

# 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース（為替ヘッジあり）/Bコース（為替ヘッジなし）

## 運用報告書(全体版)

第4期（決算日2022年10月11日）

作成対象期間（2022年4月12日～2022年10月11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/株式	
信託期間	2020年10月26日から2030年10月11日までです。	
運用方針	外国投資法人であるBNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY（分配なし）/I Plus JPY（分配なし）の円建ての外国投資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、BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY（分配なし）/I Plus JPY（分配なし）の円建ての外国投資証券への投資を中心としますが、各証券への投資比率には特に制限は設けず、各証券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。	
	投資する外国投資法人において、組入外貨建資産について原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	投資する外国投資法人において、組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース/Bコース	外国投資法人であるBNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY（分配なし）/I Plus JPY（分配なし）の円建ての外国投資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ます。なお、コマース・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。
	BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY（分配なし）/I Plus JPY（分配なし）	新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース/Bコース 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。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 株式への投資は行いません。
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いません。	

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104  
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## &lt;Aコース&gt;

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		債権組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産総額
		税金込み騰落率	み期騰落率				
(設定日) 2020年10月26日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	百万円 16,704
1期(2021年4月12日)	11,977	10	19.9	0.0	—	98.5	76,850
2期(2021年10月11日)	12,304	10	2.8	0.0	—	98.8	86,318
3期(2022年4月11日)	11,443	10	△6.9	0.0	—	98.8	79,856
4期(2022年10月11日)	9,520	0	△16.8	0.0	—	98.7	61,762

\*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	標準価額		債権組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産総額
		騰落率	騰落率				
(期首) 2022年4月11日	円 11,443	% —	% —	% 0.0	% —	% 98.8	% 98.8
4月末	10,902	△4.7	0.0	—	98.8	98.8	
5月末	10,982	△4.0	0.0	—	99.0	99.0	
6月末	9,880	△13.7	0.0	—	99.0	99.0	
7月末	10,905	△4.7	0.0	—	99.1	99.1	
8月末	10,388	△9.2	0.0	—	99.3	99.3	
9月末	9,452	△17.4	0.0	—	98.7	98.7	
(期末) 2022年10月11日	9,520	△16.8	0.0	—	98.7	98.7	

\*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。

## &lt;Bコース&gt;

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産額
		税金	み				
(設定日)	円	円	%	%	%	%	百万円
2020年10月26日	10,000	—	—	—	—	—	17,065
1期(2021年4月12日)	12,582	10	25.9	0.0	—	98.4	77,452
2期(2021年10月11日)	13,120	10	4.4	0.0	—	98.8	97,228
3期(2022年4月11日)	13,220	10	0.8	0.0	—	98.7	104,651
4期(2022年10月11日)	12,400	10	△6.1	0.0	—	98.8	91,425

\*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	騰落率		債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産額
		税金	み				
(期首)	円	円	%	%	%	%	
2022年4月11日	13,220	—	—	0.0	—	98.7	
4月末	12,832	△2.9		0.0	—	98.8	
5月末	12,989	△1.7		0.0	—	99.0	
6月末	12,362	△6.5		0.0	—	98.9	
7月末	13,347	1.0		0.0	—	98.9	
8月末	13,070	△1.1		0.0	—	99.2	
9月末	12,242	△7.4		0.0	—	98.7	
(期末)							
2022年10月11日	12,410	△6.1		0.0	—	98.8	

\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

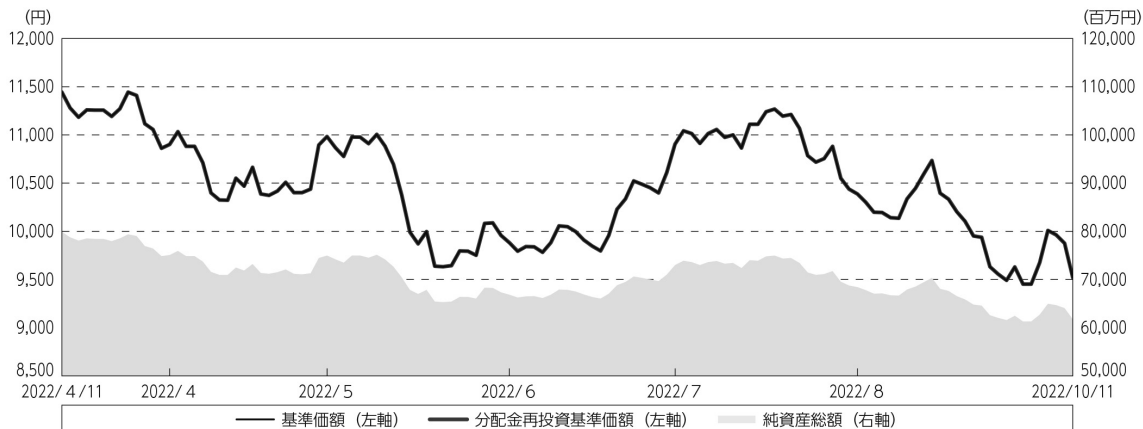
\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

