

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2020年9月25日提出

【発行者名】 グローバル・ファンズ・マネジメント・エス・エー
(GLOBAL FUNDS MANAGEMENT S.A.)

【代表者の役職氏名】 取締役兼コンダクティング・オフィサー ジャンフランソワ・カプラス
(Jean-François Caprasse, Director & Conducting Officer)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国 エスペランジュ ガスペリッシュ通り33番 A棟
(Bâtiment A, 33, rue de Gasperich, L-5826 Hesperange, Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 竹野 康造

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松
本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 竹野 康造

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松
本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集(売
出)外国投資信託受益証券
に係るファンドの名称】 ノムラ外貨MMF(Nomura Multi Currency MMF)

【届出の対象とした募集(売
出)外国投資信託受益証券
の金額】 以下の5つのサブ・ファンドの受益証券が募集されます。
(1) US マネー マーケット ファンド
受益証券5,000億米ドル(52兆3,000億円)を限度とします。
(2) 豪ドル マネー マーケット ファンド
受益証券5,000億豪ドル(37兆6,850億円)を限度とします。
(3) 英ポンド マネー マーケット ファンド
受益証券5,000億英ポンド(68兆6,050億円)を限度とします。
(4) カナダドル マネー マーケット ファンド
受益証券5,000億カナダドル(38兆9,400億円)を限度とします。
(5) NZドル マネー マーケット ファンド
受益証券5,000億ニュージーランドドル(34兆9,950億円)を限度とします。
(注)米ドル、豪ドル、英ポンド、カナダドルおよびニュージーランドドル(以下「NZドル」といいます)の
円貨換算は、2020年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=
104.60円、1豪ドル=75.37円、1英ポンド=137.21円、1カナダドル=77.88円および1NZドル=
69.99円)によります。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2020年6月26日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により追加・更新するため、また、投資リスクの参考情報および報酬料率に関する情報を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書提出に伴う訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格	(3) トラストの仕組み 管理会社の概要 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	(3) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。（「5 管理会社の経理の概況」は、訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

グローバル・ファンズ・マネジメント・エス・エー(以下「管理会社」といいます。)が管理するノムラ外貨MMFのサブ・ファンドであるUS マネー マーケット ファンド、豪ドル マネー マーケット ファンド、英ポンド マネー マーケット ファンド、カナダドル マネー マーケット ファンドおよびNZドル マネー マーケット ファンド(以下それぞれのサブ・ファンドを「ファンド」といいます。)の運用状況は次のとおりです。

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

() US マネー マーケット ファンド

(2020年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(米ドル)	投資比率(%)
ユーロ・コマーシャル・ペーパー	フランス	1,874,250,882	45.53
	ドイツ	997,666,042	24.24
	フィンランド	287,889,836	6.99
	オランダ	268,883,885	6.53
小計		3,428,690,645	83.29
現金・その他の資産(負債控除後)		687,820,246	16.71
合計(純資産総額)		4,116,510,891 (約430,587百万円)	100.00

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 米ドルの円貨換算は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=104.60円)によります。以下同じです。

(注3) 本書の中で、金額および比率を表示する場合、四捨五入してあります。従って、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ必要な場合四捨五入してあります。従って、本書中の同一の情報につき異なった円貨表示がなされている場合があります。

() 豪ドル マネー マーケット ファンド

(2020年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(豪ドル)	投資比率(%)
ユーロ・コマーシャル・ ペーパー	ドイツ	1,308,560,318	50.03
	フランス	900,691,788	34.44
小計		2,209,252,106	84.47
現金・その他の資産(負債控除後)		406,088,921	15.53
合計(純資産総額)		2,615,341,027 (約197,118百万円)	100.00

(注) 豪ドルの円貨換算は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1豪ドル=75.37円)によります。以下同じです。

() 英ポンド マネー マーケット ファンド

(2020年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(英ポンド)	投資比率(%)
短期国債	イギリス	29,069,529	57.96
	小計	29,069,529	57.96
ユーロ・コマーシャル・ ペーパー	ドイツ	4,999,907	9.97
	小計	4,999,907	9.97
小計		34,069,435	67.93
現金・その他の資産(負債控除後)		16,081,833	32.07
合計(純資産総額)		50,151,268 (約6,881百万円)	100.00

(注) 英ポンドの円貨換算は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1英ポンド=137.21円)によります。以下同じです。

()カナダドル マネー マーケット ファンド

(2020年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(カナダドル)	投資比率(%)
短期国債	カナダ	61,976,851	61.63
	小計	61,976,851	61.63
ユーロ・コマーシャル・ ペーパー	ドイツ	20,997,862	20.88
	小計	20,997,862	20.88
小計		82,974,713	82.51
現金・その他の資産(負債控除後)		17,587,358	17.49
合計(純資産総額)		100,562,070 (約7,832百万円)	100.00

(注)カナダドルの円貨換算は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1カナダドル=77.88円)によります。以下同じです。

()NZドル マネー マーケット ファンド

(2020年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計(NZドル)	投資比率(%)
ユーロ・コマーシャル・ ペーパー	フランス	215,670,530	43.39
	ドイツ	164,921,711	33.18
	オランダ	39,973,998	8.04
小計		420,566,239	84.62
現金・その他の資産(負債控除後)		76,453,257	15.38
合計(純資産総額)		497,019,495 (約34,786百万円)	100.00

(注)NZドルの円貨換算は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1NZドル=69.99円)によります。以下同じです。

[次へ](#)

(2) 運用実績

純資産の推移

2020年7月末日および同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次のとおりです。

() US マネー マーケット ファンド

	純資産総額		1口当りの純資産価格	
	千米ドル	百万円	米セント	円
2019年8月末日	3,579,432	374,409	1	1.05
9月末日	3,612,040	377,819	1	1.05
10月末日	3,622,068	378,868	1	1.05
11月末日	3,620,958	378,752	1	1.05
12月末日	3,551,672	371,505	1	1.05
2020年1月末日	3,591,218	375,641	1	1.05
2月末日	3,644,747	381,241	1	1.05
3月末日	3,799,270	397,404	1	1.05
4月末日	3,847,158	402,413	1	1.05
5月末日	3,960,907	414,311	1	1.05
6月末日	4,038,217	422,397	1	1.05
7月末日	4,116,511	430,587	1	1.05

() 豪ドル マネー マーケット ファンド

	純資産総額		1口当りの純資産価格	
	千豪ドル	百万円	豪セント	円
2019年8月末日	2,540,315	191,464	1	0.75
9月末日	2,572,963	193,924	1	0.75
10月末日	2,604,695	196,316	1	0.75
11月末日	2,576,403	194,183	1	0.75
12月末日	2,558,509	192,835	1	0.75
2020年1月末日	2,598,446	195,845	1	0.75
2月末日	2,575,620	194,124	1	0.75
3月末日	2,623,465	197,731	1	0.75
4月末日	2,665,627	200,908	1	0.75
5月末日	2,654,203	200,047	1	0.75
6月末日	2,637,713	198,804	1	0.75
7月末日	2,615,341	197,118	1	0.75

() 英ポンド マネー マーケット ファンド

	純資産総額		1口当りの純資産価格	
	千英ポンド	百万円	英ペンス	円
2019年8月末日	57,940	7,950	1	1.37
9月末日	57,444	7,882	1	1.37
10月末日	56,688	7,778	1	1.37
11月末日	55,437	7,607	1	1.37
12月末日	55,905	7,671	1	1.37
2020年1月末日	55,629	7,633	1	1.37
2月末日	55,287	7,586	1	1.37
3月末日	51,893	7,120	1	1.37
4月末日	51,800	7,107	1	1.37
5月末日	51,901	7,121	1	1.37
6月末日	50,276	6,898	1	1.37
7月末日	50,151	6,881	1	1.37

() カナダドル マネー マーケット ファンド

	純資産総額		1口当りの純資産価格	
	千カナダドル	百万円	カナダセント	円
2019年8月末日	103,421	8,054	1	0.78
9月末日	102,400	7,975	1	0.78
10月末日	101,527	7,907	1	0.78
11月末日	100,447	7,823	1	0.78
12月末日	99,609	7,758	1	0.78
2020年1月末日	99,431	7,744	1	0.78
2月末日	98,890	7,702	1	0.78
3月末日	98,647	7,683	1	0.78
4月末日	100,348	7,815	1	0.78
5月末日	100,271	7,809	1	0.78
6月末日	100,309	7,812	1	0.78
7月末日	100,562	7,832	1	0.78

() NZドル マネー マーケット ファンド

	純資産総額		1口当りの純資産価格	
	千NZドル	百万円	NZセント	円
2019年8月末日	505,658	35,391	1	0.70
9月末日	505,229	35,361	1	0.70
10月末日	503,270	35,224	1	0.70
11月末日	500,187	35,008	1	0.70
12月末日	498,483	34,889	1	0.70
2020年1月末日	492,489	34,469	1	0.70
2月末日	491,126	34,374	1	0.70
3月末日	491,526	34,402	1	0.70
4月末日	502,833	35,193	1	0.70
5月末日	501,922	35,130	1	0.70
6月末日	499,988	34,994	1	0.70
7月末日	497,019	34,786	1	0.70

[次へ](#)

分配の推移

() US マネー マーケット ファンド

ファンド証券の1口当り純資産価格を1米セントに維持するために必要な額の分配が日々行われています。毎月の最終取引日(再投資日)に、当該最終取引日の直前の日までに宣言され、発生済・未払いのすべての分配金(ルクセンブルグおよびその他の受益者の所在国の分配金についての源泉税およびその他の税金がある場合は控除後)が自動的に、当該再投資日の直前の取引日に決定される1口当り純資産価格で再投資され、これにつきファンド証券が発行されます。

2019年8月1日から2020年7月末日までの1口当り分配金の合計額は、0.000094020米ドルでした。

() 豪ドル マネー マーケット ファンド

ファンド証券の1口当り純資産価格を1豪セントに維持するために必要な額の分配が日々行われています。毎月の最終取引日(再投資日)に、当該最終取引日の直前の日までに宣言され、発生済・未払いのすべての分配金(ルクセンブルグおよびその他の受益者の所在国の分配金についての源泉税およびその他の税金がある場合は控除後)が自動的に、当該再投資日の直前の取引日に決定される1口当り純資産価格で再投資され、これにつきファンド証券が発行されます。

