Capital, Inc.			2.801% due 07/18/2024	300	299
5.611% due 03/03/2025	800	800	4.788% due 07/18/2025	500	500
		3,647	Nomura Holdings, Inc.		
カナダ合計		6,526	2.648% due 01/16/2025	700	688
(取得原価\$6,511)			Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
ケイマン諸島4.3%			6.655% due 07/13/2026	900	913
資産担保証券4.3%			日本合計		2,400
Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.			(取得原価\$2,399)		
6.513% due 08/15/2034	194	193	オランダ1.5%		
Barings CLO Ltd.			社債等1.5%		
6.806% due 01/20/2032	372	372	Enel Finance International NV		
Golub Capital Partners Static Ltd.			2.650% due 09/10/2024	500	497
6.557% due 04/20/2033	200	200	ING Groep NV		
LCM Loan Income Fund I Ltd.			7.016% due 03/28/2026	500	504
6.616% due 04/20/2031	278	278	オランダ合計		1,001
Madison Park Funding XXX Ltd.			(取得原価\$1,000)		
6.340% due 04/15/2029	662	663	シンガポール0.8%		
MF1 Ltd.			社債等0.8%		
6.526% due 10/16/2036	330	329	DBS Group Holdings Ltd.		
Nassau Ltd.			5.981% due 09/12/2025	500	502
6.840% due 01/15/2030	243	243	シンガポール合計		502
Neuberger Berman CLO XIV Ltd.			(取得原価\$500)		
6.616% due 01/28/2030	289	289	韓国0.6%		
Rad CLO 4 Ltd.			社債等0.6%		
0.000% due 04/25/2032	250	250	KT Corp.		
ケイマン諸島合計		2,817	4.000% due 08/08/2025	400	394
(取得原価\$2,794)			韓国合計		394
フィンランド0.8%			(取得原価\$394)		
社債等0.8%					
Nordea Bank Abp					
6.114% due 03/19/2027	500	502			
フィンランド合計		502			
(取得原価\$501)					

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
スペイン1.1%					
社債等1.1%					
Banco Santander S.A.			Honda Auto Receivables Owner Trust		
5.742% due 06/30/2024	700	700	5.710% due 03/18/2026	448	449
スペイン合計		700	Kubota Credit Owner Trust		
(取得原価\$700)			5.400% due 02/17/2026	164	163
			5.610% due 07/15/2026	633	633
			Navient Private Education Loan Trust		
			6.343% due 11/15/2068	205	204
			SoFi Consumer Loan Program Trust		
			5.810% due 05/15/2031	44	44
スウェーデン1.5%					
社債等1.5%					
Skandinaviska Enskilda Banken AB			Tesla Auto Lease Trust		
6.331% due 06/09/2025	500	502	5.370% due 06/22/2026	500	499
Svenska Handelsbanken AB			5.860% due 08/20/2025	353	353
6.031% due 05/28/2027	500	501	Toyota Auto Receivables Owner Trust		
スウェーデン合計		1,003	5.733% due 08/17/2026	282	282
(取得原価\$1,001)			5.903% due 08/15/2025	21	21
			World Omni Auto Receivables Trust		
			6.043% due 11/16/2026	183	183
					5,379
スイス1.1%					
社債等1.1%					
UBS AG			社債等28.1%		
4.750% due 08/09/2024	500	499	AES Corp.		
5.814% due 08/09/2024	200	200	3.300% due 07/15/2025	500	488
スイス合計		699	Ally Financial, Inc.		
(取得原価\$699)			5.125% due 09/30/2024	600	599
			American Honda Finance Corp.		
			5.914% due 02/12/2025	300	300
			6.139% due 04/23/2025	300	301
			American Tower Corp.		
			2.950% due 01/15/2025	200	197
			Amgen, Inc.		
			5.250% due 03/02/2025	500	499
			Arrow Electronics, Inc.		
			3.250% due 09/08/2024	700	696
			Bank of America Corp.		
			3.093% due 10/01/2025	600	596
			BAT Capital Corp.		
			3.222% due 08/15/2024	790	787
			Baxter International, Inc.		
			1.322% due 11/29/2024	700	687
			Bayer U.S. Finance LLC		
			3.375% due 10/08/2024	500	497
			Black Hills Corp.		
			1.037% due 08/23/2024	500	496
			Carrier Global Corp.		
			2.242% due 02/15/2025	700	685
			Dell International LLC		
			4.000% due 07/15/2024	700	700
			Dominion Energy, Inc.		
			3.071% due 08/15/2024	800	797
			DTE Energy Co.		
			4.220% due 11/01/2024	800	796
			Ford Motor Credit Co. LLC		
			4.389% due 01/08/2026	300	294
			4.687% due 06/09/2025	500	494
			General Motors Financial Co., Inc.		
			2.750% due 06/20/2025	517	503
			Georgia Power Co.		
			6.114% due 05/08/2025	200	201
			HCA, Inc.		
			5.375% due 02/01/2025	500	498
			Hyundai Capital America		
			1.000% due 09/17/2024	300	297
			6.250% due 11/03/2025	400	403
			JPMorgan Chase & Co.		
			5.546% due 12/15/2025	700	699
英国5.2%					
社債等5.2%					
Barclays PLC					
3.650% due 03/16/2025	600	591			
Haleon UK Capital PLC					
3.125% due 03/24/2025	700	687			
Imperial Brands Finance PLC					
3.125% due 07/26/2024	300	300			
Lloyds Banking Group PLC					
3.870% due 07/09/2025	700	700			
NatWest Markets PLC					
0.800% due 08/12/2024	500	497			
Standard Chartered PLC					
1.822% due 11/23/2025	600	590			
英国合計		3,365			
(取得原価\$3,357)					
米国50.2%					
資産担保証券8.3%					
Capital One Multi-Asset Execution Trust					
6.023% due 07/15/2027	200	200			
Carmax Auto Owner Trust					
5.933% due 11/16/2026	568	568			
CarMax Auto Owner Trust					
6.033% due 01/15/2026	65	65			
Citibank Credit Card Issuance Trust					
6.215% due 05/14/2029	800	810			
DLLAD LLC					
5.190% due 04/20/2026	156	155			
Ford Credit Auto Lease Trust					
5.923% due 02/15/2026	401	401			
GM Financial Automobile Leasing Trust					
5.883% due 06/20/2025	11	11			
GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust					
5.529% due 01/16/2025	14	14			
Harley-Davidson Motorcycle Trust					
5.320% due 06/15/2026	324	324			