\*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：11,443円

期末：9,520円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△16.8%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2022年4月11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

基準価額は、期首の11,443円から期末には9,520円となりました。

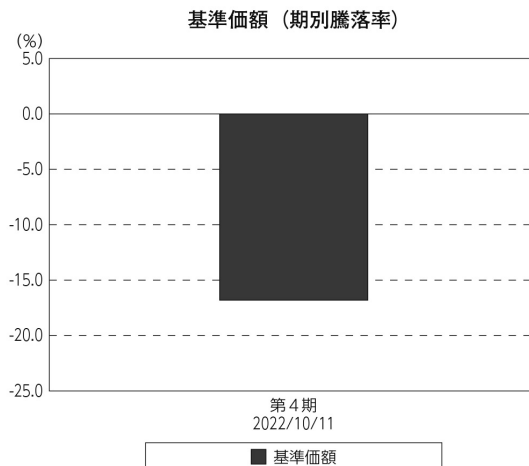
- ・ 実質的に投資している世界株式からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 実質的に投資している世界株式からのインカムゲイン
- ・ 為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）

## <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

基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。なお、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いません。

### ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第4期
	2022年4月12日～ 2022年10月11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	1,641

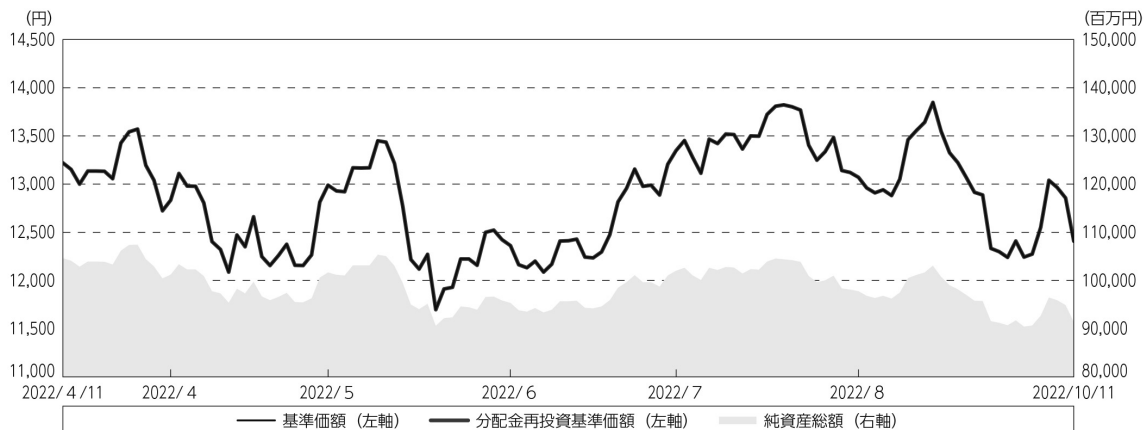
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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。

## &lt;Bコース&gt;

## ◎運用経過

## ○期中の基準価額等の推移



期首：13,220円

期末：12,400円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△6.1%（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（2022年4月11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

基準価額は、期首の13,220円から期末には12,400円となりました。

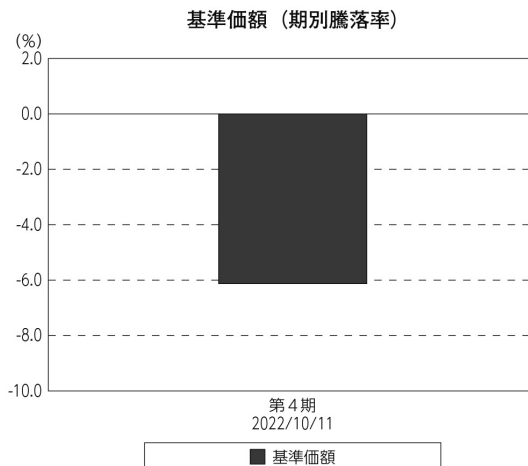
- ・実質的に投資している世界株式からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・実質的に投資している世界株式からのインカムゲイン
- ・円／投資先通貨の為替変動

## <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

収益分配については、分配原資の範囲内で、基準価額水準等を勘案して、1万口当たり10円といたしました。

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いません。

### ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第4期
	2022年4月12日～ 2022年10月11日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.081%
当期の収益	—
当期の収益以外	10
翌期繰越分配対象額	2,400

