

ダブル・ブレイン（ブル）

運用報告書(全体版)

第1期（決算日2021年11月22日）

作成対象期間（2021年3月3日～2021年11月22日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）	
信託期間	2021年3月3日から2028年11月22日までです。	
運用方針	外国投資法人であるマン・ファンズIXーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス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インベストメント マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券等を実質的な主要投資対象とし、株式、債券、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を実質的な主要取引対象とし、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。各証券への投資比率は、通常の状況においては、マン・ファンズIXーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラスの外国投資証券への投資を中心としますが、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。	
主な投資対象	ダブル・ブレイン（ブル）	マン・ファンズIXーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラスの円建ての外国投資証券および野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマースナル・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。
	マン・ファンズIXーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス 野村マネーインベストメント マザーファンド	世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券等を実質的な主要投資対象とし、株式、債券、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を実質的な主要取引対象とします。 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	ダブル・ブレイン（ブル）	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行ないません。
	野村マネーインベストメント マザーファンド	株式への投資は行ないません。外貨建資産への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。	

野村アセットマネジメント

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/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債組入比	債券率	債先物比	債券率	投資信託 組入比	純資産 総額
		税金 分	込配 み金騰落						
(設定日) 2021年3月3日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 2,397
1期(2021年11月22日)	12,930	0	29.3	0.0	—	—	96.6	—	74,476

*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	債券率	債先物比	債券率	投資信託 組入比	託券率
		騰落	率						
(設定日) 2021年3月3日	円 10,000		% —	% —	% —	% —	% —	% —	% —
3月末	10,121		1.2	0.0	—	—	—	—	91.7
4月末	10,483		4.8	0.0	—	—	—	—	94.6
5月末	10,752		7.5	0.0	—	—	—	—	96.3
6月末	11,245		12.5	0.0	—	—	—	—	96.3
7月末	12,261		22.6	0.0	—	—	—	—	95.1
8月末	12,298		23.0	0.0	—	—	—	—	93.8
9月末	11,897		19.0	0.0	—	—	—	—	94.4
10月末	12,699		27.0	0.0	—	—	—	—	96.4
(期末) 2021年11月22日	12,930		29.3	0.0	—	—	—	—	96.6

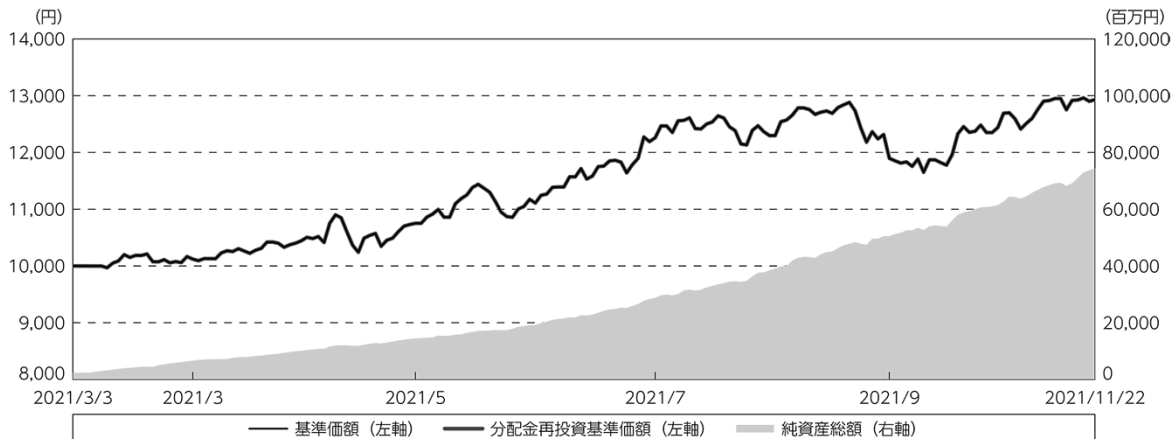
*騰落率は設定日比です。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：12,930円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 29.3% (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。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券等への実質的な投資、および、株式、債券、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）

○投資環境

【世界株式市場】

2021年6月は、米長期金利の低下や欧州の堅調な経済指標などを背景に上昇しました。

9月は、中国の大手不動産会社の債務問題や、FOMC（米連邦公開市場委員会）を受けて米金融政策の正常化が意識され、米長期金利が上昇基調となったことなどを背景に下落しました。