2019年8月1日から2020年7月末日までの1口当り分配金の合計額は、0.000035437豪ドルでした。

() 英ポンド マネー マーケット ファンド

ファンド証券の1口当り純資産価格を1英ペンスに維持するために必要な額の分配が日々行われています。毎月の最終取引日(再投資日)に、当該最終取引日の直前の日までに宣言され、発生済・未払いのすべての分配金(ルクセンブルグおよびその他の受益者の所在国の分配金についての源泉税およびその他の税金がある場合は控除後)が自動的に、当該再投資日の直前の取引日に決定される1口当り純資産価格で再投資され、これにつきファンド証券が発行されます。

2019年8月1日から2020年7月末日までの1口当り分配金の合計額は、0.000031210英ポンドでした。

() カナダドル マネー マーケット ファンド

ファンド証券の1口当り純資産価格を1カナダセントに維持するために必要な額の分配が日々行われています。毎月の最終取引日(再投資日)に、当該最終取引日の直前の日までに宣言され、発生済・未払いのすべての分配金(ルクセンブルグおよびその他の受益者の所在国の分配金についての源泉税およびその他の税金がある場合は控除後)が自動的に、当該再投資日の直前の取引日に決定される1口当り純資産価格で再投資され、これにつきファンド証券が発行されます。

2019年8月1日から2020年7月末日までの1口当り分配金の合計額は、0.000067099カナダドルでした。

() NZドル マネー マーケット ファンド

ファンド証券の1口当り純資産価格を1NZセントに維持するために必要な額の分配が日々行われています。毎月の最終取引日(再投資日)に、当該最終取引日の直前の日までに宣言され、発生済・未払いのすべての分配金(ルクセンブルグおよびその他の受益者の所在国の分配金についての源泉税およびその他の税金がある場合は控除後)が自動的に、当該再投資日の直前の取引日に決定される1口当り純資産価格で再投資され、これにつきファンド証券が発行されます。

2019年8月1日から2020年7月末日までの1口当り分配金の合計額は、0.000046653NZドルでした。

収益率の推移

() US マネー マーケット ファンド

期間	収益率(注)
2019年8月1日～2020年7月末日	0.94%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2020年7月末日の1口当り純資産価格 + 当該期間の分配金の合計額

b = 2019年7月末日の1口当り純資産価格

() 豪ドル マネー マーケット ファンド

期間	収益率(注)
2019年8月1日～2020年7月末日	0.35%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2020年7月末日の1口当り純資産価格 + 当該期間の分配金の合計額

b = 2019年7月末日の1口当り純資産価格

() 英ポンド マネー マーケット ファンド

期間	収益率(注)
2019年8月1日～2020年7月末日	0.31%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2020年7月末日の1口当り純資産価格 + 当該期間の分配金の合計額

b = 2019年7月末日の1口当り純資産価格

() カナダドル マネー マーケット ファンド

期間	収益率(注)
2019年8月1日～2020年7月末日	0.67%

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2020年7月末日の1口当り純資産価格 + 当該期間の分配金の合計額

b = 2019年7月末日の1口当り純資産価格

() NZドル マネー マーケット ファンド

期間	収益率(注)
2019年8月1日～2020年7月末日	0.47%

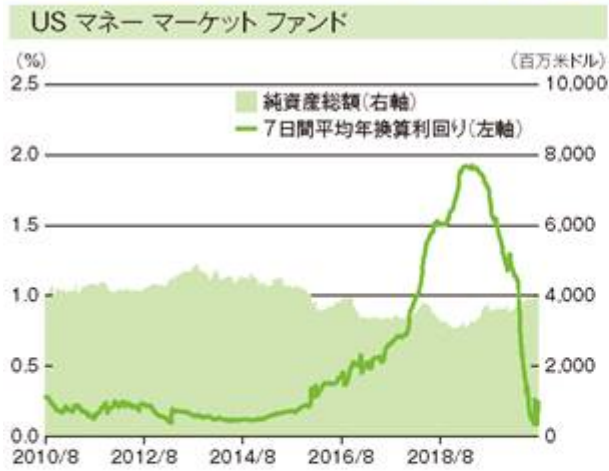
(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2020年7月末日の1口当り純資産価格 + 当該期間の分配金の合計額

b = 2019年7月末日の1口当り純資産価格

< 参考情報 >

純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移 (2020年7月末日現在)



※7日間平均年換算利回りは課税前です。

[次へ](#)

2 販売及び買戻しの実績

2020年7月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2020年7月末日現在の発行済口数は次のとおりです。

() US マネー マーケット ファンド

販売口数	買戻口数	発行済口数
380,471,531,733 (380,471,531,733)	320,888,378,962 (320,888,378,962)	411,651,089,072 (411,651,089,072)

(注) () の数は本邦内における販売・買戻および発行済口数です。

() 豪ドル マネー マーケット ファンド

販売口数	買戻口数	発行済口数
124,777,994,867 (124,777,994,867)	112,833,690,045 (112,833,690,045)	261,534,102,686 (261,534,102,686)

(注) () の数は本邦内における販売・買戻および発行済口数です。

() 英ポンド マネー マーケット ファンド

販売口数	買戻口数	発行済口数
2,514,691,683 (2,514,691,683)	3,128,898,028 (3,128,898,028)	5,015,126,827 (5,015,126,827)

(注) () の数は本邦内における販売・買戻および発行済口数です。

() カナダドル マネー マーケット ファンド

販売口数	買戻口数	発行済口数
1,553,152,449 (1,553,152,449)	1,580,927,596 (1,580,927,596)	10,056,207,038 (10,056,207,038)

(注) () の数は本邦内における販売・買戻および発行済口数です。

() NZドル マネー マーケット ファンド

販売口数	買戻口数	発行済口数
7,602,743,024 (7,602,743,024)	8,368,525,583 (8,368,525,583)	49,701,949,520 (49,701,949,520)

(注) () の数は本邦内における販売・買戻および発行済口数です。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものです。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものです。
- b. ファンドの中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていません。
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドル、豪ドル、英ポンド、カナダドルおよびニュージーランドドル（「NZドル」）で表示されています。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されています。日本円による金額は、以下の2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値で換算されています。

1 米ドル	=	104.60円
1 豪ドル	=	75.37円
1 英ポンド	=	137.21円
1 カナダドル	=	77.88円
1 NZドル	=	69.99円

なお、千円未満の金額は四捨五入されています。

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

ノムラ外貨MMF
結合純資産計算書
2020年6月30日現在

	US マネー マーケット ファンド		豪ドル マネー マーケットファンド		英ポンド マネー マーケットファンド	
	(米ドル)	(千円)	(豪ドル)	(千円)	(英ポンド)	(千円)
資産						
投資有価証券 - 時価 (注2)	3,379,479,749	353,493,582	2,272,866,221	171,305,927	32,692,159	4,485,691
銀行預金	1,947,897	203,750	26,848,692	2,023,586	100,372	13,772
預金	662,807,000	69,329,612	340,000,000	25,625,800	17,583,000	2,412,563
現金および現金等価物 に係る利息	2,653	278	749	56	16	2
設立費(注2)	54,587	5,710	41,184	3,104	1,027	141
資産合計	4,044,291,886	423,032,931	2,639,756,846	198,958,473	50,376,574	6,912,170
負債						
未払費用(注8)	4,920,439	514,678	1,476,885	111,313	75,341	10,338
受益者への未払分配金	1,154,625	120,774	567,231	42,752	24,813	3,405
負債合計	6,075,064	635,452	2,044,116	154,065	100,154	13,742
純資産	4,038,216,822	422,397,480	2,637,712,730	198,804,408	50,276,420	6,898,428
発行済受益証券数	403,821,682,235口		263,771,272,966口		5,027,641,957口	
1口当り純資産価格	0.01	1.046円	0.01	0.754円	0.01	1.372円
	カナダドル マネー マーケット ファンド		NZドル マネー マーケット ファンド		結合	
	(カナダドル)	(千円)	(NZドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
資産						
投資有価証券 - 時価 (注2)	75,969,557	5,916,509	416,719,228	29,166,179	5,305,161,577	554,919,901
銀行預金	4,867	379	782,415	54,761	21,028,683	2,199,600
預金	24,486,000	1,906,970	83,005,000	5,809,520	989,447,305	103,496,188
現金および現金等価物 に係る利息	64	5	231	16	3,383	354
設立費(注2)	1,807	141	8,814	617	91,144	9,534
資産合計	100,462,295	7,824,004	500,515,688	35,031,093	6,315,732,092	660,625,577
負債						
未払費用(注8)	102,220	7,961	384,721	26,927	6,350,507	664,263
受益者への未払分配金	51,017	3,973	142,773	9,993	1,704,178	178,257
負債合計	153,237	11,934	527,494	36,919	8,054,685	842,520
純資産	100,309,058	7,812,069	499,988,194	34,994,174	6,307,677,407	659,783,057
発行済受益証券数	10,030,905,829口		49,998,819,413口			
1口当り純資産価格	0.01	0.779円	0.01	0.700円		

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF
結合純資産変動計算書
2020年6月30日に終了した期間