(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。

## <Aコース/Bコース>

### ○投資環境

世界株式市場は期初からロシアによるウクライナへの軍事侵攻や、CPI（消費者物価指数）の上昇を受けてインフレによる景気後退が懸念されたこと、各国の中央銀行が金融引き締めを強化するとの警戒感が高まったことなどから、2022年6月中旬にかけて値動きの荒い展開となりました。しかし、4－6月期の企業決算がはじまりインフレの企業業績への悪影響が懸念されていたものの、市場予想を上回る好決算が相次いだことや、7月の米国CPI上昇率が6月と比較して減速したことで、FRB（米連邦準備制度理事会）が金融引き締めペースを緩めるとの期待感が高まり、上昇基調に転じました。期末にかけてはインフレが抑制されるまで利上げを継続するという米金融当局の姿勢が改めて示されたことから下落に転じ、当期間では下落となりました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

#### [野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース]

[BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY(分配なし)] 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 [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY(分配なし)] 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

#### [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY(分配なし)]

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないました。

投資対象とする環境関連企業には、再生可能エネルギー／代替エネルギー、エネルギー効率、水インフラ／水テクノロジー、汚染防止、廃棄物管理／テクノロジー、環境サポートサービス、持続可能な食品関連企業などが含まれますが、これらのテーマに限定されることなく、環境関連企業に幅広く投資を行ないました。

期中には、クラウン・ホールディングスを新規に組み入れました。世界的に脱プラスチックへの取り組みが進んでおり、環境に配慮した包装への需要が高まるなか、リサイクル効率の高いアルミニウムの包装を提供する同社および同社製品への注目が高まること、および循環経済への移行から恩恵を受けることを期待しています。

一方で、SAPを全売却しました。世界有数のソフトウェアメーカーであり、電気・公営事業、産業用機械、石油・ガス・エネルギー、自動車など様々な産業へ脱炭素化の促進に貢献するソリューションを提供していますが、自社のクラウドコンピューティングへの移行が思うように進まず、長期的な成長見通しが相対的に弱まったことなどから全売却しました。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りました。



## <Aコース/Bコース>

### [野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース]

[BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus JPY(分配なし)] 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[BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus JPY(分配なし)] 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

### [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus JPY(分配なし)]

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないました。

投資対象とする環境関連企業には、再生可能エネルギー／代替エネルギー、エネルギー効率、水インフラ／水テクノロジー、汚染防止、廃棄物管理／テクノロジー、環境サポートサービス、持続可能な食品関連企業などが含まれますが、これらのテーマに限定されることなく、環境関連企業に幅広く投資を行ないました。

期中には、クラウン・ホールディングスを新規に組み入れました。世界的に脱プラスチックへの取り組みが進んでおり、環境に配慮した包装への需要が高まるなか、リサイクル効率の高いアルミニウムの包装を提供する会社および同社製品への注目が高まること、および循環経済への移行から恩恵を受けることを期待しています。

一方で、SAPを全売却しました。世界有数のソフトウェアメーカーであり、電気・公営事業、産業用機械、石油・ガス・エネルギー、自動車など様々な産業へ脱炭素化の促進に貢献するソリューションを提供していますが、自社のクラウドコンピューティングへの移行が思うように進まず、長期的な成長見通しが相対的に弱まったことなどから全売却しました。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないませんでした。

### [野村マネー マザーファンド]

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

## <Aコース/Bコース>

### ◎今後の運用方針

#### [野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース]

[BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY(分配なし)] 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 [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY(分配なし)] 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

#### [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus H JPY(分配なし)]

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないます。

投資対象とする環境関連企業には、再生可能エネルギー／代替エネルギー、エネルギー効率、水インフラ／水テクノロジー、汚染防止、廃棄物管理／テクノロジー、環境サポートサービス、持続可能な食品関連企業などが含まれますが、これらのテーマに限定されることなく、環境関連企業に幅広く投資を行ないます。

組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。

#### [野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース]

[BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus JPY(分配なし)] 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 [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus JPY(分配なし)] 受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

#### [BNPパリバ・ファンズグローバル・エンバイロメントーI Plus JPY(分配なし)]

新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行ないます。

投資対象とする環境関連企業には、再生可能エネルギー／代替エネルギー、エネルギー効率、水インフラ／水テクノロジー、汚染防止、廃棄物管理／テクノロジー、環境サポートサービス、持続可能な食品関連企業などが含まれますが、これらのテーマに限定されることなく、環境関連企業に幅広く投資を行ないます。

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

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

## &lt;Aコース&gt;

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年4月12日～2022年10月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 57	% 0.551	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(14)	(0.138)	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 )	(40)	(0.386)	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 )	(0.028)	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	57	0.553	
期中の平均基準価額は、10,418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せん。