	額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Morgan Stanley			Brown Brothers Harriman & Co.		
2.188% due 04/28/2026	500	486	(0.140%) due 07/01/2024	¥ 33	0
New York Life Global Funding			4.830% due 07/01/2024	\$ 6	6
5.936% due 01/16/2026	700	702	Citibank N.A.		
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			2.840% due 07/01/2024	EUR 2	2
6.051% due 03/01/2025	500	501	4.830% due 07/01/2024	\$ 1,099	1,099
Revvity, Inc.			DBS Bank Ltd.		
0.850% due 09/15/2024	500	494	3.930% due 07/02/2024	HKD 4	0
Southwest Airlines Co.			4.830% due 07/01/2024	\$ 176	176
5.250% due 05/04/2025	500	498	DnB Bank ASA		
Tyson Foods, Inc.			2.760% due 07/01/2024	SEK 600	57
3.950% due 08/15/2024	300	299	2.840% due 07/01/2024	EUR 2	3
VMware LLC			3.360% due 07/01/2024	AUD 14	9
1.000% due 08/15/2024	350	348	HSBC Bank		
Volkswagen Group of America Finance LLC			2.600% due 07/01/2024	SGD 68	50
6.302% due 09/12/2025	500	503	3.930% due 07/02/2024	HKD 137	18
Warnermedia Holdings, Inc.			HSBC Bank PLC		
3.638% due 03/15/2025	600	591	2.840% due 07/01/2024	EUR 70	75
Wells Fargo & Co.			4.400% due 07/01/2024	GBP 10	13
2.406% due 10/30/2025	800	791	JPMorgan Chase Bank N.A.		
Zimmer Biomet Holdings, Inc.			4.830% due 07/01/2024	\$ 201	201
1.450% due 11/22/2024	500	492	MUFG Bank Ltd.		
		18,215	(0.140%) due 07/01/2024	¥ 2,221	14
			Royal Bank of Canada		
			3.770% due 07/02/2024	CAD 20	15
			4.830% due 07/01/2024	\$ 44	44
米国政府機関13.8%			Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
Fannie Mae, TBA (a)			(0.140%) due 07/01/2024	¥ 312	2
5.000% due 08/01/2039	1,400	1,387	2.840% due 07/01/2024	EUR 2	2
6.000% due 08/01/2054	1,000	1,003	4.830% due 07/01/2024	\$ 156	156
6.500% due 08/01/2054	1,700	1,729	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
Freddie Mac			(0.140%) due 07/01/2024	¥ 10,980	68
5.375% due 04/24/2025	900	899	2.840% due 07/01/2024	EUR 16	17
Ginnie Mae			4.400% due 07/01/2024	GBP 22	28
6.283% due 10/20/2073	507	510	4.830% due 07/01/2024	\$ 154	154
Ginnie Mae, TBA					2,433
6.000% due 08/01/2054 (a)	3,400	3,412			
		8,940			
		32,534			
米国合計			米国財務省短期証券(b) 1.5%		
(取得原価\$32,522)			5.322% due 07/25/2024	500	498
			5.333% due 08/27/2024	500	496
					994
短期商品16.6%					
			短期商品合計		10,727
			(取得原価\$10,727)		
レボ取引11.3%		7,300	投資有価証券合計101.6%	\$	65,811
			(取得原価\$65,746)		
定期預金3.8%			金融デリバティブ商品(1.4%)		(907)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			(取得原価またはプレミアム\$(10))		
3.360% due 07/01/2024	AUD 50	34			
3.930% due 07/02/2024	HKD 9	1	その他の資産および負債(0.2%)		(136)
4.400% due 07/01/2024	GBP 2	3			
4.830% due 07/01/2024	\$ 87	87	純資産100.0%	\$	64,768
Bank of Nova Scotia					
3.770% due 07/02/2024	CAD 7	5			
4.830% due 07/01/2024	\$ 18	18			
BNP Paribas Bank					
(0.140%) due 07/01/2024	¥ 173	1			
0.320% due 07/01/2024	CHF 1	1			
2.600% due 07/01/2024	SGD 35	26			
3.360% due 07/01/2024	AUD 1	1			
3.380% due 07/01/2024	NOK 4	0			
3.930% due 07/02/2024	HKD 53	7			
6.330% due 07/01/2024	ZAR 734	40			

* 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

(a) クーポンは最終利回りである。

(b) クーポンは加重平均最終利回りである。

◎借入およびその他の金融取引

2024年6月30日現在

●レポ取引

						単位:千		
取引相手	貸付金利	決済日	満期日	元本	担保	受入担保 (公正価値)	レポ取引 (公正価値)	レポ取引に 係る未収金 ⁽¹⁾
U.S. Treasury Notes								
BPS	5.340%	06/28/2024	07/01/2024	\$ 7,300	0.625% due 07/31/2026	\$ (7,443)	\$ 7,300	\$ 7,303
レポ取引合計						\$ (7,443)	\$ 7,300	\$ 7,303

●売り建て

						単位:千	
取引相手	銘柄	クーポン	満期日	元本	受取金	売建有価証券に 係る未払金	
BOS	Fannie Mae, TBA	5.000%	07/01/2039	\$ 1,700	\$ (1,695)	\$ (1,685)	
売り建て合計(2.6%)						\$ (1,695)	\$ (1,685)

⁽¹⁾ 未収利息を含む。

◎上場金融デリバティブ商品

2024年6月30日現在

●先物契約

単位:千(契約数を除く)

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現 評価損益	変動証拠金	
					資産	負債
3-Month EURIBOR Interest Rate December Futures	Short	12/2025	11	\$ 0	\$ 1	\$ 0
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2026	18	(2)	0	0
3-Month Sonia December Futures	Short	03/2026	7	0	0	0
API2 Rotterdam Coal August Futures	Long	08/2024	2	(13)	0	(6)
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2024	16	(15)	9	0
CAC 40 10 Euro July Futures	Long	07/2024	4	(6)	0	(2)
CBOE Volatility Index July Futures	Short	07/2024	60	19	0	(16)
CBT Corn September Futures	Short	09/2024	15	20	11	0
CBT Soybean Meal December Futures	Short	12/2024	45	117	14	0
CBT Soybean November Futures	Short	11/2024	35	122	1	0
CBT Soybean Oil December Futures	Short	12/2024	64	21	0	(9)
CBT Wheat September Futures	Short	09/2024	17	(8)	5	0
CME Lean Hog October Futures	Short	10/2024	15	(1)	0	(6)
CME Live Cattle October Futures	Long	10/2024	9	3	0	(4)
Coffee Robusta September Futures	Long	09/2024	11	(6)	0	(4)
Copper September Futures	Long	09/2024	5	(48)	12	0
DAX Index September Futures	Long	09/2024	1	3	1	0
ECX Emission December Futures	Short	12/2024	14	(2)	0	(12)
Euro Stoxx Bank Index September Futures	Long	09/2024	92	6	0	(4)
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	Short	09/2024	3	4	1	0
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	Short	09/2024	3	2	1	0
FTSE 100 Index September Futures	Long	09/2024	8	0	0	(1)
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09/2024	5	4	0	(1)
Gasoline October Futures	Short	09/2024	7	(29)	5	0
Gold 100oz August Futures	Long	08/2024	2	(22)	1	0
Hang Seng Index July Futures	Long	07/2024	2	(2)	0	0
Hard Red Winter Wheat December Futures	Short	12/2024	19	9	8	0
HSCEI July Futures	Long	07/2024	9	(6)	1	0
IBEX 35 Index July Futures	Long	07/2024	8	(5)	0	(2)
ICE-ICE Cocoa September Futures	Long	09/2024	3	(39)	9	0
ICE-LIFFE White Sugar August Futures	Short	07/2024	12	(33)	0	(8)
ICE-LIFFE White Sugar October Futures	Short	09/2024	3	(4)	0	(2)
IFSC Nifty 50 Index July Futures	Long	07/2024	13	12	0	0
LME Lead August Futures	Short	08/2024	8	(14)	0	(11)
LME Lead October Futures	Short	10/2024	11	(2)	0	0
LME Primary Aluminum October Futures	Long	10/2024	22	4	0	0
LME Primary Nickel September Futures	Short	09/2024	5	(7)	0	0
LME Zinc October Futures	Short	10/2024	1	(2)	0	0
Low Sulphur Gas Oil September Futures	Short	09/2024	10	(22)	6	0
Milling Wheat September Futures	Long	09/2024	28	(38)	0	(4)
NASDAQ 100 E-mini September Futures	Long	09/2024	3	(2)	0	(7)
Nikkei 225 (SGX) September Futures	Long	09/2024	2	4	1	0
No.2 Cotton December Futures	Short	12/2024	45	53	43	0
NY Harbor ULSD October Futures	Short	09/2024	9	(34)	9	0
NYB-ICE Cocoa September Futures	Long	09/2024	3	13	14	0
NYB-ICE Coffee December Futures	Long	12/2024	18	(6)	2	0
NYM Natural Gas October Futures	Long	09/2024	10	(45)	0	(7)