	US マネー マーケット ファンド	豪ドル マネー マーケット ファンド	英ポンド マネー マーケット ファンド	カナダドル マネー マーケット ファンド	NZドル マネー マーケット ファンド	結合
	(米ドル)	(豪ドル)	(英ポンド)	(カナダドル)	(NZドル)	(米ドル)
期首現在純資産	3,551,671,818	2,558,509,354	55,904,912	99,609,425	498,483,286	5,796,615,381
純投資(損失)	(7,023,909)	(4,526,278)	(29,167)	(180,173)	(1,054,875)	(10,980,065)
当期実現純利益	26,330,841	11,124,135	129,724	660,681	2,432,399	36,182,141
当期末実現純(損失)	(6,819,262)	(2,498,812)	(29,542)	(199,560)	(332,901)	(8,932,929)
運用の結果による 純資産の増加	12,487,670	4,099,045	71,015	280,948	1,044,623	16,269,147
受益証券の発行手取金	2,233,537,600	535,594,530	9,218,550	8,490,219	42,729,460	2,646,663,821
受益証券の買戻支払額	(1,746,992,596)	(456,391,154)	(14,847,042)	(7,790,586)	(41,224,552)	(2,111,170,043)
受益証券取引による 受取/(支払)純額	486,545,004	79,203,376	(5,628,492)	699,633	1,504,908	535,493,778
受益者への支払分配金 (注10)	(12,487,670)	(4,099,045)	(71,015)	(280,948)	(1,044,623)	(16,269,147)
為替相場変動						(24,431,752)
期末現在純資産	4,038,216,822	2,637,712,730	50,276,420	100,309,058	499,988,194	6,307,677,407

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF
 結合発行済受益証券数変動表
 2020年6月30日に終了した期間

	US マネー マーケット ファンド	豪ドル マネー マーケット ファンド	英ポンド マネー マーケット ファンド	カナダドル マネー マーケット ファンド	NZドル マネー マーケット ファンド
期首現在発行済 受益証券数	355,167,181,803	255,850,935,444	5,590,491,157	9,960,942,514	49,848,328,636
発行受益証券数	223,353,760,044	53,559,452,946	921,854,955	849,021,932	4,272,945,934
買戻受益証券数	(174,699,259,612)	(45,639,115,424)	(1,484,704,155)	(779,058,617)	(4,122,455,157)
期末現在発行済 受益証券数	403,821,682,235	263,771,272,966	5,027,641,957	10,030,905,829	49,998,819,413

添付の注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

ノムラ外貨MMF
財務書類に対する注記
2020年6月30日に終了した期間

注1 - 組織

ノムラ外貨MMF(「トラスト」)は、ルクセンブルグ大公国の法律に基づいてルクセンブルグにおいて設定されたアンブレラ・ファンド型の契約型投資信託(*fonds commun de placement à compartiments multiples*)であり、ルクセンブルグ大公国の法律に基づいて設立された株式会社(*société anonyme*)でありルクセンブルグ大公国に登録上の事務所を有するグローバル・ファンズ・マネジメント・エス・エー(「管理会社」)によって、その共有者(「受益者」)の利益のために管理運用される、譲渡性のある証券およびその他の資産からなる非法人形態の共有体を構成する。トラストの資産は、管理会社の資産および管理会社によって管理運用されるその他の投資信託の資産から分別されている。

管理会社は、2013年7月12日のオルタナティブ投資ファンド運用会社に関する法律(改正済)(「2013年法」)の第1条第46項に定義されるオルタナティブ投資ファンド運用会社である。

トラストは、2010年12月17日の投資信託に関する法律(随時改正済)(「2010年法」)のパート に従いルクセンブルグ大公国で設定され、2013年法の第1条第39項に定義されるオルタナティブ投資ファンドとしての資格を有している。

トラストは、マネー・マーケット・ファンドに関する2017年6月14日付欧州議会および欧州理事会規則(EU)2017/1131(以下「MMF規則」という。)に定義されるマネー・マーケット・ファンド(以下「マネー・マーケット・ファンド」または「MMF」という。)としての資格を有している。

トラストは、US マネー マーケット ファンドの名称で1991年11月14日にメモリアル・セ・ルクイ・デ・ソシエテ・エ・アソシアシオン(「メモリアル」)に公告されたトラストの約款に準拠して管理会社により設立された。約款の改正は、公示されている。1999年6月1日付の改正により、トラストはアンブレラ・ファンドとして再編成された。2001年6月2日付の改正により、トラストはトラスト名をノムラ外貨MMFに変更した。統合約款は、ルクセンブルグ地方裁判所の記録部に提出されており、閲覧およびその写しを入手することができる。

トラストの存続期間は無期限である。トラストは、管理会社と保管受託銀行との合意により随時償還することができる。また、トラストは、ルクセンブルグの法律により求められる場合には償還される。

受益証券は、トラストのもとで5つのサブ・ファンド証券：ノムラ外貨MMF - US マネー マーケット ファンド、ノムラ外貨MMF - 豪ドル マネー マーケット ファンド、ノムラ外貨MMF - 英ポンド マネー マーケット ファンド、ノムラ外貨MMF - カナダドル マネー マーケット ファンドおよびノムラ外貨MMF - NZドル マネー マーケット ファンド(総称して、および個々を「ファンド」という。)が発行されている。管理会社は、保管受託銀行の同意のもとに、随時新しいファンドを設立することができる。トラストは、米ドル建てで結合財務書類を作成している。

ノムラ外貨MMF - US マネー マーケット ファンドの投資目的は、元本の確保と流動性の維持を図りつつ、短期金利の水準に沿った安定した収益を追求することである。ファンドは、主に、EU加盟国の地方自治体、政府もしくは中央銀行、または日本、アメリカ合衆国その他の経済協力開発機構(「OECD」)加盟国の政府その他の中央政府もしくは中央銀行によって単独または共同で発行または保証される、高い信用度と流動性を有する米ドル建ての公債短期金融商品への分散投資、および現金、預金への投資により、この投資目的の達成を目指す。

ファンドは、高い信用度と流動性を有する公債短期金融商品に十分に担保されたレポ契約およびリバースレポ契約を締結することができる。

ファンドは、1口当たりコンスタントNAV(一定の純資産価格)を0.01米ドルに維持するために最善を尽くすことをその基本方針としている。ファンドの会計帳簿および記録は米ドルで記帳されている。

ノムラ外貨MMF - 豪ドル マネー マーケット ファンドの投資目的は、元本の確保と流動性の維持を図りつつ、短期金利の水準に沿った安定した収益を追求することである。ファンドは、主に、EU加盟国の地方自治体、政府もしくは中央銀行、またはオーストラリアその他のOECD加盟国の政府その他の中央政府もしくは中央銀行によって単独または共同で発行または保証される、高い信用度と流動性を有する豪ドル建ての公債短期金融商品への分散投資、および現金、預金への投資により、この投資目的の達成を目指す。

ファンドは、高い信用度と流動性を有する公債短期金融商品に十分に担保されたレポ契約およびリバースレポ契約を締結することができる。

ファンドは、1口当たりコンスタントNAVを0.01豪ドルに維持するために最善を尽くすことをその基本方針としている。ファンドの会計帳簿および記録は豪ドルで記帳されている。

ノムラ外貨MMF - 英ポンド マネー マーケット ファンドの投資目的は、元本の確保と流動性の維持を図りつつ、短期金利の水準に沿った安定した収益を追求することである。ファンドは、主に、EU加盟国の地方自治体、政府もしくは中央銀行、または英国その他のOECD加盟国の政府その他の中央政府もしくは中央銀行によって単独または共同で発行また

は保証される、高い信用度と流動性を有する英ポンド建ての公債短期金融商品への分散投資、および現金、預金への投資により、この投資目的の達成を目指す。

ファンドは、高い信用度と流動性を有する公債短期金融商品に十分に担保されたレポ契約およびリバースレポ契約を締結することができる。

ファンドは、1口当たりコンスタントNAVを0.01英ポンドに維持するために最善を尽くすことをその基本方針としている。ファンドの会計帳簿および記録は英ポンドで記帳されている。

ノムラ外貨MMF - カナダドル マネー マーケット ファンドの投資目的は、元本の確保と流動性の維持を図りつつ、短期金利の水準に沿った安定した収益を追求することである。ファンドは、主に、EU加盟国の地方自治体、政府もしくは中央銀行、またはカナダその他のOECD加盟国の政府その他の中央政府もしくは中央銀行によって単独または共同で発行または保証される、高い信用度と流動性を有するカナダドル建ての公債短期金融商品への分散投資、および現金、預金への投資により、この投資目的の達成を目指す。

ファンドは、高い信用度と流動性を有する公債短期金融商品に十分に担保されたレポ契約およびリバースレポ契約を締結することができる。

ファンドは、1口当たりコンスタントNAVを0.01カナダドルに維持するために最善を尽くすことをその基本方針としている。ファンドの会計帳簿および記録はカナダドルで記帳されている。

ノムラ外貨MMF - NZドル マネー マーケット ファンドの投資目的は、元本の確保と流動性の維持を図りつつ、短期金利の水準に沿った安定した収益を追求することである。ファンドは、主に、EU加盟国の地方自治体、政府もしくは中央銀行、またはニュージーランドその他のOECD加盟国の政府その他の中央政府もしくは中央銀行によって単独または共同で発行または保証される、高い信用度と流動性を有するNZドル建ての公債短期金融商品への分散投資、および現金、預金への投資により、この投資目的の達成を目指す。

ファンドは、高い信用度と流動性を有する公債短期金融商品に十分に担保されたレポ契約およびリバースレポ契約を締結することができる。

ファンドは、1口当たりコンスタントNAVを0.01NZドルに維持するために最善を尽くすことをその基本方針としている。ファンドの会計帳簿および記録はNZドルで記帳されている。

注2 - 重要な会計方針

財務書類は、投資信託に関するルクセンブルグの法令上の要件に準拠して作成されており、以下の重要な会計方針が含まれている。

投資有価証券

各ファンドの資産は以下のとおり評価される。

(a) 短期金融商品(ならびに証券化商品およびABC P(資産担保コマーシャル・ペーパー))は償却原価法で評価される。

(b) 投資対象短期MMFの投資証券または受益証券は、これらの投資対象短期MMFによって報告されるその入手可能な最新の純資産価格で評価されるものとする。

(c) 手元現金、預金、手形および要求払約束手形、ならびに宣言または発生済みであるが未払いの売掛金、前払費用、現金配当および利息の価額は、それらの全額とみなされるものとする。ただし、全額の支払いまたは受領が見込まれない場合は除外されるものとし、除外される場合、かかる資産の価額は、管理会社がそれらの真の価額を反映するために適切と考える割引を行った後で決定されるものとする。