10月は、米欧企業の市場予想を上回る7-9月期決算が続いたことなどを背景に上昇しました。

【世界債券市場】

2021年3月は、堅調な米経済指標や追加経済対策などにより景気回復期待が高まり、下落しました。

5月は、4月の米国非農業部門の雇用者数の伸びが市場の事前予想を大きく下回ったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）の継続的な国債買い入れなどにより上昇しました。

9月は、FOMCでテーパリング（量的金融緩和の縮小）開始時期について年内が適切との見方を示したことを受けて下落しました。

【為替市場】

2021年9月は、中国の大手不動産会社の債務問題などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、円高となる局面もありましたが、同債務問題への懸念が一旦和らいだことや、FOMCを受けて米金融政策の正常化が意識され、米長期金利が上昇基調となったことなどを背景に円安・米ドル高となりました。

10月は、米金融政策の正常化が意識され、米長期金利が上昇基調を強めたこと、商品価格が上昇したことなどを背景に円安が進み、円安・米ドル高となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[ダブル・ブレイン（ブル）]

〔マン・ファンズ区ーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス〕および〔野村マネーインベストメント 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〔マン・ファンズ区ーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス〕 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

[マン・ファンズ区ーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス]

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券等を実質的な主要投資対象とし、株式、債券、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を実質的な主要取引対象とします。

○当作成期におけるファンドの騰落率はプラスとなりました。セクター別ではファンドに対するプラスの寄与が大きかったのは、株式、コモディティセクターなどとなりました。個別の寄与度では、ブルームバーグ商品指数、米国債（10年）などが上位となりました。

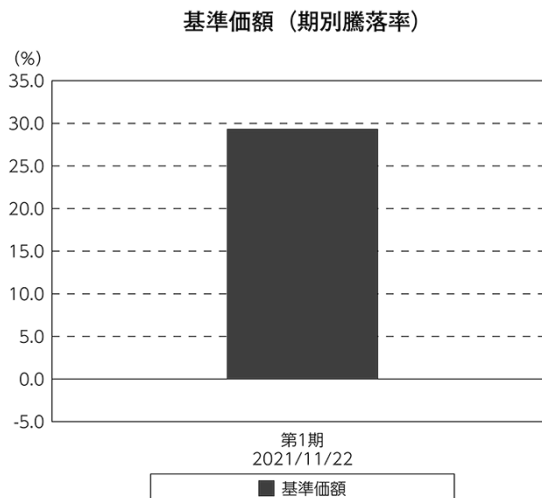
[野村マネーインベストメント マザーファンド]

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。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、利子・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案して分配を行いませんでした。

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1期
	2021年3月3日～ 2021年11月22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	2,929

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[ダブル・ブレイン（ブル）]

[マン・ファンズ区ーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス] 受益証券および [野村マネーインベストメント 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 [マン・ファンズ区ーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス] 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

[マン・ファンズ区ーマン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロムー日本円クラス]

世界各国（新興国を含みます。）の株式、債券等を実質的な主要投資対象とし、株式、債券、商品等に関連するデリバティブ取引、為替予約取引等を実質的な主要取引対象とすることにより、中期的な収益の獲得を目指します。

また、米ドル売り円買いの為替ヘッジを機動的に行ないます。

[野村マネーインベストメント 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。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年3月3日～2021年11月22日）

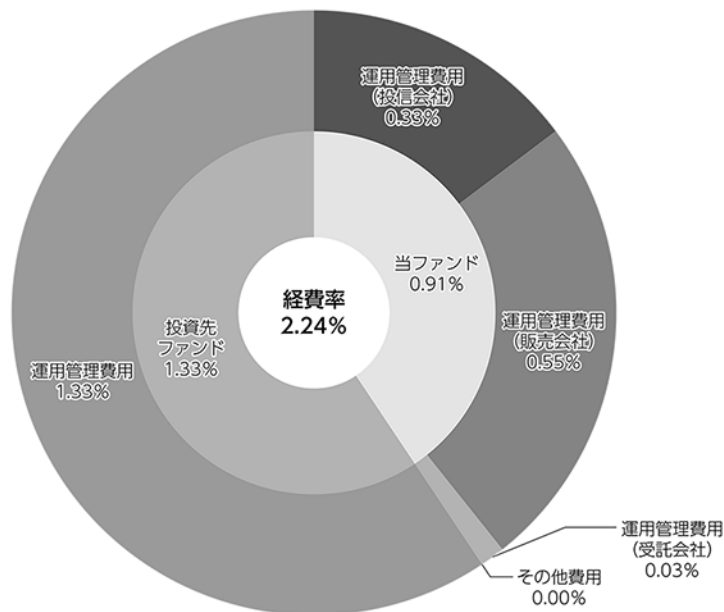
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 76	% 0.663	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(27)	(0.240)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(46)	(0.399)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.024)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b)その他費用＝期中のその他費用÷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	76	0.665	
期中の平均基準価額は、11,469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。