単位:千(契約数を除く)

銘柄	種類	決済月	契約数	未実現 評価損益	変動証拠金	
					資産	負債
Nymex Palladium September Futures	Short	09/2024	12	(17)	0	(60)
OMXS 30 Index July Futures	Long	07/2024	72	(1)	8	0
Platinum October Futures	Long	10/2024	16	28	6	0
Red Spring Wheat September Futures	Short	09/2024	20	18	5	0
Russell 2000 Mini Index September Futures	Long	09/2024	4	1	1	0
S&P 500 E-mini Index September Futures	Long	09/2024	1	(1)	0	(1)
S&P/TSX 60 Index September Futures	Long	09/2024	3	6	0	(2)
SGX FTSE China A50 Index July Futures	Long	07/2024	74	(5)	0	(2)
SGX FTSE Taiwan Index July Futures	Long	07/2024	25	11	10	0
SGX MSCI Singapore July Futures	Long	07/2024	106	20	0	(9)
SGX TSI Iron Ore August Futures	Short	08/2024	119	(2)	0	(11)
Short Euro-BTP Note September Futures	Short	09/2024	59	(1)	1	0
Silver September Futures	Long	09/2024	2	(1)	3	0
SPI 200 Index September Futures	Long	09/2024	10	8	4	0
Sugar No.11 October Futures	Short	09/2024	60	(67)	0	(6)
Topix Index September Futures	Long	09/2024	7	13	7	0
TTF Natural Gas October Futures	Long	09/2024	15	(4)	0	(3)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2024	8	1	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2024	18	(4)	2	0
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	Short	09/2024	4	(1)	2	0
UK Natural Gas August Futures	Long	07/2024	15	(14)	0	(6)
VSTOXX Mini Index July Futures	Short	07/2024	53	(8)	2	0
WIG 20 Index September Futures	Long	09/2024	47	31	3	0
先物契約合計				\$ 14	\$ 209	\$ (206)

●スワップ契約

クレジットインデックスに係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの買い⁽¹⁾

単位:千

インデックス・トランシェ	支払 固定金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現 評価損益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.EM-41 Index	(1.000%)	06/20/2029	\$ 4,070	\$ 129	\$ (2)	\$ 0	\$ (1)

クレジットインデックスに係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽²⁾

単位:千

インデックス・トランシェ	受取 固定金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現 評価損益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.EM-40 Index	1.000%	12/20/2028	\$ 6,200	\$ (151)	\$ 74	\$ 1	\$ 0
CDX.HY-42 Index	5.000%	06/20/2029	1,800	115	(10)	0	(1)
				\$ (36)	\$ 64	\$ 1	\$ (1)

●金利スワップ

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
							資産	負債	
受取 ⁽⁵⁾	3-Month Australian Bank Bill	3.750%	09/18/2026	AUD	37,200	\$ 249	\$ 60	\$ 0	\$ (44)
受取 ⁽⁵⁾	3-Month HKD-HIBOR	3.500%	09/18/2029	HKD	22,300	31	(47)	0	(7)
支払 ⁽⁵⁾	3-Month HKD-HIBOR	3.750%	09/18/2029		41,700	3	21	12	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.260%	11/18/2027	ILS	6,300	30	32	1	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.638%	12/30/2027		7,500	8	8	1	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.485%	01/09/2028		19,600	108	102	3	0
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.845%	03/16/2028		7,300	(14)	(37)	0	(1)
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.590%	03/31/2028		6,000	(26)	(26)	0	(1)
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.490%	07/21/2028		7,400	13	(40)	1	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	4.385%	10/02/2028		14,300	(88)	(23)	2	0
支払	3-Month ILS-TELBOR	4.460%	10/02/2028		22,500	159	(48)	0	(4)
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.515%	11/22/2028		8,100	(36)	(36)	0	(1)
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.460%	11/23/2028		8,700	(44)	(44)	0	(1)
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.440%	11/24/2028		2,500	13	0	0	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.704%	01/29/2029		24,400	122	122	4	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.920%	03/20/2029		12,200	29	29	2	0
受取	3-Month ILS-TELBOR	3.930%	03/21/2029		6,100	14	14	1	0
支払	3-Month ILS-TELBOR	4.515%	04/22/2029		7,200	12	12	0	(1)
支払	3-Month ILS-TELBOR	4.430%	04/25/2029		7,200	5	5	0	(1)
支払	3-Month ILS-TELBOR	4.360%	05/02/2029		16,700	(3)	(3)	0	(3)
支払	3-Month ILS-TELBOR	4.370%	05/02/2029		10,700	0	0	0	(2)
支払 ⁽⁵⁾	3-Month THOR	2.250%	09/18/2029	THB	109,700	(28)	(34)	5	0
受取 ⁽⁵⁾	3-Month THOR	2.500%	09/18/2029		195,500	(13)	(32)	0	(8)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.055%	11/14/2027	ZAR	17,800	(3)	(7)	0	(2)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.900%	01/06/2028		15,100	(2)	(2)	2	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.730%	01/09/2028		54,600	(23)	(34)	6	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.705%	01/10/2028		18,400	(9)	(9)	2	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.700%	01/20/2028		54,500	(26)	(11)	6	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.205%	02/17/2028		52,000	(22)	(22)	0	(6)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.430%	02/23/2028		80,500	(66)	(66)	0	(10)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.120%	03/13/2028		23,700	(7)	(24)	0	(3)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.510%	04/25/2028		71,400	(69)	(69)	0	(9)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.350%	05/18/2028		46,000	(116)	(97)	0	(6)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.185%	06/12/2028		57,900	128	64	7	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.411%	07/19/2028		50,600	38	39	6	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.370%	07/20/2028		62,400	42	44	8	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.291%	07/27/2028		16,000	8	8	2	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.305%	07/27/2028		28,200	15	15	4	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.310%	07/27/2028		16,000	9	9	2	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.330%	07/27/2028		18,000	11	11	2	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.700%	08/22/2028		37,900	(50)	(50)	0	(5)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.550%	08/23/2028		45,100	(46)	(46)	0	(6)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.625%	08/23/2028		37,900	(44)	(44)	0	(5)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.220%	08/30/2028		36,500	13	13	5	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.220%	08/31/2028		40,100	(14)	(65)	0	(5)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.090%	09/28/2028		55,100	(113)	(88)	0	(7)
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.355%	11/03/2028		49,100	29	29	7	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.360%	11/06/2028		49,800	29	29	7	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.352%	11/09/2028		53,000	30	30	7	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	11/22/2028		29,100	(10)	(36)	0	(4)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.130%	01/25/2029		34,100	(1)	(1)	0	(5)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.645%	04/02/2029		33,700	(38)	(38)	0	(5)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.650%	04/02/2029		17,000	(19)	(19)	0	(2)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.670%	04/02/2029		33,800	(40)	(40)	0	(5)
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.649%	04/03/2029		24,200	(27)	(27)	0	(4)