\* 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。

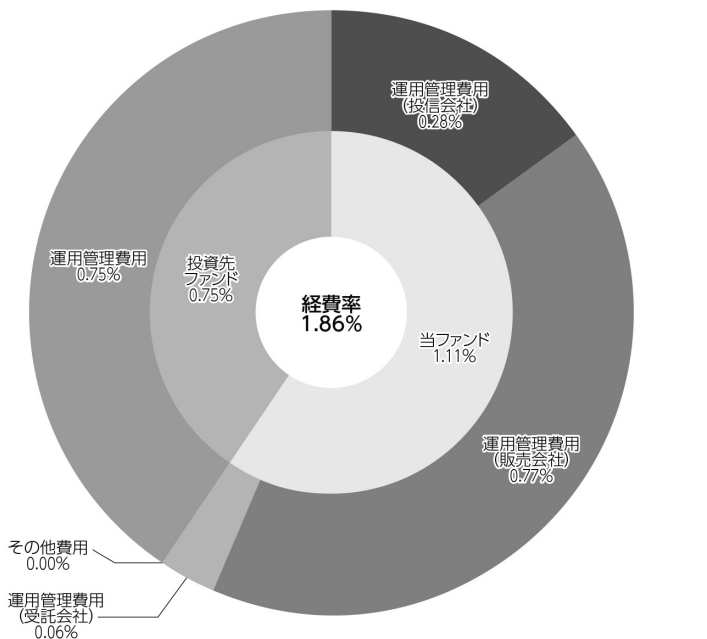
\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## <Aコース>

### (参考情報)

#### ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は1.86%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	1.86
①当ファンドの費用の比率	1.11
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.75

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（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) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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。

## &lt;Aコース&gt;

## ○売買及び取引の状況

(2022年4月12日～2022年10月11日)

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	BNPパリバ・ファンズグローバル・エンパイロメントーI Plus H JPY (分配なし)	口 —	千円 —	口 506,875	千円 5,463,299

\*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

(2022年4月12日～2022年10月11日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2022年10月11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	%
	BNPパリバ・ファンズグローバル・エンパイロメントーI Plus H JPY (分配なし)	6,760,740	6,253,865	60,968,931	98.7
	合計	6,760,740	6,253,865	60,968,931	98.7

\*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	98	98	99

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## &lt;Aコース&gt;

## ○投資信託財産の構成

(2022年10月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	60,968,931	98.0
野村マネー マザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	1,265,702	2.0
投資信託財産総額	62,234,732	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 (2022年10月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	62,234,732,482
コール・ローン等	1,265,701,195
投資信託受益証券(評価額)	60,968,931,327
野村マネー マザーファンド(評価額)	99,960
(B) 負債	472,036,616
未払解約金	82,130,282
未払信託報酬	388,739,308
未払利息	868
その他未払費用	1,166,158
(C) 純資産総額(A-B)	61,762,695,866
元本	64,875,446,363
次期繰越損益金	△ 3,112,750,497
(D) 受益権総口数	64,875,446,363口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,520円

(注) 期首元本額は69,789,619,078円、期中追加設定元本額は1,631,905,639円、期中一部解約元本額は6,546,078,354円、1口当たり純資産額は0.9520円です。

## ○損益の状況 (2022年4月12日～2022年10月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 108,760
支払利息	△ 108,760
(B) 有価証券売買損益	△11,930,994,549
売買益	521,593,358
売買損	△12,452,587,907
(C) 信託報酬等	△ 389,905,466
(D) 当期損益金(A+B+C)	△12,321,008,775
(E) 前期繰越損益金	3,025,693,866
(F) 追加信託差損益金	6,182,564,412
(配当等相当額)	( 2,088,587,858)
(売買損益相当額)	( 4,093,976,554)
(G) 計(D+E+F)	△ 3,112,750,497
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 3,112,750,497
追加信託差損益金	6,182,564,412
(配当等相当額)	( 2,088,587,858)
(売買損益相当額)	( 4,093,976,554)
分配準備積立金	8,560,223,093
繰越損益金	△17,855,538,002

\*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。

**<Aコース>**

(注) 分配金の計算過程 (2022年4月12日～2022年10月11日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年4月12日～ 2022年10月11日
a. 配当等収益(経費控除後)	0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	2,088,587,858円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	8,560,223,093円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	10,648,810,951円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,641円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万円当たり)	0円

**○分配金のお知らせ**

1万円当たり分配金(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**

該当事項はございません。

## &lt;Bコース&gt;

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年4月12日～2022年10月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 71	% 0.552	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(18)	(0.138)	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 )	(49)	(0.386)	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 )	( 4)	(0.028)	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	71	0.554	
期中の平均基準価額は、12,807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せん。

