

平成 28 年 3 月 14 日

受益者の皆様へ

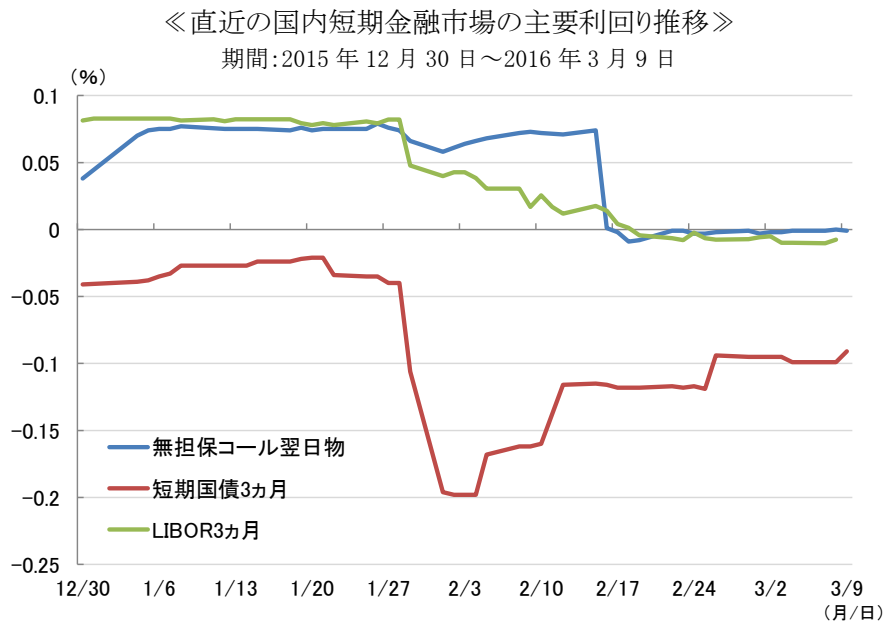
野村アセットマネジメント株式会社

「野村 MMF(マネー・マネージメント・ファンド)」の運用状況について

謹啓 時下益々ご清栄のこととお喜び申し上げます。また、平素は弊社の投資信託に格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。弊社運用の投資信託「野村 MMF(マネー・マネージメント・ファンド)」(以下、当ファンド)の直近の運用状況についてご報告いたします。

なお、2月8日以降、分配金再投資、投資信託積立による設定など、すでにお申込み済みの契約に基づくご購入を除いて、ご購入のお申込み受けを停止しております。

当ファンドが主な投資対象としている国内短期金融市場は1月 29 日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、3ヵ月物短期国債は利回りが大きく低下しました。続いて2月16日より金融機関が日本銀行に開設する当座預金の一部にマイナス金利が課せられると、コール翌日物の利回りも大きく低下しました。



(出所) ブルームバーグデータを基に野村アセットマネジメント作成

当ファンドは国債などの債券、CP(コマーシャル・ペーパー)、CP を対象とする現先取引を中心に投資を行っています。このうち、債券および CP が有価証券に該当し、ポートフォリオの 67.9%を占めています。ポートフォリオの平均残存日数は 23 日程度となっています(2016年2月末現在)。また、3月9日現在の過去7日間平均の分配金利回り(課税前・年率換算)は 0.016%となっています。

◆ポートフォリオの状況

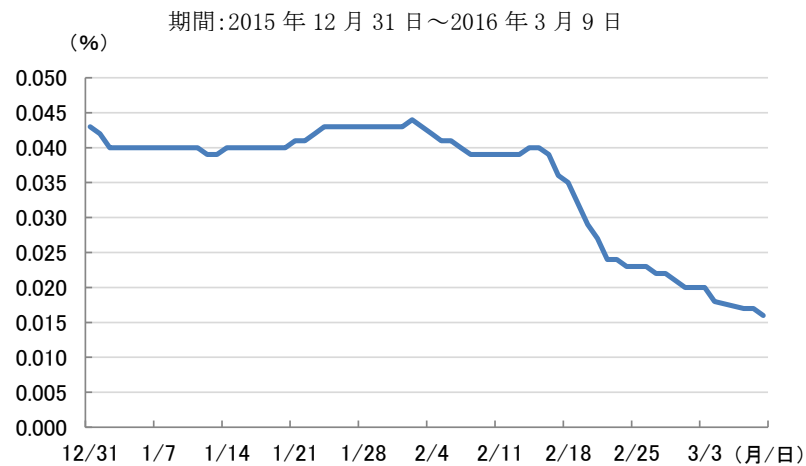
2016年2月末現在

種別	投資比率	平均残存日数
債券	21.0%	46日
1年以内の債券	21.0%	46日
短期金融資産	79.0%	17日
CP	46.9%	28日
その他の資産(指定金銭信託・預金・未収金・未払金等)	32.1%	-
合計	100.0%	23日
純資産総額	4,604.3億円	

・組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

・ポートフォリオの平均残存日数は、その他の資産を含む短期金融資産と債券の加重平均として表しております。

《過去7日間平均の分配金利回り(課税前・年率換算)の推移》



運用環境は厳しさを増していますが、今後も運用方針に沿って元本の安全性に配慮した運用を継続して参ります。なお、国内短期金融市場の状況を鑑み、運用方針に沿った運用の継続が困難と判断される場合には、あらためてお知らせいたします。

大変ご迷惑をおかけしておりますが、皆様のご信頼にお応えできますよう引き続き努力して参る所存でございます。何卒ご理解を賜りますよう、宜しくお願い申し上げます。

謹白