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
							資産	負債	
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.820%	04/12/2029	39,500	60	21	6	0	
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.530%	05/16/2029	36,000	29	29	5	0	
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.510%	05/17/2029	54,200	41	41	8	0	
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.459%	05/22/2029	69,800	45	45	10	0	
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.276%	06/14/2029	37,200	7	(9)	6	0	
支払 ⁽⁵⁾	6-Month Australian Bank Bill	4.500%	09/18/2034	AUD 7,900	11	28	43	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.476%	01/12/2028	CZK 53,100	(22)	(100)	0	(4)	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	5.215%	02/24/2028	201,900	(360)	(382)	0	(12)	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.510%	03/22/2028	80,100	59	96	4	0	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	5.070%	04/20/2028	128,300	218	210	6	0	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.695%	05/04/2028	50,000	57	70	2	0	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.611%	06/06/2028	44,100	47	24	1	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.353%	08/16/2028	74,700	(108)	(128)	0	(5)	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.730%	10/03/2028	77,100	181	60	4	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.190%	11/09/2028	122,300	(165)	(143)	0	(5)	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.250%	04/18/2029	34,000	20	0	2	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	3.340%	01/06/2032	33,200	70	(104)	0	(2)	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.220%	03/21/2033	46,800	40	54	3	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.420%	06/01/2033	56,800	(93)	(83)	0	(2)	
支払	6-Month CZK-PRIBOR	4.455%	06/01/2033	18,700	32	(4)	1	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.638%	10/03/2033	1,100	(4)	(3)	0	0	
受取	6-Month CZK-PRIBOR	4.020%	11/22/2033	21,200	(25)	(29)	0	(1)	
受取 ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	3.000%	09/18/2026	EUR 100	0	0	0	0	
支払 ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	2.500%	09/18/2054	1,800	(2)	(27)	0	(3)	
受取 ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	2.750%	09/18/2034	4,600	19	38	5	0	
支払	6-Month HUF-BUBOR	7.140%	05/24/2027	HUF 404,400	24	1	1	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	9.900%	12/16/2027	358,900	(156)	(174)	0	(1)	
受取	6-Month HUF-BUBOR	10.700%	12/22/2027	240,800	(123)	(127)	0	0	
支払	6-Month HUF-BUBOR	11.140%	12/23/2027	479,400	265	113	1	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	8.550%	01/24/2028	960,500	(172)	(279)	0	(2)	
受取	6-Month HUF-BUBOR	9.510%	04/11/2028	421,400	(125)	(121)	0	(1)	
支払	6-Month HUF-BUBOR	8.712%	04/28/2028	1,768,000	393	39	3	0	
支払	6-Month HUF-BUBOR	8.740%	04/28/2028	1,492,600	335	277	2	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	7.740%	10/26/2028	1,037,000	(259)	(259)	0	(1)	
支払	6-Month HUF-BUBOR	7.770%	10/27/2028	797,000	203	91	1	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	6.065%	12/13/2028	866,100	(50)	(59)	0	(1)	
受取	6-Month HUF-BUBOR	6.550%	04/04/2029	366,900	(6)	(6)	0	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	6.530%	04/05/2029	299,100	(5)	(5)	0	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	6.587%	04/05/2029	513,900	(11)	(11)	0	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	6.560%	04/08/2029	499,200	(10)	(10)	0	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	7.100%	04/19/2029	477,400	(39)	(39)	0	0	
受取	6-Month HUF-BUBOR	7.000%	04/22/2029	524,700	(37)	(37)	0	0	
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.600%	12/16/2027	PLN 1,200	13	18	0	0	
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.120%	01/11/2028	4,700	(2)	4	0	(1)	
受取	6-Month PLN-WIBOR	5.430%	03/16/2028	7,800	(23)	(21)	3	0	
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.540%	06/01/2028	17,000	74	(1)	0	(6)	
支払	6-Month PLN-WIBOR	4.930%	06/29/2028	5,900	(5)	(5)	0	(2)	
支払	6-Month PLN-WIBOR	4.840%	08/22/2028	6,900	25	(24)	0	(2)	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.735%	10/09/2028	3,700	(10)	(2)	1	0	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.255%	12/27/2028	17,700	38	(68)	6	0	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.850%	02/15/2029	9,300	22	22	3	0	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.865%	02/16/2029	9,300	20	20	3	0	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.890%	02/16/2029	6,600	13	13	2	0	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.825%	03/13/2029	16,300	39	39	6	0	
受取	6-Month PLN-WIBOR	4.975%	03/29/2029	15,800	9	9	6	0	
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.360%	04/19/2029	4,000	14	14	0	(2)	
支払	6-Month PLN-WIBOR	5.265%	04/22/2029	25,200	66	20	0	(9)	

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金		
							資産	負債	
支払 ⁽⁵⁾	7-Day China Fixing Repo Rate	2.250%	09/18/2029	CNY	68,400	139	75	0	(2)
支払 ⁽⁵⁾	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	1.000%	09/18/2034	¥	696,500	(31)	(35)	4	0
受取 ⁽⁵⁾	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	1.500%	09/18/2054		324,800	107	16	0	(8)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.321%	01/04/2027	BRL	14,200	167	(42)	8	0
受取	BRL-CDI-Compounded	11.485%	01/04/2027		7,200	25	(40)	5	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.299%	01/04/2027		6,800	8	8	0	(5)
受取	BRL-CDI-Compounded	13.073%	01/04/2027		21,400	(107)	(107)	16	0
受取	BRL-CDI-Compounded	9.870%	01/02/2029		26,200	303	138	19	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.038%	01/02/2029		5,000	53	53	4	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.095%	01/02/2029		15,200	154	154	11	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.210%	01/02/2029		5,101	(49)	(49)	0	(4)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.234%	01/02/2029		10,300	97	97	8	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.276%	01/02/2029		4,800	51	48	4	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.317%	01/02/2029		2,500	25	21	2	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.562%	01/02/2029		12,200	109	109	9	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.567%	01/02/2029		8,500	(67)	(71)	0	(7)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.583%	01/02/2029		19,200	160	163	15	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.689%	01/02/2029		33,000	226	226	26	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.829%	01/02/2029		5,100	35	39	4	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.933%	01/02/2029		18,900	(111)	(111)	0	(15)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.963%	01/02/2029		14,900	82	82	12	0
受取	BRL-CDI-Compounded	11.060%	01/02/2029		2,000	11	7	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	11.113%	01/02/2029		12,100	(71)	(71)	0	(10)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.344%	01/02/2029		21,600	(99)	(99)	0	(18)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.695%	01/02/2029		12,200	(32)	(32)	0	(10)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.872%	01/02/2029		17,000	(28)	(28)	0	(14)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.975%	01/02/2029		5,300	(6)	(6)	0	(5)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.025%	01/02/2029		4,100	(2)	(2)	0	(3)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.094%	01/02/2029		25,100	(11)	(11)	0	(22)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.597%	01/02/2029		7,700	19	19	0	(7)
支払	BRL-CDI-Compounded	12.784%	01/02/2029		9,500	33	30	0	(9)
受取 ⁽⁵⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.500%	09/18/2026	CAD	11,400	46	4	0	(2)
受取 ⁽⁵⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	1.500%	09/18/2029	TWD	116,900	73	50	0	(1)
支払 ⁽⁵⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.000%	09/18/2029		3,200	(37)	(11)	0	(1)
支払 ⁽⁵⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.250%	09/18/2034		11,600	(108)	(78)	0	(26)
受取 ⁽⁵⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.000%	09/18/2054		3,000	135	39	18	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.260%	12/16/2027	COP	6,264,000	(90)	(80)	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.770%	01/31/2028		3,627,500	(39)	(28)	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.210%	02/10/2028		14,805,200	99	99	0	(2)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	10.200%	03/01/2028		12,907,400	(190)	(222)	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.050%	03/24/2028		6,886,000	43	43	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.600%	04/11/2028		8,197,300	14	14	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.106%	06/15/2028		5,462,000	(6)	(5)	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.730%	06/28/2028		148,700	1	0	0	0