(d) 現金およびその他の流動資産は、額面額に経過利息を加え、評価される。

ファンドの組入証券は、時価評価またはMMF規則の許容する範囲において、モデル評価を使用して計算される1口当たり純資産価格とコンスタントNAVとの間の乖離(以下「本差額」という。)が存在するかを判定するため、管理会社により、または管理会社の指示により日々監視される。本差額は監視され、管理会社のウェブサイトにおいて日々公表される。本差額が重大な希薄化またはその他の不公正な結果を受益者にもたらす可能性があるとして判定された場合、管理会社は、必要かつ適切であると判断する是正措置を行う。これには、()売買益もしくは売買損を実現化させるため満期前の組入証券の売却または組入証券の平均満期を短くすること、分配の停止、または()時価評価またはMMF規則の許容する範囲において、モデル評価を使用して計算される1口当たり純資産価格に基づく発行および買戻価格の決定が含まれる。

証券取引および投資収益

証券取引は、取引日に会計処理される。投資有価証券売却実現損益は、平均原価法で算出される。受取利息は、発生主義により計上される。償却プレミアムおよび稼得割引額は、投資有価証券売却実現損益および投資有価証券未実現純評価損益の変動に含まれている。

外貨換算

各ファンドの表示通貨以外の通貨建の資産および負債は、財務書類の日付現在の実勢為替レートで換算される。各ファンドの表示通貨以外の通貨建の収益および費用は、取引日現在の実勢為替レートで換算されている。

結合財務書類を米ドルで作成するにあたり、米ドル以外の通貨建の各ファンドの財務書類は、期末現在の実勢為替レートで換算されている。

2020年6月30日現在の為替レート：

1米ドル	=	1.45518	豪ドル
1米ドル	=	1.36620	カナダドル
1米ドル	=	0.88956	ユーロ
1米ドル	=	0.80883	英ポンド
1米ドル	=	1.55642	NZドル

為替相場変動

前年度の為替を適用した期首現在の純資産額との差額は、結合純資産変動計算書において為替相場変動として表示されている。

設立費

設立費は、MMF規則を遵守するためのトラストの再編成に関連して発生している費用である。この費用は、5年間にわたり定額法で償却される。

注3 - 管理報酬

管理会社は、トラストの資産から年間15,000米ドルをトラストに対する管理報酬として受領する権利を有する。

注4 - 投資顧問報酬

US マネー マーケット ファンドの投資顧問会社には、各四半期末に当該四半期中のファンドの日次純資産の平均額のうち2億5,000万米ドルまでは年率0.150%、次の2億5,000万米ドルについては当該純資産の年率0.125%、次の15億米ドルについては当該純資産の年率0.100%および20億米ドル超については当該純資産の年率0.075%の報酬がファンドの資産から支払われる。

豪ドル マネー マーケット ファンドの投資顧問会社には、各四半期末に当該四半期中のファンドの日次純資産の平均額のうち4億豪ドルまでは年率0.150%、次の4億豪ドルについては当該純資産の年率0.125%、次の24億豪ドルについては当該純資産の年率0.100%および32億豪ドル超については当該純資産の年率0.075%の報酬がファンドの資産から支払われる。

英ポンド マネー マーケット ファンドの投資顧問会社には、各四半期末に当該四半期中のファンドの日次純資産の平均額のうち1億5,000万英ポンドまでは年率0.150%、次の1億5,000万英ポンドについては当該純資産の年率0.125%、次の9億英ポンドについては当該純資産の年率0.100%および12億英ポンド超については当該純資産の年率0.075%の報酬がファンドの資産から支払われる。

カナダドル マネー マーケット ファンドの投資顧問会社には、各四半期末に当該四半期中のファンドの日次純資産の平均額のうち4億カナダドルまでは年率0.150%、次の4億カナダドルについては当該純資産の年率0.125%、次の24億カナダドルについては当該純資産の年率0.100%および32億カナダドル超については当該純資産の年率0.075%の報酬がファンドの資産から支払われる。

NZドル マネー マーケット ファンドの投資顧問会社には、各四半期末に当該四半期中のファンドの日次純資産の平均額のうち4億NZドルまでは年率0.150%、次の4億NZドルについては当該純資産の年率0.125%、次の24億NZドルについては当該純資産の年率0.100%および32億NZドル超については当該純資産の年率0.075%の報酬がファンドの資産から支払われる。

以下の年間報酬率は2008年12月19日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアベンディックスに定義される0.30%未満になった場合に、レター・アグリーメントのアベンディックスに規定された下記の段階的な引下げが行われる。

7日間平均利回り	投資顧問報酬
0.30%未満となった場合	0.075%
0.20%未満となった場合	0.055%
0.10%未満となった場合	0.035%
再度0.10%未満となった場合	0.015%
再度0.10%未満となった場合	0.000%

以下の年間報酬率は2010年10月27日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアペンディックスに定義される0.230%を超えた場合に、レター・アグリーメントのアペンディックスに規定された下記の段階的な引上げが行われる。

<u>7日間平均利回り</u>	<u>投資顧問報酬</u>
0.230%超となった場合	0.015%
0.250%超となった場合	0.035%
0.350%超となった場合	0.055%
0.450%超となった場合	0.075%
0.525%超となった場合	最大0.150%

ファンドの状況に応じて、引下げおよび引上げのプロセスが適用される。

2020年6月30日現在、実際に適用されていた年率は、NZドル マネー マーケット ファンドに関して0.055%、英ポンド マネー マーケット ファンドに関して0.000%、US マネー マーケット ファンド、豪ドル マネー マーケット ファンドおよびカナダドル マネー マーケット ファンドに関して0.015%であった。

注5 - 保管報酬

保管受託銀行は、各ファンド資産から、関連するファンドの日々の純資産総額の平均額の年率0.040%以下の保管報酬を各四半期末毎に受領する権利を有する。管理会社に支払うべき報酬に相当する金額(年間15,000米ドル)は、保管報酬から差し引かれる。保管受託銀行が負担したすべての合理的な立替費用(電話、テレックス、電報および郵便費用を含むがそれらに限定されない。)、ならびにファンド資産の保管が委託される銀行および他の金融機関の保管料は、ファンドが負担する。

以下の年間報酬率は2008年12月23日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアペンディックスに定義される0.30%未満になった場合に、レター・アグリーメントのアペンディックスに規定された下記の段階的な引下げが行われる。

<u>7日間平均利回り</u>	<u>保管報酬</u>
0.30%未満となった場合	0.032%
0.20%未満となった場合	0.024%
0.10%未満となった場合	0.016%
再度0.10%未満となった場合	0.008%
再度0.10%未満となった場合	0.000%

以下の年間報酬率は2010年10月27日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアベンディックスに定義される0.230%を超えた場合に、レター・アグリーメントのアベンディックスに規定された下記の段階的な引上げが行われる。

7日間平均利回り	保管報酬
0.230%超となった場合	0.008%
0.250%超となった場合	0.016%
0.350%超となった場合	0.024%
0.450%超となった場合	0.032%
0.525%超となった場合	0.040%

ファンドの状況に応じて、引下げおよび引上げのプロセスが適用される。

2020年6月30日現在、実際に適用されていた年率は、NZドル マネー マーケット ファンドに関して0.024%、英ポンド マネー マーケット ファンドに関して0.000%、US マネー マーケット ファンド、豪ドル マネー マーケット ファンドおよびカナダドル マネー マーケット ファンドに関して0.008%であった。

注6 - 代行協会員報酬

日本における代行協会員は、各ファンドの純資産からファンドの日々の純資産の平均額の年率0.10%以下の報酬を受領する権利を有し、その報酬は毎月支払われる。

以下の年間報酬率は2008年12月19日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアベンディックスに定義される0.30%未満になった場合に、レター・アグリーメントのアベンディックスに規定された下記の段階的な引下げが行われる。

7日間平均利回り	代行協会員報酬
販売会社報酬を0.250%に引下げた後に0.30%未満となった場合	0.079%
0.20%未満となった場合	0.058%
0.10%未満となった場合	0.037%
再度0.10%未満となった場合	0.016%
再度0.10%未満となった場合	0.000%

以下の年間報酬率は2010年10月27日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアベンディックスに定義される0.230%を超えた場合に、レター・アグリーメントのアベンディックスに規定された下記の段階的な引上げが行われる。

7日間平均利回り	代行協会員報酬
0.230%超となった場合	0.016%
0.250%超となった場合	0.037%
0.350%超となった場合	0.058%
0.450%超となった場合	0.079%
0.525%超となった場合	0.100%

ファンドの状況に応じて、引下げおよび引上げのプロセスが適用される。

2020年6月30日現在、実際に適用されていた年率は、NZドル マネー マーケット ファンドに関して0.058%、英ポンド マネー マーケット ファンドに関して0.000%、US マネー マーケット ファンド、豪ドル マネー マーケット ファンドおよびカナダドル マネー マーケット ファンドに関して0.016%であった。

注7 - 販売会社報酬

日本における販売会社は、その販売会社により当該月中に販売され、買戻されなかった各ファンドの日々の純資産総額の平均額の年率0.40%以下の報酬を当該ファンドの資産から受領する権利を有し、その報酬は毎月支払われる。

以下の年間報酬率は2008年12月18日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアペンディックスに定義される0.45%未満になった場合に、レター・アグリーメントのアペンディックスに規定された下記の段階的な引下げが行われる。

7日間平均利回り	販売会社報酬
0.45%未満となった場合	0.350%
0.40%未満となった場合	0.300%
0.35%未満となった場合	0.250%
0.30%未満となった場合	0.198%
0.20%未満となった場合	0.146%
0.10%未満となった場合	0.094%
再度0.10%未満となった場合	0.042%
再度0.10%未満となった場合	0.000%

以下の年間報酬率は2010年10月27日から実施され、ファンドの7日間平均利回りがレター・アグリーメントのアペンディックスに定義される0.230%を超えた場合に、レター・アグリーメントのアペンディックスに規定された下記の段階的な引上げが行われる。

7日間平均利回り	販売会社報酬
0.230%超となった場合	0.042%
0.250%超となった場合	0.094%
0.350%超となった場合	0.146%
0.450%超となった場合	0.198%
0.525%超となった場合	0.250%
再度0.525%超となった場合	0.300%
再度0.525%超となった場合	0.350%
0.575%超となった場合	0.400%