\*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。

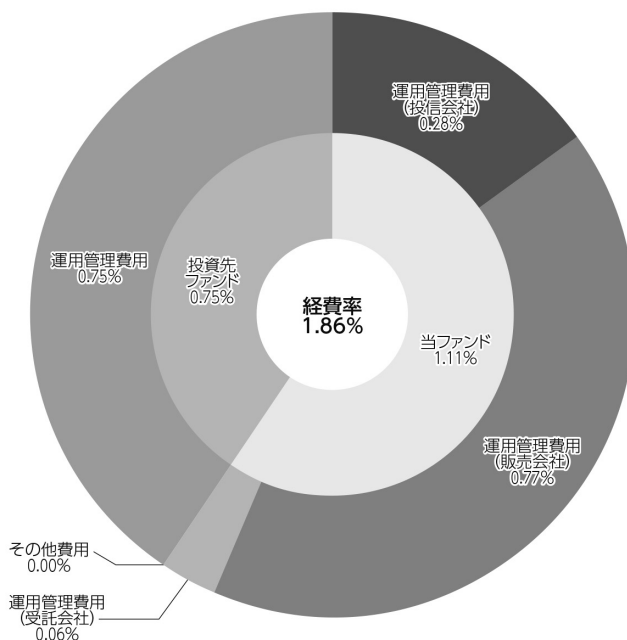


## &lt;Bコース&gt;

## (参考情報)

## ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は1.86%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	1.86
①当ファンドの費用の比率	1.11
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.75

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（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) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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。

## &lt;Bコース&gt;

## ○売買及び取引の状況

(2022年4月12日～2022年10月11日)

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	BNPパリバ・ファンズグローバル・エンパイロメントーI Plus JPY (分配なし)	42,296	539,799	607,823	8,032,200

\*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

(2022年4月12日～2022年10月11日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2022年10月11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	%
	BNPパリバ・ファンズグローバル・エンパイロメントーI Plus JPY (分配なし)	7,661,206	7,095,679	90,299,611	98.8
	合計	7,661,206	7,095,679	90,299,611	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。

## 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	98	98	99

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## &lt;Bコース&gt;

## ○投資信託財産の構成

(2022年10月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	90,299,611	97.6
野村マネー マザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	2,235,100	2.4
投資信託財産総額	92,534,810	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 (2022年10月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	92,534,810,037
コール・ローン等	2,235,099,022
投資信託受益証券(評価額)	90,299,611,055
野村マネー マザーファンド(評価額)	99,960
(B) 負債	1,108,983,072
未払収益分配金	73,727,633
未払解約金	488,523,084
未払信託報酬	545,095,599
未払利息	1,533
その他未払費用	1,635,223
(C) 純資産総額(A-B)	91,425,826,965
元本	73,727,633,008
次期繰越損益金	17,698,193,957
(D) 受益権総口数	73,727,633,008口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,400円

(注) 期首元本額は79,161,377,811円、期中追加設定元本額は3,568,876,527円、期中一部解約元本額は9,002,621,330円、1口当たり純資産額は1,2400円です。

## ○損益の状況 (2022年4月12日～2022年10月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 161,587
支払利息	△ 161,587
(B) 有価証券売買損益	△ 5,284,623,216
売買益	406,534,274
売買損	△ 5,691,157,490
(C) 信託報酬等	△ 546,730,822
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,831,515,625
(E) 前期繰越損益金	11,838,520,358
(F) 追加信託差損益金	11,764,916,857
(配当等相当額)	( 5,236,524,572)
(売買損益相当額)	( 6,528,392,285)
(G) 計(D+E+F)	17,771,921,590
(H) 収益分配金	△ 73,727,633
次期繰越損益金(G+H)	17,698,193,957
追加信託差損益金	11,764,916,857
(配当等相当額)	( 5,236,524,575)
(売買損益相当額)	( 6,528,392,282)
分配準備積立金	11,764,950,668
繰越損益金	△ 5,831,673,568

\*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。

**<Bコース>**

(注) 分配金の計算過程 (2022年4月12日～2022年10月11日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年4月12日～ 2022年10月11日
a. 配当等収益(経費控除後)	0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	5,933,404,236円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	11,838,678,301円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	17,772,082,537円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	2,410円
g. 分配金	73,727,633円
h. 分配金(1万円当たり)	10円

**○分配金のお知らせ**

1万円当たり分配金(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**

該当事項はございません。

# BNP パリバ・ファンズ・グローバル・エンバイロメントー

I Plus H JPY(分配なし) / I Plus JPY(分配なし)

2021年12月31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
投 資 対 象	新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式
投 資 方 針	新興国を含む世界各国の金融商品取引所に上場している環境関連企業の株式を主要投資対象とし、中期的な資産価値の成長を目指して運用を行なうことを基本とします。 投資対象とする環境関連企業には、再生可能エネルギー／代替エネルギー、エネルギー効率、水インフラ／水テクノロジー、汚染防止、廃棄物管理／テクノロジー、環境サポートサービス、持続可能な食品関連企業などが含まれますが、これらのテーマに限定されることなく、環境関連企業に幅広く投資を行ないます。
管 理 会 社	BNP パリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルグ
投 資 顧 問 会 社	インパックス・アセットマネジメント・リミテッド
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 会 社 名 義 書 換 事 務 受 託 会 社	BNP パリバ・セキュリティーズ・サービシーズ ルクセンブルグ支店