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.960%	09/01/2028	5,183,200	13	13	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.943%	09/27/2028	4,214,900	(26)	(38)	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.220%	10/02/2028	5,080,500	38	(22)	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.370%	10/02/2028	15,940,000	(143)	(143)	2	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.260%	10/10/2028	1,610,000	(13)	(13)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.650%	10/11/2028	6,480,000	(76)	(76)	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.374%	10/12/2028	4,387,100	(41)	(44)	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.338%	11/09/2028	5,228,400	2	2	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.128%	11/10/2028	3,545,400	(5)	(5)	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.070%	11/14/2028	9,413,200	(18)	(18)	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.188%	11/15/2028	4,343,100	(4)	(4)	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.900%	12/15/2028	6,088,200	(17)	(17)	0	(1)
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.530%	01/02/2029	521,000	5	(1)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.520%	03/01/2029	9,130,000	60	32	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.950%	04/05/2029	2,925,100	11	11	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.885%	04/08/2029	4,299,400	19	19	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.927%	04/09/2029	2,193,900	9	9	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.120%	04/10/2029	1,706,300	4	4	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.080%	04/11/2029	3,590,900	9	9	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.150%	04/11/2029	2,879,400	5	5	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.435%	04/12/2029	5,964,900	(6)	(6)	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.567%	04/15/2029	4,063,800	(10)	(10)	1	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.449%	04/16/2029	4,591,500	(6)	(6)	1	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.914%	05/24/2029	6,438,200	(21)	(21)	0	(1)
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.035%	05/28/2029	3,267,100	(6)	(6)	0	0
支払 ⁽⁵⁾	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	09/18/2029	INR 367,600	(27)	(14)	1	0
受取 ⁽⁵⁾	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.500%	09/18/2029	288,710	(14)	(23)	0	(1)
支払	IBMEXID	8.445%	12/02/2027	MXN 4,900	(11)	(11)	1	0
受取	IBMEXID	9.215%	02/09/2028	47,900	46	52	0	(6)
受取	IBMEXID	9.135%	02/14/2028	24,000	25	16	0	(3)
支払	IBMEXID	8.438%	03/20/2028	64,300	(144)	(144)	8	0
受取	IBMEXID	8.700%	05/19/2028	49,000	87	109	0	(6)
支払	IBMEXID	8.207%	06/19/2028	8,400	(22)	(24)	1	0
受取	IBMEXID	8.620%	07/31/2028	44,700	89	89	0	(6)
受取	IBMEXID	8.890%	08/09/2028	17,800	26	23	0	(2)
支払	IBMEXID	9.890%	09/22/2028	19,000	9	(1)	3	0

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
支払	IBMEXID	9.238%	11/02/2028	30,400	(23)	(23)	4	0
支払	IBMEXID	10.023%	06/07/2029	11,100	11	11	2	0
支払	IBMEXID	9.885%	06/08/2029	10,800	8	8	1	0
支払	IBMEXID	8.250%	12/02/2032	17,200	(64)	(66)	3	0
受取	IBMEXID	8.800%	02/02/2033	23,100	47	44	0	(4)
受取	IBMEXID	8.755%	02/03/2033	32,200	70	37	0	(5)
支払	IBMEXID	8.374%	03/14/2033	35,300	(120)	(120)	6	0
支払	IBMEXID	8.281%	03/28/2033	16,300	(62)	(62)	3	0
受取	IBMEXID	8.340%	04/21/2033	15,900	56	54	0	(3)
支払	IBMEXID	8.055%	06/13/2033	25,800	(117)	(126)	4	0
受取	IBMEXID	8.500%	07/25/2033	61,800	190	190	0	(10)
受取	IBMEXID	8.990%	08/10/2033	29,300	40	55	0	(5)
支払	IBMEXID	9.765%	09/16/2033	14,500	18	6	2	0
支払	IBMEXID	9.135%	10/27/2033	18,600	(16)	(16)	3	0
支払	IBMEXID	8.470%	12/16/2033	7,000	(23)	(23)	1	0
支払	IBMEXID	8.540%	12/21/2033	27,900	(83)	(83)	5	0
受取	IBMEXID	8.782%	03/09/2034	16,800	37	37	0	(3)
受取	IBMEXID	8.955%	03/23/2034	15,100	23	23	0	(2)
支払	IBMEXID	9.981%	06/01/2034	8,100	17	17	1	0
支払	IBMEXID	10.180%	06/01/2034	3,000	9	9	1	0
支払 ⁽⁵⁾	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	3.250%	09/18/2029	KRW 7,791,700	34	1	9	0
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	09/18/2026	\$ 40,300	493	37	0	(1)
受取 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	09/18/2029	500	11	0	1	0
支払 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	09/18/2034	7,200	(97)	15	0	(27)
支払 ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	09/18/2054	600	(23)	(7)	0	(6)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.940%	02/17/2028	CLP 2,003,100	(41)	(41)	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.370%	03/03/2028	889,300	(34)	(34)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.380%	03/03/2028	942,700	(36)	(36)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.320%	03/07/2028	1,767,200	(64)	(64)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.385%	03/07/2028	1,496,100	(58)	(45)	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.830%	04/25/2028	6,711,700	130	71	0	(2)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.798%	05/31/2028	1,952,300	(38)	(38)	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.650%	06/01/2028	2,661,500	(37)	(37)	1	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.237%	06/14/2028	4,867,800	(9)	(9)	0	(3)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.158%	06/15/2028	1,278,000	(6)	(5)	0	(1)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.278%	07/07/2028	1,109,300	(9)	(15)	0	(1)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.455%	08/16/2028	1,990,300	(5)	(5)	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.540%	08/17/2028	1,537,300	(10)	(10)	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.550%	08/17/2028	1,537,300	(10)	(10)	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.490%	08/18/2028	883,300	(4)	(4)	0	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.590%	08/21/2028	1,762,300	(15)	(15)	1	0