ファンドの状況に応じて、引下げおよび引上げのプロセスが適用される。

2020年6月30日現在、NZドルマネーマーケットファンドに関して0.146%、英ポンドマネーマーケットファンドに関して0.000%、USマネーマーケットファンド、豪ドルマネーマーケットファンドおよびカナダドルマネーマーケットファンドに関して0.042%であった。

注8 - 未払費用

ノムラ外貨 MMF -	US マネー マーケット ファンド (米ドル)	豪ドル マネー マーケット ファンド (豪ドル)	英ポンド マネー マーケット ファンド (英ポンド)	カナダドル マネー マーケット ファンド (カナダドル)	NZドル マネー マーケット ファンド (NZドル)	結合 (米ドル)
管理報酬および 投資顧問報酬	739,710	475,429	3,184	19,628	144,460	1,177,545
販売会社報酬およ び代行協会員報酬	705,235	428,796	1,625	9,145	124,724	1,088,742
保管報酬	319,583	176,972	1,466	6,670	44,306	476,359
コルレス銀行報酬	0	93,886	0	8,085	23,121	85,292
海外登録費用	71,545	104,670	0	0	17,304	154,592
現金支出費	48,627	33,000	643	1,252	6,254	77,034
専門家報酬	0	78,807	0	0	11,524	61,560
年次税	114,232	85,325	1,725	2,915	13,028	185,504
その他の費用	2,921,507	0	66,698	54,525	0	3,043,879
	4,920,439	1,476,885	75,341	102,220	384,721	6,350,507

注9 - 受益証券の発行および買戻し

発行および買戻しの申し込みは、全てのファンドで各取引日にファンドに対して行うことができる。

注10 - 分配金の分配および再投資

管理会社は、受益証券の1口当り純資産価格を、US マネー マーケット ファンドについては0.01米ドル、豪ドル マネー マーケット ファンドについては0.01豪ドル、英ポンド マネー マーケット ファンドについては0.01英ポンド、カナダドル マネー マーケット ファンドについては0.01カナダドルおよびNZドル マネー マーケット ファンドについては0.01NZドルに維持するために必要な額を分配金として日々分配を行う予定である。

毎月、最終取引日（「再投資日」）において、宣言済、計上済で未払いのすべての分配金は、再投資日の直前の取引日に決定される1口当り純資産価格で自動的に再投資され、追加受益証券が発行される。

分配の結果、ファンドの純資産総額が2010年法で規定されている最低額を下回る場合、分配は行われない。

注11 - 税金

トラストは、ルクセンブルグの法令に従って課税される。ルクセンブルグの現行法規に従い、ファンドはその純資産に対し年率0.01%の資本税（年次税（*taxe d'abonnement*））を課され、四半期毎に計算し支払う。

注12 - 重要事象

2020年初頭以降、新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の流行が世界経済や金融市場に悪影響を与え、大きな変動を引き起こしている。

COVID-19の流行がトラストの投資先の財務実績に与える影響は、流行の続く期間や拡大、ならびに関連する勧告や制限を含む今後の展開次第である。これらの展開とCOVID-19が金融市場および経済全体に及ぼす影響は、不確実性が高く、予測することはできない。金融市場および/または経済全体への影響が長期に及ぶ場合、トラストの将来の投資成果は重大な悪影響を受ける可能性がある。

このような状況の中、管理会社は、ウイルス拡大の抑制に向けた各国政府の取り組みを継続的に注視しており、トラストのパフォーマンスに与える潜在的な経済的影響をモニターしている。

トラストは、投資方針および目論見書に従った通常の運用を継続することができる十分な能力がある。ファンドの未監査の純資産価額は日次で入手可能である。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

ノムラ外貨MMF - US マネー マーケット ファンド

投資有価証券明細表

2020年6月30日現在

(米ドル(USD)で表示)

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券					
フィンランド					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
USD	60,000,000	MUNICIPALITY FINANCE CP 29/09/20	59,964,755	59,965,520	1.49
USD	47,000,000	MUNICIPALITY FINANCE CP 09/09/20	46,973,590	46,979,906	1.16
USD	46,000,000	MUNICIPALITY FINANCE CP 14/07/20	45,923,384	45,989,055	1.14
USD	45,000,000	MUNICIPALITY FINANCE CP 01/07/20	44,882,010	45,000,000	1.11
			197,743,739	197,934,481	4.90
		フィンランド合計	197,743,739	197,934,481	4.90
フランス					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
USD	94,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 14/09/20	93,873,573	93,923,531	2.34
USD	92,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 26/10/20	91,894,551	91,919,363	2.28
USD	65,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 31/07/20	64,977,258	64,989,170	1.62
USD	56,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 30/11/20	55,928,097	55,928,567	1.38
USD	52,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 28/09/20	51,956,703	51,969,172	1.29
USD	50,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 30/09/20	49,896,091	49,938,198	1.24
USD	48,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 17/07/20	47,940,015	47,989,453	1.19
USD	47,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 13/07/20	46,975,007	46,995,083	1.16
USD	47,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 19/08/20	46,972,391	46,985,295	1.16
USD	47,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 23/09/20	46,956,930	46,971,513	1.16
USD	47,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 17/08/20	46,922,083	46,969,983	1.16
USD	47,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 11/08/20	46,850,664	46,959,982	1.16
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 03/07/20	45,900,797	45,997,820	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 06/07/20	45,918,749	45,995,536	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 03/08/20	45,980,995	45,989,884	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 15/07/20	45,924,312	45,988,356	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/07/20	45,955,857	45,987,388	1.14
USD	46,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 27/07/20	45,954,696	45,987,056	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/07/20	45,946,013	45,985,068	1.14
USD	46,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 26/08/20	45,974,152	45,984,267	1.14
USD	46,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 26/08/20	45,974,152	45,984,267	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 02/09/20	45,961,826	45,973,859	1.14
USD	46,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 23/09/20	45,958,841	45,972,118	1.14
USD	46,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 27/08/20	45,933,065	45,968,727	1.14
USD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/07/20	45,835,806	45,965,572	1.14
USD	46,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 28/09/20	45,915,541	45,951,189	1.14
USD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 06/07/20	44,991,002	44,998,594	1.11
USD	45,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 18/08/20	44,972,417	44,985,609	1.11
USD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 31/07/20	44,946,588	44,982,583	1.11
USD	45,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 02/09/20	44,973,566	44,981,898	1.11
USD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 13/08/20	44,956,802	44,979,809	1.11
USD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 18/08/20	44,961,049	44,979,678	1.11
USD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/08/20	44,965,182	44,978,428	1.11
USD	45,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 14/09/20	44,958,526	44,974,711	1.11
USD	45,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 18/09/20	44,958,526	44,973,362	1.11

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券(続き)					
フランス(続き)					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー(続き)					
USD	45,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 23/09/20	44,959,087	44,972,725	1.11
USD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 28/08/20	44,931,479	44,967,425	1.11
USD	42,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 30/10/20	41,958,338	41,958,679	1.04
USD	30,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 16/11/20	29,957,710	29,962,104	0.74
			1,900,768,437	1,901,966,022	47.09
フランス合計			1,900,768,437	1,901,966,022	47.09
ドイツ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
USD	55,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 24/08/20	54,966,990	54,981,037	1.36
USD	52,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 03/08/20	51,981,503	51,989,994	1.29
USD	52,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 14/08/20	51,969,454	51,985,391	1.29
USD	52,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 23/09/20	51,966,438	51,969,686	1.29
USD	52,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 24/09/20	51,966,799	51,969,325	1.29
USD	47,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 09/07/20	46,916,983	46,992,702	1.16
USD	47,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 24/09/20	46,970,591	46,972,829	1.16
USD	47,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 11/08/20	46,868,534	46,964,770	1.16
USD	46,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 06/07/20	45,923,384	45,995,790	1.14
USD	46,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 06/07/20	45,888,593	45,994,136	1.14
USD	46,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 27/07/20	45,985,974	45,994,022	1.14
USD	46,000,000	LANDWIRTSCHAFT RENTENBK CP 26/08/20	45,974,622	45,984,553	1.14
USD	46,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 17/07/20	45,856,718	45,981,209	1.14
USD	45,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 29/07/20	44,984,374	44,992,827	1.11
USD	45,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 03/08/20	44,982,956	44,990,928	1.11
USD	45,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 18/08/20	44,972,417	44,985,609	1.11
USD	45,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 09/09/20	44,972,417	44,979,013	1.11
USD	42,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 28/09/20	41,976,435	41,977,688	1.04
			855,125,182	855,701,509	21.18
ドイツ合計			855,125,182	855,701,509	21.18
オランダ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
USD	93,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 16/07/20	92,753,564	92,969,700	2.31
USD	92,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 09/07/20	91,835,181	91,985,510	2.29
USD	55,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 13/07/20	54,856,619	54,986,012	1.37
USD	47,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 09/07/20	46,846,007	46,989,902	1.16
USD	46,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 27/07/20	45,958,758	45,988,217	1.14
USD	46,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 20/08/20	45,924,518	45,969,065	1.14
USD	45,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 13/07/20	44,891,530	44,989,331	1.11
			423,066,177	423,877,737	10.52
オランダ合計			423,066,177	423,877,737	10.52
他の規制ある市場で取引されている 譲渡性のある証券合計			3,376,703,535	3,379,479,749	83.69
投資有価証券合計			3,376,703,535	3,379,479,749	83.69

(1) 額面価額は証券の原通貨で表示される。

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF - US マネー マーケット ファンド

投資有価証券の業種別および地域別分布表

2020年6月30日現在

業種別および地域別	純資産に占める割合(%)
フィンランド	
金融	4.90
	4.90
フランス	
金融	47.09
	47.09
ドイツ	
金融	21.18
	21.18
オランダ	
金融	10.52
	10.52
投資合計	83.69

ノムラ外貨MMF - 豪ドル マネー マーケット ファンド

投資有価証券明細表

2020年6月30日現在

(豪ドル(AUD)で表示)