\*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。

**財務書類**  
**2021年12月31日現在**  
*(金額はユーロ表示)*

**運用計算書および純資産変動計算書**

<b>投資および資産に係る収益(純額)</b>	<b>53,557,200</b>
管理手数料	32,066,681
銀行利息	421,220
スワップに係る利息	0
その他の手数料	9,554,216
税金	1,247,163
取引手数料	2,595,200
販売手数料	501,986
<b>費用合計</b>	<b>46,386,466</b>
<b>純投資損益</b>	<b>7,170,734</b>
実現純損益：	
投資有価証券	123,926,520
金融商品	(34,578,642)
<b>実現純損益</b>	<b>96,518,612</b>
未実現純利益／(損失)の変動額：	
投資有価証券	715,963,936
金融商品	(14,386,771)
<b>運用による純資産の変動額</b>	<b>798,095,777</b>
<b>受益証券発行／(買戻)純額</b>	<b>1,037,050,595</b>
<b>支払配当金</b>	<b>(2,915,914)</b>
<b>当期中の純資産の増加／(減少)額</b>	<b>1,832,230,458</b>
<b>期首純資産</b>	<b>2,257,852,218</b>
<b>期首純資産総額再評価</b>	<b>0</b>
<b>期末純資産</b>	<b>4,090,082,676</b>

有価証券ポートフォリオ  
2021年12月31日現在  
(金額はユーロ表示)

数量	銘柄	建値通貨	市場価値	純資産比率 (%)
公式証券市場に上場されているおよび/またはその他の規制市場で取引されている譲渡可能有価証券			4,055,161,741	99.15
<b>株数</b>			<b>4,055,161,741</b>	<b>99.15</b>
	<b>アメリカ</b>		<i>2,020,504,048</i>	<i>49.40</i>
960,461	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	134,837,846	3.30
825,289	AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	137,059,516	3.35
289,866	ANSYS INC	USD	102,243,273	2.50
400,333	AUTODESK INC	USD	98,988,424	2.42
196,831	DEERE & CO	USD	59,348,735	1.45
459,753	ECOLAB INC	USD	94,841,238	2.32
115,342	EQUINIX INC	USD	85,790,430	2.10
622,199	HUBBELL INC	USD	113,951,271	2.79
521,125	IDEX CORP	USD	108,294,284	2.65
42,361	METTLER - TOLEDO INTERNATIONAL	USD	63,221,520	1.55
307,146	MICROSOFT CORP	USD	90,836,566	2.22
815,148	PTC INC	USD	86,840,644	2.12
281,356	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	86,309,392	2.11
588,575	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	97,545,489	2.38
618,651	TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	109,906,843	2.69
987,900	TRIMBLE INC	USD	75,743,054	1.85
502,165	VERISK ANALYTICS INC	USD	101,002,638	2.47
991,958	WASTE MANAGEMENT INC	USD	145,583,707	3.56
277,485	WATERS CORP	USD	90,917,087	2.22
2,087,725	WESTROCK CO	USD	81,438,165	1.99
529,188	XYLEM INC	USD	55,803,926	1.36
	<b>イギリス</b>		<i>743,577,631</i>	<i>18.17</i>
542,729	APTIV PLC	USD	78,722,431	1.92
516,971	CRODA INTERNATIONAL PLC	GBP	62,312,369	1.52
451,570	FERGUSON PLC	GBP	70,483,860	1.72
2,264,701	HALMA PLC	GBP	86,315,426	2.11
1,524,827	INTERTEK GROUP PLC	GBP	102,248,404	2.50
498,899	LINDE PLC	USD	151,981,693	3.72
4,138,329	PENNON GROUP PLC	GBP	57,520,604	1.41
1,435,887	PENTAIR PLC	USD	92,211,421	2.25
218,565	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	GBP	41,781,423	1.02
	<b>ドイツ</b>		<i>268,914,957</i>	<i>6.58</i>
2,344,015	GEA GROUP AG	EUR	112,723,681	2.76
439,493	SAP SE	EUR	54,892,676	1.34
663,470	SIEMENS AG - REG	EUR	101,298,600	2.48