単位:千

変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現 評価損益	変動証拠金	
							資産	負債
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.530%	08/22/2028	2,538,900	(15)	(11)	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.631%	08/23/2028	843,000	(9)	(9)	0	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.750%	09/28/2028	5,461,900	96	(74)	0	(2)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.899%	12/11/2028	2,810,200	(46)	(46)	0	(2)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.009%	12/12/2028	2,898,100	(33)	(33)	0	(2)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.649%	12/20/2028	1,998,400	53	20	2	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.439%	02/02/2029	3,069,000	(141)	(141)	0	(3)
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.810%	02/16/2029	3,159,500	87	87	3	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.965%	03/01/2029	5,890,400	113	114	4	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.000%	03/04/2029	1,114,700	19	19	1	0
受取	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.160%	04/05/2029	2,110,900	17	17	1	0
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.960%	05/10/2029	2,696,600	(43)	(43)	0	(2)
支払	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.870%	06/14/2029	892,600	(17)	(17)	0	(1)
受取 ⁽⁴⁾	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.280%	07/02/2029	2,198,300	(4)	(4)	0	(1)
支払 ⁽⁵⁾	Singapore Overnight Index Average	2.750%	09/18/2029	SGD 900	(7)	(2)	1	0
支払 ⁽⁵⁾	Singapore Overnight Index Average	3.000%	09/18/2029	5,500	8	15	9	0
受取 ⁽⁴⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.250%	09/18/2026	GBP 9,400	24	(24)	0	(2)
支払 ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.750%	09/18/2034	8,100	(81)	5	0	(24)
受取 ⁽⁴⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.750%	09/18/2054	1,600	60	(11)	14	0
受取	US CPI Urban Consumers NSA	0.000%	03/29/2033	\$ 2,300	(27)	(28)	0	(3)
支払	US CPI Urban Consumers NSA	0.000%	06/07/2033	600	5	2	1	0
支払	US CPI Urban Consumers NSA	0.000%	07/12/2033	1,700	3	3	2	0
受取	US CPI Urban Consumers NSA	0.000%	04/10/2034	300	1	(2)	0	0
スワップ契約合計							\$ 2,059	\$ (1,623)
							\$ 2,152	\$ (1,561)
							\$ 535	\$ (545)
							\$ 536	\$ (547)

- ⁽¹⁾ ファンドがプロテクションの買い手で、特定のスワップ契約の条件に定義された信用事由が発生した場合、ファンドは (i) プロテクションの売り手からスワップの想定元本相当額を受け取り参照債務もしくは参照インデックスを構成する原有価証券の引き渡しを行う、または (ii) スワップの想定元本相当額から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原有価証券の回収額を控除した決済純額相当額を現金もしくは有価証券で受け取る。
- ⁽²⁾ ファンドがプロテクションの売り手で、特定のスワップ契約の条件に定義された信用事由が発生した場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本相当額を支払い参照債務もしくは参照インデックスを構成する原有価証券の引き渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本相当額から参照債務もしくは参照インデックスを構成する原有価証券の回収額を控除した決済純額相当額を現金もしくは有価証券で支払う。
- ⁽³⁾ 当該特定のスワップ契約の条件に定義された信用事由が発生した場合、ファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払を要求されるまたはクレジット・プロテクションの買い手として受け取る可能性がある潜在的な最大金額。
- ⁽⁴⁾ 期末にスワップ契約の想定元本が決済/売却された場合、クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格および結果的価値は、支払い/履行リスクの現状の指標の役割を果たし、クレジット・デリバティブの予想債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本と比較した市場価格の絶対値での増加は、参照事業体の財務健全性の悪化を表し、債務不履行または契約の条件に定義されたその他の信用事由の発生の可能性またはリスクの増大を表す。
- ⁽⁵⁾ この金融商品の効力発生日は先日付である。

◎店頭金融デリバティブ商品

2024年6月30日現在

●外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益	
				資産	負債
BOA	07/2024	HKD 1,299	\$ 166	\$ 0	\$ 0
BOA	07/2024	KRW 1,691,665	1,236	7	0
BOA	07/2024	PLN 229	57	0	0
BOA	07/2024	SGD 13	10	0	0
BOA	07/2024	\$ 32	PLN 126	0	(1)
BOA	07/2024	27	ZAR 502	0	0
BOA	08/2024	TRY 1,586	\$ 46	0	0
BOA	08/2024	\$ 10	SGD 13	0	0
BOA	09/2024	COP 6,377,026	\$ 1,527	7	0
BOA	09/2024	\$ 400	HUF 148,477	2	0
BOA	09/2024	886	ZAR 16,070	0	(11)
BPS	07/2024	BRL 23,153	\$ 4,320	152	0
BPS	07/2024	CAD 7,812	5,708	0	(1)
BPS	07/2024	IDR 22,633,078	1,387	4	0
BPS	07/2024	JPY 3,890	24	0	0
BPS	07/2024	733,419	4,692	132	0
BPS	07/2024	PLN 2,146	529	0	(4)
BPS	07/2024	\$ 57	AUD 85	0	0
BPS	07/2024	4,165	BRL 23,153	3	0
BPS	07/2024	2,076	GBP 1,625	0	(22)
BPS	07/2024	190	JPY 30,499	0	0
BPS	07/2024	24	PLN 98	0	0
BPS	07/2024	1,514	SGD 2,054	1	0
BPS	07/2024	2	TWD 70	0	0
BPS	08/2024	AUD 64	\$ 43	0	0
BPS	08/2024	SGD 2,051	1,514	0	(1)
BPS	09/2024	BRL 3,237	600	22	0
BPS	09/2024	CLP 18,121	19	0	0
BPS	09/2024	CNH 27,303	3,792	29	0
BPS	09/2024	CZK 59,831	2,567	2	0
BPS	09/2024	EUR 1,500	1,614	0	0
BPS	09/2024	HUF 656,609	1,775	0	(2)
BPS	09/2024	IDR 14,886,117	900	0	(9)
BPS	09/2024	INR 68,161	814	0	(2)
BPS	09/2024	MXN 11,192	600	0	(5)
BPS	09/2024	12,572	702	23	0
BPS	09/2024	PLN 8,123	2,000	0	(19)
BPS	09/2024	SGD 2,299	1,700	0	(3)
BPS	09/2024	\$ 1,400	CHF 1,234	0	(14)
BPS	09/2024	763	CNH 5,462	0	(10)
BPS	09/2024	1,839	GBP 1,438	0	(21)
BPS	09/2024	500	JPY 76,717	0	(17)
BPS	09/2024	1,000	SEK 10,335	0	(20)
BPS	09/2024	ZAR 36,327	\$ 1,900	0	(77)
BPS	10/2024	\$ 639	CNH 4,573	0	(7)
BRC	07/2024	AUD 15	\$ 10	0	0