（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2.24%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	2.24
①当ファンドの費用の比率	0.91
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.33

(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。

○売買及び取引の状況

(2021年3月3日～2021年11月22日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	マン・ファンズIX-マン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロム-日本円クラス	5,460,782	65,266,400	11,782	151,700

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	野村マネーインベストメント マザーファンド	99	100	-	-

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月3日～2021年11月22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

(2021年11月22日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		当期末		
		口数	評価額	比率
	マン・ファンズIX-マン・インスティテューショナル・ポートフォリオ・クロム-日本円クラス	5,449,000	71,954,324	96.6
	合 計	5,449,000	71,954,324	96.6

*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	当 期 末	
		口 数	評 価 額
野村マネーインベストメント マザーファンド		千口 99	千円 99

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年11月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 71,954,324	% 94.2
野村マネーインベストメント マザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	4,422,855	5.8
投資信託財産総額	76,377,278	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（2021年11月22日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	76,377,278,489
コール・ローン等	4,422,854,414
投資信託受益証券(評価額)	71,954,324,105
野村マネインベストメント マザーファンド(評価額)	99,970
(B) 負債	1,900,845,498
未払金	1,643,700,000
未払解約金	65,775,583
未払信託報酬	190,676,870
未払利息	3,939
その他未払費用	689,106
(C) 純資産総額(A-B)	74,476,432,991
元本	57,601,336,489
次期繰越損益金	16,875,096,502
(D) 受益権総口数	57,601,336,489口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,930円

(注) 期首元本額は2,397,453,954円、期中追加設定元本額は56,700,538,755円、期中一部解約元本額は1,496,656,220円、1口当たり純資産額は1.2930円です。

○損益の状況（2021年3月3日～2021年11月22日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 330,709
支払利息	△ 330,709
(B) 有価証券売買損益	6,677,827,328
売買益	6,839,624,105
売買損	△ 161,796,777
(C) 信託報酬等	△ 191,365,976
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,486,130,643
(E) 追加信託差損益金	10,388,965,859
(配当等相当額)	(△ 518,166)
(売買損益相当額)	(10,389,484,025)
(F) 計(D+E)	16,875,096,502
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	16,875,096,502
追加信託差損益金	10,388,965,859
(配当等相当額)	(△ 518,117)
(売買損益相当額)	(10,389,483,976)
分配準備積立金	6,486,461,173
繰越損益金	△ 330,530

* 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(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。

(注) 分配金の計算過程（2021年3月3日～2021年11月22日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年3月3日～ 2021年11月22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)	6,486,461,173円
c. 信託約款に定める収益調整金	10,389,483,976円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	16,875,945,149円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,929円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○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

該当事項はございません。

野村マネーインベストメント マザーファンド

運用報告書

第11期（決算日2021年2月18日）

作成対象期間（2020年2月19日～2021年2月18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	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、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	株式への投資は行いません。 外貨建て資産への投資は行いません。

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

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	中率			
7期(2017年2月20日)	円 10,048		% △0.0	% 13.7	% —	百万円 109
8期(2018年2月19日)	10,044		△0.0	23.9	—	109
9期(2019年2月18日)	10,037		△0.1	33.9	—	59
10期(2020年2月18日)	10,033		△0.0	64.8	—	20
11期(2021年2月18日)	10,029		△0.0	59.8	—	20