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券					
フランス					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
AUD	98,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 15/07/20	97,854,458	97,977,853	3.70
AUD	96,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 20/08/20	95,860,310	95,942,750	3.63
AUD	95,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 28/08/20	94,986,768	94,986,992	3.60
AUD	94,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 30/10/20	93,923,609	93,924,235	3.56
AUD	58,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 23/09/20	57,958,085	57,972,277	2.20
AUD	49,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 14/09/20	48,945,149	48,966,554	1.86
AUD	49,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 16/10/20	48,945,594	48,952,283	1.86
AUD	49,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 07/10/20	48,912,691	48,944,076	1.86
AUD	48,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 08/07/20	47,949,699	47,996,131	1.82
AUD	48,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 20/07/20	47,951,152	47,989,801	1.82
AUD	48,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 27/08/20	47,944,757	47,974,190	1.82
AUD	46,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/08/20	45,969,350	45,981,010	1.74
AUD	45,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 31/07/20	44,957,490	44,986,138	1.71
AUD	39,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/07/20	38,972,416	38,992,119	1.48
AUD	38,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 21/07/20	37,961,617	37,991,564	1.44
AUD	35,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 24/11/20	34,954,319	34,956,409	1.33
AUD	30,000,000	CAISSE DEPOTS ET CONS CP 27/07/20	29,969,947	29,991,775	1.14
AUD	29,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/07/20	28,972,766	28,992,467	1.10
			992,990,177	993,518,624	37.67
		フランス合計	992,990,177	993,518,624	37.67
ドイツ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
AUD	70,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 29/10/20	69,954,957	69,955,696	2.64
AUD	68,000,000	KFW CP 29/10/20	67,961,998	67,962,621	2.58
AUD	67,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 01/09/20	66,966,424	66,978,087	2.54
AUD	67,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 18/09/20	66,950,819	66,968,412	2.54
AUD	57,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 24/08/20	56,977,684	56,987,180	2.16
AUD	56,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 03/09/20	55,965,674	55,976,121	2.12
AUD	55,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 19/11/20	54,943,957	54,948,353	2.08
AUD	50,000,000	LANDWIRTSCHAFT RENTENBK CP 28/09/20	49,968,249	49,977,394	1.89
AUD	50,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 16/10/20	49,952,601	49,958,428	1.89
AUD	49,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 14/07/20	48,931,971	48,990,282	1.86
AUD	49,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 15/07/20	48,789,109	48,983,778	1.86
AUD	49,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 17/07/20	48,797,706	48,982,216	1.86
AUD	49,000,000	KFW CP 27/07/20	48,803,127	48,972,331	1.86
AUD	48,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 18/08/20	47,976,705	47,987,846	1.82
AUD	48,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 23/09/20	47,966,424	47,977,616	1.82
AUD	48,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 31/07/20	47,876,499	47,969,878	1.82
AUD	48,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 26/10/20	47,965,585	47,967,263	1.82
AUD	48,000,000	KFW CP 11/08/20	47,852,554	47,960,488	1.82

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券(続き)					
ドイツ(続き)					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー(続き)					
AUD	48,000,000	KFW CP 11/09/20	47,825,834	47,931,848	1.82
AUD	47,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 27/07/20	46,988,853	46,995,249	1.78
AUD	47,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 26/10/20	46,964,411	46,966,420	1.78
AUD	30,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 26/08/20	29,987,738	29,992,536	1.14
AUD	29,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 21/07/20	28,881,729	28,987,003	1.10
AUD	27,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 06/07/20	26,938,222	26,996,782	1.02
AUD	27,000,000	FMS WERTMANAGEMENT CP 02/09/20	26,983,450	26,988,667	1.02
			1,229,172,280	1,230,362,495	46.64
		ドイツ合計	1,229,172,280	1,230,362,495	46.64
オランダ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
AUD	49,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 13/07/20	48,847,291	48,985,102	1.86
			48,847,291	48,985,102	1.86
		オランダ合計	48,847,291	48,985,102	1.86
		他の規制ある市場で取引されている 譲渡性のある証券合計	2,271,009,748	2,272,866,221	86.17
		投資有価証券合計	2,271,009,748	2,272,866,221	86.17

(1) 額面価額は証券の原通貨で表示される。

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF - 豪ドル マネー マーケット ファンド

投資有価証券の業種別および地域別分布表

2020年6月30日現在

業種別および地域別	純資産に占める割合 (%)
フランス	
金融	37.67
	<hr/>
	37.67
ドイツ	
金融	46.64
	<hr/>
	46.64
オランダ	
金融	1.86
	<hr/>
	1.86
投資合計	86.17
	<hr/>
	86.17

ノムラ外貨MMF - 英ポンド マネー マーケット ファンド

投資有価証券明細表

2020年6月30日現在

（英ポンド（GBP）で表示）

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
公認の証券取引所への上場を認可された譲渡性のある証券					
イギリス					
短期国債					
GBP	3,000,000	UK T-BILL 0% 20/07/20	2,998,728	2,999,734	5.97
GBP	3,000,000	UK T-BILL 0% 17/08/20	2,999,177	2,999,575	5.96
GBP	3,000,000	UK T-BILL 0% 14/09/20	2,998,965	2,999,384	5.96
GBP	3,000,000	UK T-BILL 0% 07/12/20	2,999,103	2,999,216	5.96
GBP	2,626,000	UK T-BILL 0% 27/07/20	2,622,926	2,625,482	5.22
GBP	2,000,000	UK T-BILL 0% 13/07/20	1,999,137	1,999,885	3.98
GBP	2,000,000	UK T-BILL 0% 06/07/20	1,994,399	1,999,817	3.98
GBP	2,000,000	UK T-BILL 0% 24/08/20	1,999,556	1,999,734	3.98
GBP	2,000,000	UK T-BILL 0% 14/12/20	1,999,452	1,999,500	3.98
GBP	2,000,000	UK T-BILL 0% 28/09/20	1,997,808	1,998,928	3.98
GBP	2,000,000	UK T-BILL 0% 03/08/20	1,993,341	1,998,793	3.98
GBP	861,000	UK T-BILL 0% 16/11/20	860,314	860,480	1.71
GBP	212,000	UK T-BILL 0% 12/10/20	211,727	211,845	0.42
			27,674,633	27,692,373	55.08
		イギリス合計	27,674,633	27,692,373	55.08
		公認の証券取引所への上場を認可された譲渡性のある証券合計	27,674,633	27,692,373	55.08
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券					
フィンランド					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
GBP	5,000,000	MUNICIPALITY FINANCE CP 07/07/20	4,996,761	4,999,786	9.94
			4,996,761	4,999,786	9.94
		フィンランド合計	4,996,761	4,999,786	9.94
		他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券合計	4,996,761	4,999,786	9.94
		投資有価証券合計	32,671,394	32,692,159	65.02

(1) 額面価額は証券の原通貨で表示される。

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF - 英ポンド マネー マーケット ファンド

投資有価証券の業種別および地域別分布表

2020年6月30日現在

業種別および地域別	純資産に占める割合 (%)
フィンランド	
金融	9.94
	<hr/>
	9.94
イギリス	
中央、州、地方政府	55.08
	<hr/>
	55.08
投資合計	<hr/> <hr/>
	65.02

ノムラ外貨MMF - カナダドル マネー マーケット ファンド

投資有価証券明細表

2020年6月30日現在

(カナダドル(CAD)で表示)

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
公認の証券取引所への上場を認可された譲渡性のある証券					
カナダ					
短期国債					
CAD	10,000,000	CANADA T-BILL 0% 06/08/20	9,992,500	9,997,356	9.98
CAD	9,000,000	CANADA T-BILL 0% 22/10/20	8,992,550	8,993,778	8.97
CAD	5,000,000	CANADA T-BILL 0% 16/07/20	4,997,900	4,999,564	4.98
CAD	5,000,000	CANADA T-BILL 0% 13/08/20	4,996,750	4,998,429	4.98
CAD	5,000,000	CANADA T-BILL 0% 10/09/20	4,997,950	4,998,222	4.98
CAD	5,000,000	CANADA T-BILL 0% 03/09/20	4,996,100	4,997,737	4.98
CAD	5,000,000	CANADA T-BILL 0% 01/10/20	4,997,400	4,997,533	4.98
CAD	5,000,000	CANADA T-BILL 0% 29/10/20	4,994,400	4,995,600	4.98
CAD	3,000,000	CANADA T-BILL 0% 20/08/20	2,997,300	2,998,907	2.99
CAD	3,000,000	CANADA T-BILL 0% 17/09/20	2,996,460	2,998,184	2.99
			54,959,310	54,975,310	54.81
		カナダ合計	54,959,310	54,975,310	54.81
		公認の証券取引所への上場を認可された譲渡性のある証券合計	54,959,310	54,975,310	54.81
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券					
ドイツ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
CAD	11,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 05/08/20	10,996,273	10,997,801	10.96
CAD	10,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 02/09/20	9,994,892	9,996,446	9.97
			20,991,165	20,994,247	20.93
		ドイツ合計	20,991,165	20,994,247	20.93
		他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券合計	20,991,165	20,994,247	20.93
		投資有価証券合計	75,950,475	75,969,557	75.74

(1) 額面価額は証券の原通貨で表示される。

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF - カナダドル マネー マーケット ファンド

投資有価証券の業種別および地域別分布表

2020年6月30日現在

業種別および地域別	純資産に占める割合 (%)
カナダ	
中央、州、地方政府	54.81
	<hr/>
	54.81
ドイツ	
金融	20.93
	<hr/>
	20.93
投資合計	<hr/>
	75.74
	<hr/>

ノムラ外貨MMF - NZドル マネー マーケット ファンド

投資有価証券明細表

2020年6月30日現在

(NZドル(NZD)で表示)