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益		
				資産	負債	
BRC	07/2024	KRW 2,448,835		1,770	0	(9)
BRC	07/2024	MYR 8,090		1,715	0	(1)
BRC	07/2024	RON 51		11	0	0
BRC	07/2024	THB 137		4	0	0
BRC	07/2024	\$ 60	HKD 472		0	0
BRC	07/2024	1,971	NOK 20,818		0	(16)
BRC	07/2024	2,072	PLN 8,260		0	(18)
BRC	07/2024	7	TRY 252		1	0
BRC	07/2024	5	153		0	0
BRC	08/2024	JPY 159,017	\$ 995		1	0
BRC	08/2024	\$ 14	AUD 21		0	0
BRC	09/2024	MXN 748	\$ 40		0	0
BRC	09/2024	\$ 1,674	CNH 12,051		0	(12)
BRC	09/2024	78	MXN 1,462		1	0
BRC	09/2024	1,052	NZD 1,700		0	(16)
BRC	11/2024	TRY 650	\$ 16		0	(1)
CBK	07/2024	BRL 18,114		3,259	0	(3)
CBK	07/2024	CAD 70		51	0	0
CBK	07/2024	EUR 537		576	0	0
CBK	07/2024	JPY 288,500		1,831	37	0
CBK	07/2024	PLN 317		80	1	0
CBK	07/2024	\$ 33	AUD 50		0	0
CBK	07/2024	3,323	BRL 18,114		0	(62)
CBK	07/2024	2,544	CAD 3,481		0	0
CBK	07/2024	478	COP 1,942,373		0	(11)
CBK	07/2024	2,339	EUR 2,178		0	(5)
CBK	07/2024	62	JPY 9,900		0	0
CBK	07/2024	298	SEK 3,167		1	0
CBK	07/2024	1,555	ZAR 28,477		2	0
CBK	08/2024	BRL 18,175	\$ 3,323		63	0
CBK	08/2024	CAD 3,466		2,535	0	0
CBK	09/2024	COP 2,037,250		500	15	0
CBK	09/2024	INR 32,318		386	0	(1)
CBK	09/2024	KRW 544,364		400	3	0
CBK	09/2024	PEN 7,178		1,900	26	0
CBK	09/2024	TWD 17,114		530	2	0
CBK	09/2024	\$ 600	BRL 3,336		0	(5)
CBK	09/2024	1,426	CLP 1,308,114		0	(41)
CBK	09/2024	2,515	INR 210,276		1	0
CBK	10/2024	CNH 54,204	\$ 7,587		96	0
FAR	07/2024	AUD 6,195		4,130	0	(8)
FAR	07/2024	EUR 2,961		3,225	52	0
FAR	07/2024	JPY 545,379		3,492	102	0
FAR	07/2024	NZD 5,100		3,110	3	0
FAR	07/2024	\$ 2,581	JPY 411,216		0	(24)
FAR	08/2024	JPY 409,286	\$ 2,581		24	0
FAR	08/2024	\$ 1,971	AUD 2,952		3	0
FAR	08/2024	3,110	NZD 5,100		0	(3)
FAR	09/2024	CLP 653,643	\$ 693		1	0
FAR	09/2024	\$ 50	PEN 186		0	(1)
JPM	07/2024	IDR 19,236,321	\$ 1,186		10	0

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨		受取通貨	未実現評価損益		
					資産	負債	
JPM	07/2024	JPY	116,376		725	1	0
JPM	07/2024	SGD	4,535		3,369	23	0
JPM	07/2024	TRY	164		5	0	0
JPM	07/2024		109		3	0	0
JPM	07/2024	\$	1,853	CHF	1,663	0	(2)
JPM	07/2024		72	EUR	67	0	0
JPM	07/2024		6	HUF	2,204	0	0
JPM	07/2024		4	ILS	13	0	0
JPM	07/2024		103	PLN	414	0	0
JPM	07/2024		10	SGD	13	0	0
JPM	07/2024		2,817	ZAR	51,859	19	0
JPM	08/2024	CHF	1,657	\$	1,853	2	0
JPM	08/2024	JPY	372,612		2,335	7	0
JPM	08/2024	TRY	92		3	0	0
JPM	09/2024	CLP	1,198,442		1,259	0	(10)
JPM	09/2024	CZK	771		33	0	0
JPM	09/2024	HUF	1,383,424		3,725	0	(19)
JPM	09/2024	MXN	12,503		698	23	0
JPM	09/2024	PHP	29,821		507	0	(2)
JPM	09/2024	\$	342	INR	28,682	1	0
JPM	09/2024		788	MXN	14,256	0	(18)
JPM	09/2024		814	ZAR	14,710	0	(13)
JPM	10/2024		198	CNH	1,420	0	(2)
MBC	07/2024	EUR	265	\$	288	4	0
MBC	07/2024	HUF	1,320,126		3,542	0	(38)
MBC	07/2024	NOK	16,194		1,520	0	(1)
MBC	07/2024	\$	424	CZK	9,770	0	(5)
MBC	07/2024		1,352	EUR	1,264	3	0
MBC	07/2024		6,278	HUF	2,326,233	31	0
MBC	07/2024		3,130	NZD	5,100	0	(22)
MBC	07/2024		17	PLN	69	0	0
MBC	08/2024	EUR	1,264	\$	1,354	0	(3)
MBC	08/2024	GBP	68		86	0	0
MBC	08/2024	\$	1,520	NOK	16,181	1	0
MBC	09/2024		3,585	CNH	25,862	0	(20)
MYI	07/2024	BRL	5,045	\$	908	0	(1)
MYI	07/2024	CHF	245		271	0	(1)
MYI	07/2024	NOK	4,624		434	0	(1)
MYI	07/2024	PLN	425		106	0	0
MYI	07/2024	SEK	13,043		1,235	3	0
MYI	07/2024	\$	977	BRL	5,045	0	(68)
MYI	07/2024		2,800	GBP	2,199	0	(20)
MYI	07/2024		105	PLN	424	0	0
MYI	07/2024		1,834	SGD	2,481	0	(3)
MYI	08/2024	CHF	1	\$	1	0	0
MYI	08/2024	JPY	212,285		1,326	0	0
MYI	08/2024	\$	434	NOK	4,621	1	0
MYI	08/2024		1,235	SEK	13,023	0	(3)
MYI	09/2024	INR	766	\$	9	0	0
MYI	09/2024	MXN	20,424		1,100	0	(3)
MYI	09/2024	TWD	12,986		405	4	0

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益	
				資産	負債
MYI	09/2024	\$ 300	CZK 6,813	0	(8)
MYI	09/2024	41	MXN 775	1	0
RBC	07/2024	GBP 2,560	\$ 3,246	10	0
RBC	07/2024	HKD 3,683	472	0	0
RBC	08/2024	\$ 3,247	GBP 2,560	0	(10)
RBC	08/2024	190	JPY 30,348	0	0
RYL	07/2024	4,068	AUD 6,096	3	0
RYL	07/2024	945	SEK 9,860	0	(14)
SCX	07/2024	KRW 649,172	\$ 476	5	0
SCX	07/2024	MXN 1	0	0	0
SCX	07/2024	\$ 3,196	CAD 4,381	6	0
SCX	07/2024	ZAR 41,116	\$ 2,231	0	(18)
SCX	08/2024	CAD 20	14	0	0
SCX	08/2024	JPY 373,267	2,335	3	0
SCX	09/2024	CNH 982	136	1	0
SCX	09/2024	PHP 124,836	2,128	0	(7)
SCX	09/2024	TWD 130,329	4,043	16	0
SCX	09/2024	\$ 1,553	INR 129,963	2	0
SOG	09/2024	BRL 1,066	\$ 200	10	0
SSB	07/2024	\$ 135	JPY 21,400	0	(2)
SSB	09/2024	CLP 964,892	\$ 1,029	7	0
SSB	09/2024	COP 6,451,955	1,573	35	0
TOR	07/2024	CHF 1,214	1,345	0	(7)
TOR	07/2024	HKD 1,116	143	0	0
TOR	08/2024	\$ 2,915	COP 11,690,884	0	(114)
TOR	09/2024	COP 3,342	\$ 1	0	0
UAG	07/2024	CHF 4,044	4,475	0	(25)
UAG	07/2024	THB 102,717	2,810	8	0
UAG	07/2024	\$ 4,344	CHF 3,839	0	(72)
UAG	07/2024	232	ILS 859	0	(4)
UAG	08/2024	1,599	GBP 1,264	0	(1)
				\$ 1,059	\$ (1,020)