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

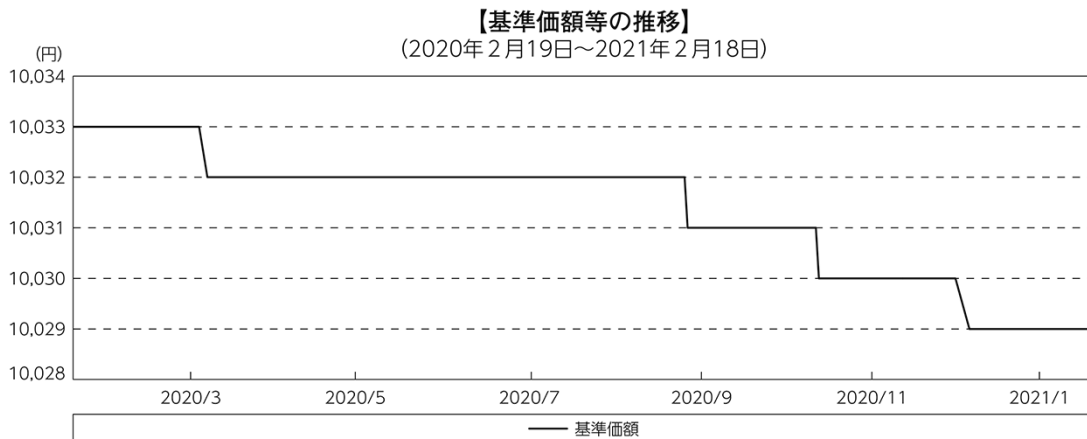
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年2月18日	円 10,033		% —	% 64.8	% —
2月末	10,033		0.0	64.8	—
3月末	10,033		0.0	10.0	—
4月末	10,032		△0.0	65.0	—
5月末	10,032		△0.0	64.9	—
6月末	10,032		△0.0	64.9	—
7月末	10,032		△0.0	59.8	—
8月末	10,032		△0.0	59.8	—
9月末	10,031		△0.0	59.8	—
10月末	10,031		△0.0	59.8	—
11月末	10,030		△0.0	59.8	—
12月末	10,030		△0.0	59.8	—
2021年1月末	10,029		△0.0	59.8	—
(期末) 2021年2月18日	10,029		△0.0	59.8	—

*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の感染拡大により、個人消費を始め、輸出入や生産が減少するとともに、企業収益が急速に悪化しましたが、その後は徐々に消費や生産に持ち直しの動きも出始めました。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、2020年3月および4月には資産買入の拡大などの金融緩和策を決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、円調達コスト低下による外国人投資家需要の拡大から期首より低下基調となり、2020年3月下旬には-0.4%台となりましたが、その後は上昇し、概ね-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.07%程度で推移しました。

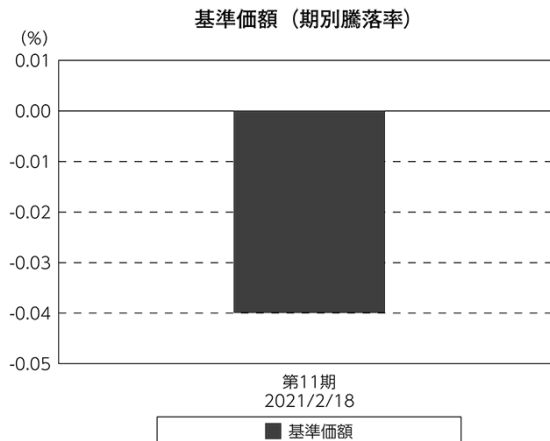
○当ファンドのポートフォリオ

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

(2020年2月19日～2021年2月18日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年2月19日～2021年2月18日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	24,006	—
			(12,000)
内	特殊債券	11,044	—
			(24,000)

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2020年2月19日～2021年2月18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	$\frac{B}{A}$	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	35	23	65.7	—	—	—

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

(2021年2月18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			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	%	%	%	%	%	
国債証券	12,000 (12,000)	12,000 (12,000)	59.8 (59.8)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	59.8 (59.8)
合 計	12,000 (12,000)	12,000 (12,000)	59.8 (59.8)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	59.8 (59.8)

* () 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	柄	当 期 末		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券		%	千円	千円
国庫短期証券 第955回		—	12,000	12,000
合 計			12,000	12,000

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年2月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 12,000	% 59.8
コール・ローン等、その他	8,071	40.2
投資信託財産総額	20,071	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 (2021年2月18日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	20,071,454 円
コール・ローン等	8,070,906
公社債(評価額)	12,000,548
(B) 負債	7
未払利息	7
(C) 純資産総額(A-B)	20,071,447
元本	20,014,038
次期繰越損益金	57,409
(D) 受益権総口数	20,014,038口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,029円

(注) 期首元本額は20,014,038円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は0円、1口当たり純資産額は1.0029円です。

(注) 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
・ノルディック社債ファンド 為替ヘッジあり 9,952,230円
・ノルディック社債ファンド 為替ヘッジなし 9,952,230円
・ダブル・ブレイク 99,612円
・ノムラ日本株ベータヘッジ戦略ファンド(SMA専用) 9,966円

○損益の状況

(2020年2月19日～2021年2月18日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	55,045 円
受取利息	57,919
支払利息	△ 2,874
(B) 有価証券売買損益	△63,703
売買損	△63,703
(C) 当期損益金(A+B)	△ 8,658
(D) 前期繰越損益金	66,067
(E) 計(C+D)	57,409
次期繰越損益金(E)	57,409

*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まず。

○お知らせ

該当事項はございません。