数量	銘柄	建値通貨	市場価値	純資産比率 (%)
<b>フランス</b>				
526,319	AIR LIQUIDE SA	EUR	265,780,620	6.49
766,140	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	80,695,229	1.97
1,641,565	VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	132,128,504	3.23
			52,956,887	1.29
<b>オランダ</b>				
84,896	ASML HOLDING NV	EUR	175,656,713	4.30
584,145	KONINKLIJKE DSM NV	EUR	59,996,003	1.47
			115,660,710	2.83
<b>日本</b>				
99,300	KEYENCE CORP	JPY	154,747,514	3.79
5,097,400	KUBOTA CORP	JPY	55,032,679	1.35
			99,714,835	2.44
<b>デンマーク</b>				
713,525	ORSTED A/S	DKK	142,156,244	3.48
2,306,826	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	DKK	80,124,782	1.96
			62,031,462	1.52
<b>台湾</b>				
7,468,525	DELTA ELECTRONIC INDUSTRIAL CO	TWD	132,691,823	3.24
1,776,000	MEDIATEK INC	TWD	65,436,148	1.60
			67,255,675	1.64
<b>スイス</b>				
45,697	FISCHER (GEORG) - REG	CHF	130,435,297	3.19
488,833	TE CONNECTIVITY LTD	USD	61,082,223	1.49
			69,353,074	1.70
<b>香港</b>				
11,648,000	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS	HKD	20,696,894	0.51
			20,696,894	0.51
<b>有価証券ポートフォリオ合計</b>			<b>4,055,161,741</b>	<b>99.15</b>



# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年8月19日）

作成対象期間（2021年8月20日～2022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**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		騰落	中率			
	円		%	%	%	百万円
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159
20期(2022年8月19日)	10,199		△0.0	57.5	—	7,850

\*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

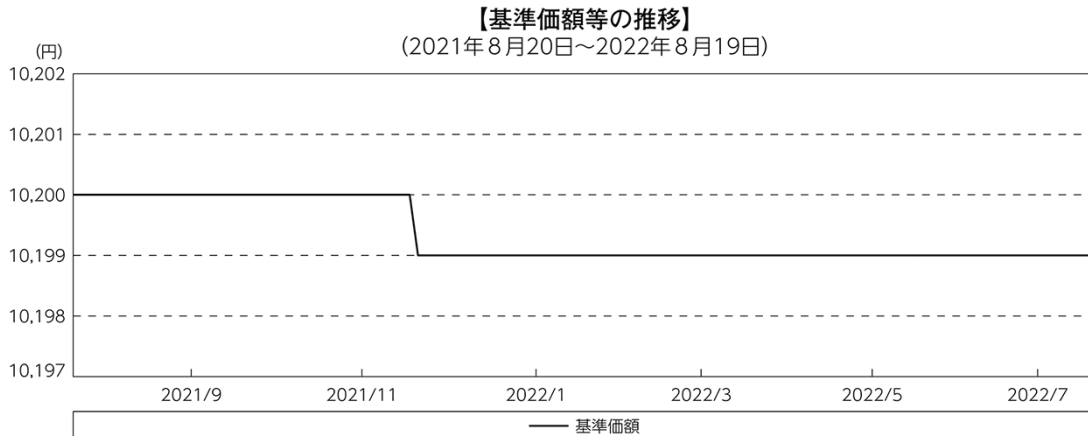
年月日	基準	価額		債組入比率	債券先物比率
		騰落	率		
(期首) 2021年8月19日	円		%	%	%
	10,200		—	60.1	—
8月末	10,200		0.0	56.8	—
9月末	10,200		0.0	55.1	—
10月末	10,200		0.0	51.6	—
11月末	10,200		0.0	54.5	—
12月末	10,199		△0.0	52.1	—
2022年1月末	10,199		△0.0	57.1	—
2月末	10,199		△0.0	57.5	—
3月末	10,199		△0.0	59.5	—
4月末	10,199		△0.0	60.1	—
5月末	10,199		△0.0	62.0	—
6月末	10,199		△0.0	55.6	—
7月末	10,199		△0.0	53.7	—
(期末) 2022年8月19日	10,199		△0.0	57.5	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



### ○基準価額の主な変動要因

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

### ○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症による厳しい状況が緩和される中で、消費や雇用環境などには持ち直しの動きが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年12月には、2022年3月末が期限となっていた「新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム」について中小企業向けに部分的な延長を決定しました。

TDB (国庫短期証券) 3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね-0.1%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は0~-0.05%程度で推移しました。

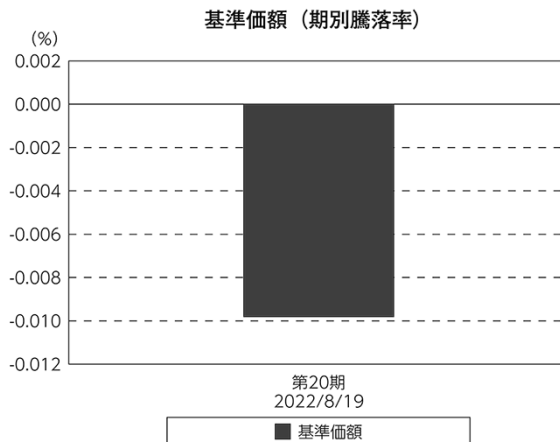
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年8月20日～2022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

(2021年8月20日～2022年8月19日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 4,055,682	千円 — (4,600,000)
	特殊債券	7,031,417	— (6,457,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	2,136,048	— (3,130,000)