●(JPY-Hedged)-Retailの外国為替先渡し契約

単位:千

取引相手	決済月	受渡通貨	受取通貨	未実現評価損益	
				資産	負債
BPS	07/2024	JPY 67,581	\$ 429	\$ 9	0
BPS	07/2024	\$ 10,879	JPY 1,700,758	0	(306)
BRC	07/2024	JPY 77,850	\$ 501	17	0
BRC	07/2024	\$ 46	JPY 7,265	0	(1)
CBK	07/2024	JPY 68,987	\$ 435	6	0
FAR	07/2024	1,582,043	9,929	94	0
FAR	07/2024	\$ 10,852	JPY 1,694,703	0	(317)
FAR	08/2024	9,929	1,574,620	0	(92)
MBC	07/2024	JPY 1,660,182	\$ 10,344	23	0
MBC	07/2024	\$ 10,103	JPY 1,580,627	0	(277)
MBC	08/2024	10,073	1,609,693	0	(18)
MYI	07/2024	JPY 29,235	\$ 187	5	0
RBC	07/2024	1,524,967	9,480	0	0
RBC	08/2024	\$ 9,480	JPY 1,517,782	1	0
SCX	07/2024	JPY 27,281	\$ 174	5	0
SCX	08/2024	\$ 726	JPY 116,016	0	(1)
SSB	07/2024	365	57,020	0	(11)
UAG	07/2024	JPY 2,734	\$ 18	1	0
外国為替先渡し契約合計				\$ 161	\$ (1,023)
				\$ 1,220	\$ (2,043)

●スワップ契約

金利スワップ

単位:千

取引相手	変動金利 支払/受取	変動金利指標	固定金利	満期	想定元本	支払/(受取) プレミアム	未実現 評価損益	スワップ契約(時価)	
								資産	負債
BOA	支払 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3.700%	09/18/2029	MYR 16,000	\$ (1)	\$ 10	\$ 9	\$ 0
BOA	受取 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	09/18/2029	35,900	14	(52)	0	(38)
BPS	支払 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	09/18/2029	31,300	(62)	19	0	(43)
BPS	受取 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	09/18/2029	25,400	86	(51)	35	0
BPS	支払 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3.700%	09/18/2029	9,200	3	2	5	0
MBC	支払	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	03/20/2029	9,400	(11)	1	0	(10)
MYC	支払 ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	09/18/2029	17,500	(39)	15	0	(24)
							\$ (10)	\$ (56)	\$ 49 \$ (115)

トータル・リターン・スワップ

単位:千											
取引相手	支払/ 受取 ⁽²⁾	参照債務	株式数または 受益証券口数	借入金利	支払い 頻度	想定元本	満期日	支払/(受取) プレミアム	未実現 評価損益	スワップ契約(時価) 資産 負債	
MEI	支払	BOVESPA Index	108	0.000%	Maturity	BRL	13,259	08/14/2024	\$ 0	\$ (51)	\$ 0 \$ (51)
MEI	受取	KOSPI2 Index	3,500,000	0.000%	Maturity	KRW	1,310,166	09/12/2024	0	31	31 0
MEI	支払	Thailand Equity Index	74,800	0.000%	Maturity	THB	60,440	09/27/2024	0	10	10 0
スワップ契約合計									\$ 0	\$ (10)	\$ 41 \$ (51)
									\$ (10)	\$ (66)	\$ 90 \$ (166)

⁽¹⁾ この金融商品の効力発生日は先日付である。

⁽²⁾ 受取は、ファンドが対象となる参照資産から生まれたプラスのネット・リターンに係る支払いを受けること意味する。ファンドは、当該対象となる参照資産から生まれたマイナスのネット・リターンに係る支払いを行なう。支払は、ファンドが対象となる参照資産から生まれたマイナスのネット・リターンに係る支払いを受けることを意味する。ファンドは、当該対象となる参照資産から生まれたプラスのネット・リターンに係る支払いを行なう。

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
		期 騰 落	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。

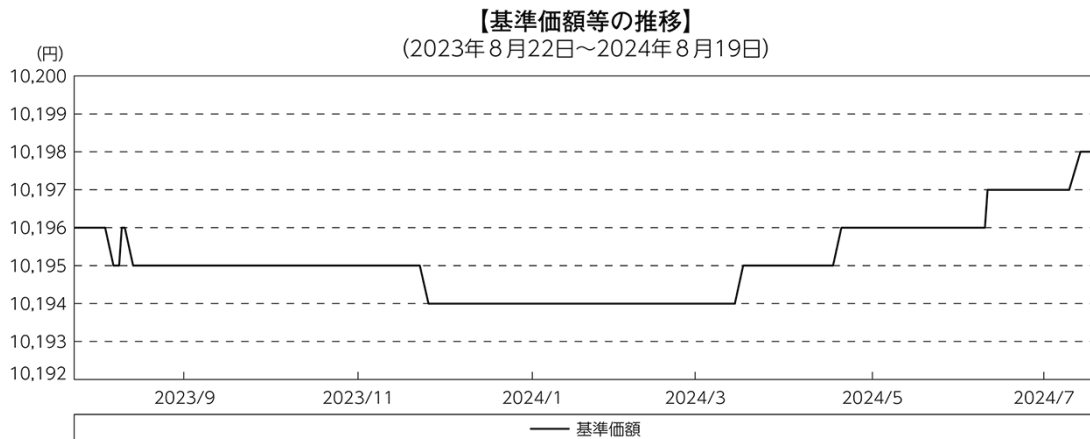
○当期中の基準価額と市況等の推移

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

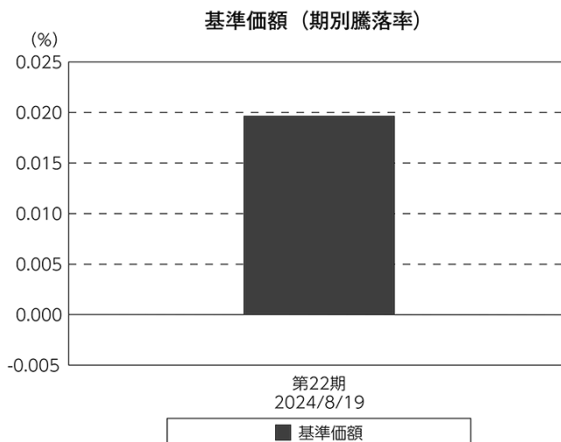
○当ファンドのポートフォリオ

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	うち利害関係人 との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
		$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$	
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) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261

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テンプレトトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプレトトン・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ム	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミアム	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＞