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券					
フランス					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
NZD	24,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 15/07/20	23,982,241	23,995,989	4.80
NZD	21,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 30/10/20	20,971,502	20,971,735	4.19
NZD	20,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 27/07/20	19,964,175	19,990,195	4.00
NZD	20,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 23/09/20	19,960,055	19,972,941	3.99
NZD	19,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 13/07/20	18,923,046	18,992,431	3.80
NZD	19,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 20/07/20	18,962,612	18,992,194	3.80
NZD	19,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 11/08/20	18,971,395	18,987,252	3.80
NZD	18,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 28/08/20	17,961,044	17,981,480	3.60
NZD	18,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 28/09/20	17,949,651	17,970,712	3.59
NZD	17,000,000	AGENCE CENT ORGANISMES CP 08/09/20	16,964,356	16,980,166	3.40
			194,610,077	194,835,095	38.97
		フランス合計	194,610,077	194,835,095	38.97
ドイツ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
NZD	24,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 30/11/20	23,964,121	23,964,587	4.78
NZD	19,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 10/07/20	18,930,075	18,994,842	3.80
NZD	17,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 13/07/20	16,986,920	16,997,509	3.40
NZD	15,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 15/07/20	14,992,254	14,998,251	3.00
NZD	15,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 17/07/20	14,976,150	14,995,807	3.00
NZD	15,000,000	KFW CP 08/09/20	14,983,788	14,988,225	3.00
NZD	14,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 06/07/20	13,969,632	13,998,331	2.80
NZD	10,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 23/09/20	9,989,677	9,990,676	2.00
NZD	10,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 16/09/20	9,988,513	9,990,386	2.00
NZD	9,000,000	KFW CP 03/07/20	8,976,176	8,999,476	1.80
NZD	9,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 30/07/20	8,972,937	8,993,567	1.80
NZD	9,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 30/09/20	8,993,105	8,993,180	1.80
NZD	9,000,000	LANDESKREDBK BAD WURTT CP 28/09/20	8,992,486	8,992,886	1.80
			174,715,834	174,897,723	34.98
		ドイツ合計	174,715,834	174,897,723	34.98

通貨	額面価額 ⁽¹⁾	銘柄	取得価額	時価	純資産に占める割合(%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券 (続き)					
オランダ					
ユーロ・コマーシャル・ペーパー					
NZD	19,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 15/07/20	18,960,698	18,993,954	3.80
NZD	14,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 06/07/20	13,957,666	13,998,265	2.80
NZD	14,000,000	NEDERLAND WATERSCHAP CP 13/07/20	13,940,463	13,994,191	2.80
			46,858,827	46,986,410	9.40
		オランダ合計	46,858,827	46,986,410	9.40
		他の規制ある市場で取引されている 譲渡性のある証券合計	416,184,738	416,719,228	83.35
		投資有価証券合計	416,184,738	416,719,228	83.35

(1) 額面価額は証券の原通貨で表示される。

添付の注記は当財務書類の一部である。

ノムラ外貨MMF - NZドル マネー マーケット ファンド

投資有価証券の業種別および地域別分布表

2020年6月30日現在

業種別および地域別	純資産に占める割合(%)
フランス	
金融	38.97
	<hr/>
	38.97
ドイツ	
金融	34.98
	<hr/>
	34.98
オランダ	
金融	9.40
	<hr/>
	9.40
投資合計	83.35
	<hr/> <hr/>

[次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額

払込済資本金は375,000ユーロ(約4,655万円)で、2020年7月末日現在全額払込済です。なお、1株25,000ユーロ(約310万円)の記名式株式15株を発行済です。

(注)ユーロの円貨換算は、2020年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=124.13円)によります。

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社(その単独株主はノムラ・バンク・ルクセンブルクS.A.)は1991年7月8日付公正証書(1991年8月16日に官報である「メモリアル」に公告)によりルクセンブルグ大公国の法律に基づき株式会社として設立されました。管理会社の定款(直近では2017年11月16日に改訂済)は、ルクセンブルグの商業および法人登録所(同所にて、閲覧および写しの入手が可能)に預託されています。管理会社は期間を無期限として設立されました。その登記上の事務所および本店は、ルクセンブルグ大公国 エスペランジュ ガスペリッシュ通り33番 A棟です。管理会社は、商業登記簿を登録第B 37 359号としてルクセンブルグの商業および法人登録所に登録しています。

管理会社は、()2010年12月17日の投資信託に関するルクセンブルグ法(改正済)(以下「2010年法」といいます。)第15章に定義される管理会社として、および()2013年7月12日のオルタナティブ投資ファンド運用会社に関するルクセンブルグ法(改正済)(以下「2013年法」といいます。)第1条第46項に定義されるオルタナティブ投資ファンド運用会社(以下「AIFM」といいます。)として、認可されています。

管理会社の主な目的は、以下のとおりです。

- ・2010年法第101条第2項および同法別紙 に基づき、EU指令2009/65/ECに従い認可されルクセンブルグ国内外において設立された譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託(以下「UCITS」といいます。)の管理、およびEU指令2009/65/ECに従い認可されていないルクセンブルグ国内外において設立された投資信託(以下「UCI」といいます。)の付加的な管理を行うこと
- ・ルクセンブルグ国内外において設立された、オルタナティブ投資ファンド運用会社に関する2011年6月8日付欧州議会および理事会指令2011/61/EU(以下「AIFMD」といいます。)に定義されるオルタナティブ投資ファンド(以下「AIF」といいます。)に関し、2013年法第5条第2項および同法別紙 に基づくAIFの資産に関する運用、管理、販売およびその他の業務を行うこと

なお、管理会社は、(a)顧客ごとのポートフォリオの一任運用、(b)投資助言、(c)投資信託の受益証券の保管および管理または(d)2013年法第5条第4項に企図される金融商品に関する注文の受理および送信のサービスを提供しません。

管理会社はまた、自らが業務(所在地および管理支援サービスを含みます。)を行うUCITS、UCIおよびAIFの子会社に対して上記の運用、管理および販売業務を行うこともできます。

管理会社は、業務の無償提供および/または支店開設を通じ、ルクセンブルグ国外において許可を受けた活動を行うこともできます。

管理会社は、2010年法および2013年法の定める範囲内であれば、これらにより認められる最大限の範囲まで、その目的の達成に直接もしくは間接的に関連し、ならびに/またはこれに有益および/もしくは必要とみなされるあらゆることを実行することができます。

管理会社は、ファンドの運用およびファンド証券の発行、買戻し等のファンドの管理を行います。管理会社は投資顧問業務をノムラ・アセット・マネジメント・UK・リミテッドに委託しており、また、ファンド資産の保管業務、純資産価格の計算その他の管理業務をノムラ・バンク・ルクセンブルクS.A.に委託しています。

管理会社は、2020年6月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っており、その管理投資信託財産額は約1.1兆円です。

なお、すべてのファンドは、契約型オープン・エンド型です。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	MMF	2	4,433,641,146.29米ドル
		2	2,768,047,072.35豪ドル
		1	100,309,058.29カナダドル
		2	528,359,874.61NZドル
		1	50,276,419.57英ポンド
ルクセンブルグ	その他	14	871,442,440.44米ドル
		6	142,546,639.42ユーロ
		15	119,443,615,407円
		8	420,231,243.69豪ドル
		3	4,303,048.33カナダドル
		4	137,124,683.90NZドル
		2	1,909,711.34英ポンド
		1	40,375,445.41メキシコ・ペソ
		1	211,632,384.23トルコ・リラ
ケイマン	その他	7	415,218,060.77米ドル
		2	104,572,350.44ユーロ
		3	379,113,906.04豪ドル
		3	110,851,315.75NZドル

(注) 外貨の円貨換算は、2020年6月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=107.74円、1ユーロ=121.08円、1豪ドル=73.88円、1英ポンド=132.51円、1カナダドル=78.80円、1NZドル=69.09円、1メキシコ・ペソ=4.67円および1トルコ・リラ=15.76円)によります。

(3) その他

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実および与えることが予想される事実はありません。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

下線部または傍線部分は訂正箇所を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

3 投資リスク

参考情報

<訂正前>

ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

US マネー マーケット ファンド



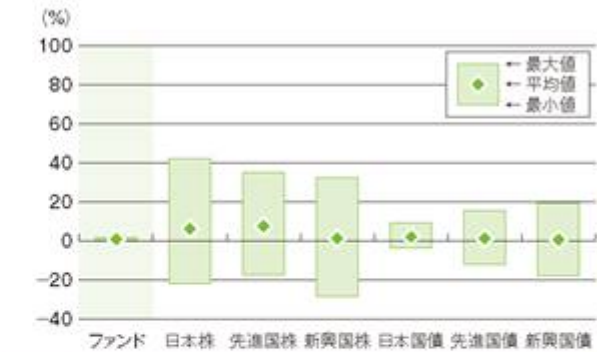
- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年5月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨である米ドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

豪ドル マネー マーケット ファンド



- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年5月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨である豪ドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

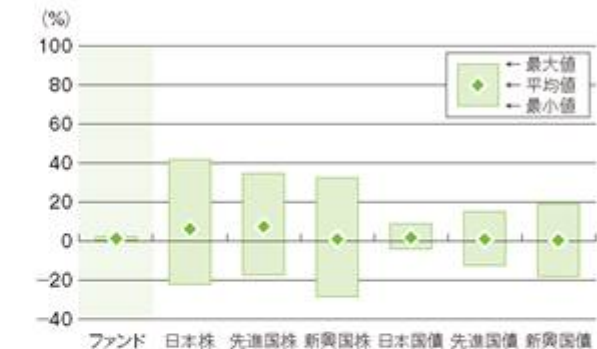
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	1.80	41.9	34.8	32.3	9.1	15.3	19.2
最小値(%)	0.14	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	0.83	6.1	7.4	1.1	1.9	1.1	0.5

出所: Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	2.03	41.9	34.8	32.3	9.1	15.3	19.2
最小値(%)	0.57	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	1.36	6.1	7.4	1.1	1.9	1.1	0.5

出所: Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

英ポンド マネー マーケット ファンド



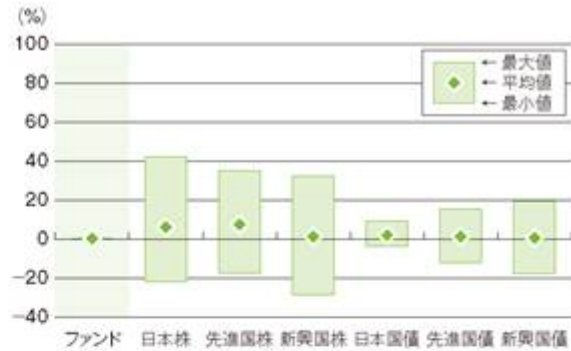
- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年5月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨である英ポンド建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