\*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

(2021年8月20日～2022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	
		百万円	$\frac{B}{A}$		百万円	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 13,223	百万円 30	% 0.2	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証券株式会社です。

(2022年8月19日現在)

## ○組入資産の明細

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	750,000 ( 750,000)	750,520 ( 750,520)	9.6 ( 9.6)	— (—)	— (—)	— (—)	9.6 ( 9.6)
特殊債券 (除く金融債)	2,430,000 (2,430,000)	2,431,889 (2,431,889)	31.0 (31.0)	— (—)	— (—)	— (—)	31.0 (31.0)
金融債券	530,000 ( 530,000)	530,049 ( 530,049)	6.8 ( 6.8)	— (—)	— (—)	— (—)	6.8 ( 6.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	800,000 ( 800,000)	800,923 ( 800,923)	10.2 (10.2)	— (—)	— (—)	— (—)	10.2 (10.2)
合 計	4,510,000 (4,510,000)	4,513,382 (4,513,382)	57.5 (57.5)	— (—)	— (—)	— (—)	57.5 (57.5)

\* ( )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	利 率	当 期 末	
		額 面 金 額	評 価 額
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円
東京都 公募第711回	0.82	300,000	300,218
福岡県 公募平成24年度第4回	0.84	50,000	50,007
千葉県 公募平成24年度第5回	0.82	100,000	100,074
共同発行市場地方債 公募第114回	0.82	300,000	300,220
小 計		750,000	750,520
<b>特殊債券(除く金融債)</b>			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第96回	0.796	300,000	300,221
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	2.28	150,000	150,305
地方公共団体金融機構債券 第40回	0.825	110,000	110,101
地方公共団体金融機構債券 第41回	0.801	100,000	100,146
地方公共団体金融機構債券 第42回	0.801	40,000	40,086
日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債	0.825	300,000	300,456
都市再生債券 財投機関債第68回	0.854	200,000	200,159
都市再生債券 財投機関債第71回	0.767	200,000	200,131
日本学生支援債券 財投機関債第60回	0.001	300,000	300,000
日本学生支援債券 財投機関債第61回	0.001	100,000	100,000
国際協力機構債券 第14回財投機関債	0.825	300,000	300,221
東日本高速道路 第48回	0.09	100,000	100,032
西日本高速道路 第37回	0.09	130,000	130,016
西日本高速道路 第38回	0.09	100,000	100,010
小 計		2,430,000	2,431,889
<b>金融債券</b>			
商工債券 利付第811回い号	0.17	30,000	30,018
しんきん中金債券 利付第333回	0.09	200,000	200,011
商工債券 利付(3年)第236回	0.02	300,000	300,019
小 計		530,000	530,049
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>			
伊藤忠商事 第67回社債間限定同順位特約付	0.964	100,000	100,052
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	100,408
三井不動産 第46回社債間限定同順位特約付	0.964	200,000	200,063
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	300,000	300,205
電源開発 第35回社債間限定同順位特約付	1.126	100,000	100,193
小 計		800,000	800,923
合 計		4,510,000	4,513,382

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,513,382	57.5
コール・ローン等、その他	3,340,370	42.5
投資信託財産総額	7,853,752	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 (2022年8月19日現在)

項目	当期末 円
(A) 資産	7,853,752,692
コール・ローン等	3,326,621,034
公社債(評価額)	4,513,382,357
未収利息	7,215,305
前払費用	6,533,996
(B) 負債	3,470,854
未払解約金	3,470,000
未払利息	854
(C) 純資産総額(A-B)	7,850,281,838
元本	7,697,164,972
次期繰越損益金	153,116,866
(D) 受益権総口数	7,697,164,972口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,199円

(注) 期首元本額は8,979,256,768円、期中追加設定元本額は3,202,453,404円、期中一部解約元本額は4,484,545,200円、1口当たり純資産額は1.0199円です。

## ○損益の状況 (2021年8月20日～2022年8月19日)

項目	当期 円
(A) 配当等収益	23,315,784
受取利息	23,990,043
支払利息	△ 674,259
(B) 有価証券売買損益	△ 24,456,523
売買損	△ 24,456,523
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,140,739
(D) 前期繰越損益金	179,893,174
(E) 追加信託差損益金	63,852,596
(F) 解約差損益金	△ 89,488,165
(G) 計(C+D+E+F)	153,116,866
次期繰越損益金(G)	153,116,866

\*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
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用)	1,941,761,887
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,503,668,510
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	1,248,281,712
野村世界業種別投資シリーズ(マネーパブル・ファンド)	441,709,194
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家販売制限付)	188,174,367
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーパブル・ファンド)	128,372,175
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
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
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

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(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンプレートン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンプレートン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプレートン・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



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(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(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(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
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(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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	626,503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)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(インドルピーコース)毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	123,377
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(ユーロコース)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(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウェスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

## 〇お知らせ

該当事項はございません。