カナダドル マネー マーケット ファンド



- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年5月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨であるカナダドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

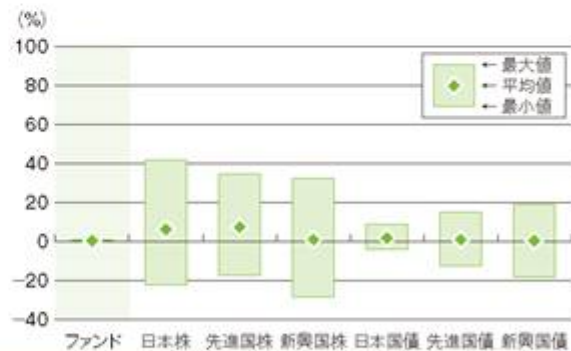
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	0.42	41.9	34.8	32.3	9.1	15.3	19.2
最小値(%)	0.14	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	0.26	6.1	7.4	1.1	1.9	1.1	0.5

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	0.93	41.9	34.8	32.3	9.1	15.3	19.2
最小値(%)	0.27	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	0.52	6.1	7.4	1.1	1.9	1.1	0.5

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

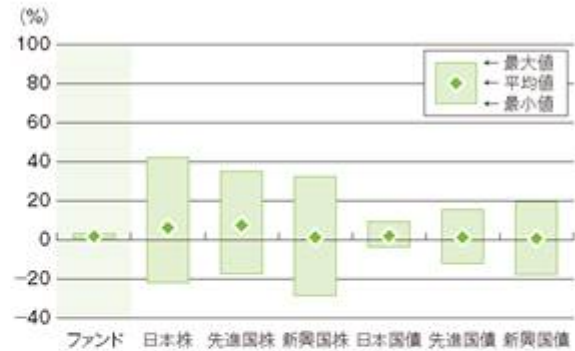
ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

NZドル マネー マーケット ファンド



- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年5月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨であるNZドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	3.04	41.9	34.8	32.3	9.1	15.3	19.2
最小値(%)	0.68	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	1.72	6.1	7.4	1.1	1.9	1.1	0.5

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年5月～2020年4月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

(後略)

<訂正後>

ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

US マネー マーケット ファンド



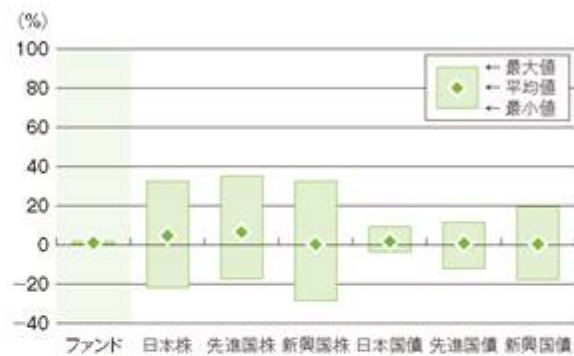
- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年8月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨である米ドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

豪ドル マネー マーケット ファンド



- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年8月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨である豪ドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	1.80	32.2	34.8	32.3	9.1	11.4	19.2
最小値(%)	0.15	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	0.88	4.4	6.4	0.2	1.7	0.7	0.3

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	1.92	32.2	34.8	32.3	9.1	11.4	19.2
最小値(%)	0.36	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	1.28	4.4	6.4	0.2	1.7	0.7	0.3

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

英ポンド マネー マーケット ファンド



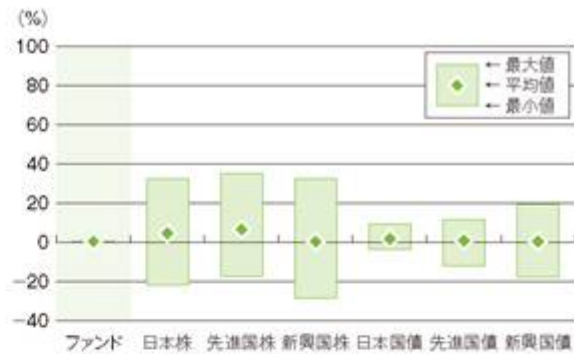
- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年8月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨である英ポンド建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

カナダドル マネー マーケット ファンド



- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年8月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨であるカナダドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

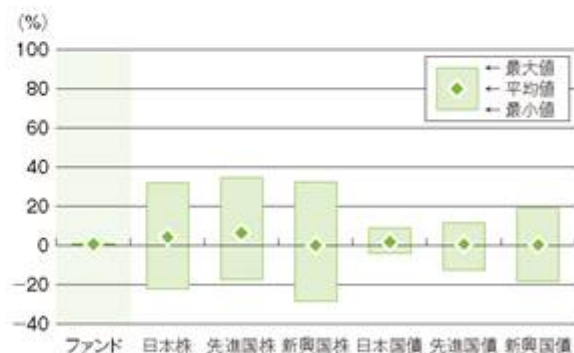
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	0.42	32.2	34.8	32.3	9.1	11.4	19.2
最小値(%)	0.14	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	0.27	4.4	6.4	0.2	1.7	0.7	0.3

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	0.93	32.2	34.8	32.3	9.1	11.4	19.2
最小値(%)	0.27	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	0.53	4.4	6.4	0.2	1.7	0.7	0.3

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

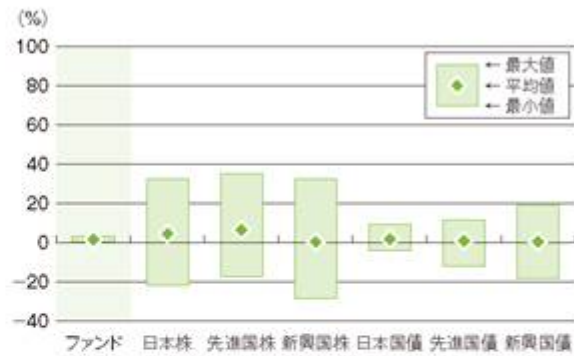
ファンドの分配金再投資純資産価格・年間騰落率の推移

NZドル マネー マーケット ファンド



- 分配金再投資純資産価格は、税引前の分配金を再投資したとみなして算出したもので、2015年8月末を100として指数化しております。
- 年間騰落率は、2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における分配金再投資純資産価格を比較して算出したものです。
- 年間騰落率は、表示通貨であるNZドル建てで計算されています。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	3.00	32.2	34.8	32.3	9.1	11.4	19.2
最小値(%)	0.47	-22.0	-17.5	-28.6	-3.9	-12.3	-18.1
平均値(%)	1.60	4.4	6.4	0.2	1.7	0.7	0.3

出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

- 2015年8月～2020年7月の5年間の各月末時点とその1年前における数値を比較して算出した年間騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- このグラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

(後略)

4 手数料等及び税金

(3) 管理報酬等

<訂正前>

(前略)

なお、一部の報酬率は金利水準により引き下げられる場合があります。

2020年4月末現在の報酬率は以下の通りです。

ただし、今後の金利水準に応じて、変動する可能性があります。

投資顧問報酬	<US マネー マーケット ファンド> 2億5,000万米ドルまでの部分 2億5,000万米ドル超5億米ドルまでの部分 5億米ドル超20億米ドルまでの部分 20億米ドル超の部分 <豪ドル マネー マーケット ファンド> <英ポンド マネー マーケット ファンド> <カナダドル マネー マーケット ファンド> <NZドル マネー マーケット ファンド> 4億NZドルまでの部分 4億NZドル超8億NZドルまでの部分 8億NZドル超32億NZドルまでの部分 32億NZドル超の部分	年率0.150% 年率0.125% 年率0.100% 年率0.075% 年率0.075% 年率0.035% 年率0.075% 年率0.150% 年率0.125% 年率0.100% 年率0.075%
保管報酬および管理事務代行報酬	US マネー マーケット ファンド 豪ドル マネー マーケット ファンド 英ポンド マネー マーケット ファンド カナダドル マネー マーケット ファンド NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.040% 年率0.032% 年率0.016% 年率0.032% 年率0.040%
代行協会員報酬	US マネー マーケット ファンド 豪ドル マネー マーケット ファンド 英ポンド マネー マーケット ファンド カナダドル マネー マーケット ファンド NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.100% 年率0.079% 年率0.037% 年率0.079% 年率0.100%
販売会社報酬	US マネー マーケット ファンド 豪ドル マネー マーケット ファンド 英ポンド マネー マーケット ファンド カナダドル マネー マーケット ファンド NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.350% 年率0.198% 年率0.094% 年率0.198% 年率0.250%

<訂正後>

(前略)

なお、一部の報酬率は金利水準により引き下げられる場合があります。

2020年7月末現在の報酬率は以下の通りです。

ただし、今後の金利水準に応じて、変動する可能性があります。

投資顧問報酬	US マネー マーケット ファンド 豪ドル マネー マーケット ファンド 英ポンド マネー マーケット ファンド カナダドル マネー マーケット ファンド NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.000% 年率0.015% 年率0.000% 年率0.000% 年率0.000%
保管報酬および管理事務代行報酬	US マネー マーケット ファンド 豪ドル マネー マーケット ファンド 英ポンド マネー マーケット ファンド カナダドル マネー マーケット ファンド NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.000% 年率0.008% 年率0.000% 年率0.000% 年率0.000%
代行協会員報酬	US マネー マーケット ファンド 豪ドル マネー マーケット ファンド 英ポンド マネー マーケット ファンド カナダドル マネー マーケット ファンド NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.000% 年率0.016% 年率0.000% 年率0.000% 年率0.000%

販売会社報酬	US マネー マーケット ファンド	年率0.000%
	豪ドル マネー マーケット ファンド	年率0.042%
	英ポンド マネー マーケット ファンド	年率0.000%
	カナダドル マネー マーケット ファンド	年率0.000%
	NZドル マネー マーケット ファンド	年率0.000%