

# 野村インデックスファンド・ 新興国債券・為替ヘッジ型

## 愛称：Funds-i 新興国債券・為替ヘッジ型

### 運用報告書(全体版)

第13期（決算日2023年9月6日）

作成対象期間（2022年9月7日～2023年9月6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/海外/債券/インデックス型	
信託期間	2010年11月26日以降、無期限とします。	
運用方針	新興国債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	野村インデックス ファンド・新興国債券・ 為替ヘッジ型 マザーファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。 新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村インデックス ファンド・新興国債券・ 為替ヘッジ型 マザーファンド	株式への直接投資は行いません。株式への投資は転換社債を転換したもの等に限り、信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
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、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。	

### 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/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・ インデックス・プラス(円ヘッジベース)		債 組 入 比 率	券 先 物 比 率	純 資 産 額	
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率				
	円		円		%	%	%	百万円	
9期(2019年9月6日)	13,198		0		9.6	140.68	9.6	98.8	2,496
10期(2020年9月7日)	13,781		0		4.4	147.08	4.6	98.3	1,417
11期(2021年9月6日)	13,826		0		0.3	149.06	1.3	98.1	1,337
12期(2022年9月6日)	9,737		0		△29.6	105.20	△29.4	98.8	928
13期(2023年9月6日)	9,565		0		△1.8	104.55	△0.6	99.8	966

\*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。

*ベンチマーク (=JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジベース)) は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社がヘッジコストを考慮して算出したものです。なお、指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。(設定時を100として指数化しています。)
*JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus) は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建てのプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・ インデックス・プラス(円ヘッジベース)		債 組 入 比 率	券 先 物 比 率
	騰 落	率	騰 落	率		
(期首) 2022年9月6日	円	%		%	%	%
	9,737	—	105.20	—	98.8	—
9月末	9,098	△6.6	98.30	△6.6	98.3	—
10月末	9,163	△5.9	99.12	△5.8	98.3	—
11月末	9,778	0.4	105.96	0.7	97.5	—
12月末	9,777	0.4	106.03	0.8	96.1	—
2023年1月末	10,042	3.1	109.05	3.7	98.0	—
2月末	9,674	△0.6	105.28	0.1	98.2	—
3月末	9,719	△0.2	105.94	0.7	98.9	—
4月末	9,720	△0.2	105.83	0.6	98.1	—
5月末	9,573	△1.7	104.48	△0.7	98.3	—
6月末	9,719	△0.2	106.12	0.9	99.0	—
7月末	9,846	1.1	107.57	2.3	98.5	—
8月末	9,659	△0.8	105.64	0.4	97.7	—
(期末) 2023年9月6日	9,565	△1.8	104.55	△0.6	99.8	—

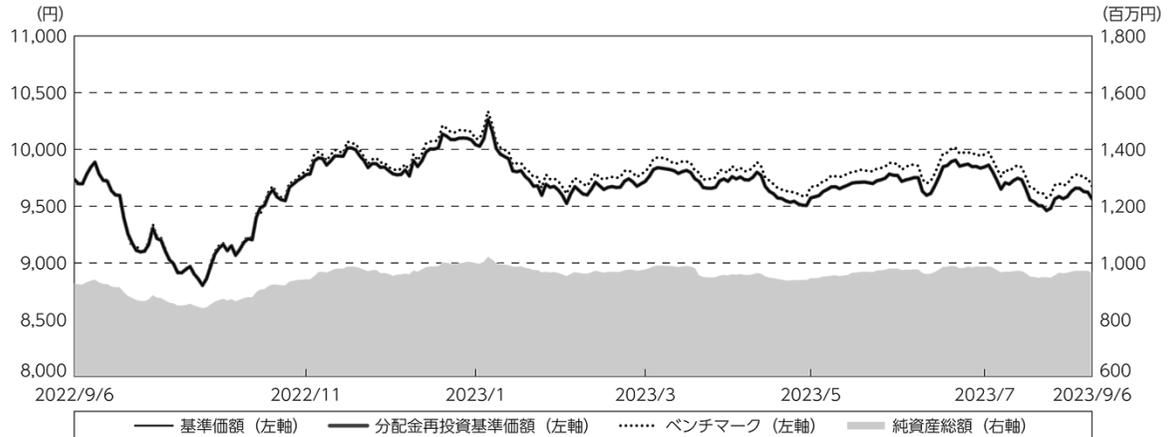
\*騰落率は期首比です。

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

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：9,737円

期 末：9,565円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 1.8% (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9月6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) ベンチマークは、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジベース)です。ベンチマークは、作成期首(2022年9月6日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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

新興国債券(米ドル建て)利回りが上昇(価格は下落)したことはマイナスに影響しましたが、利金収入などから債券リターンはプラスとなりました。しかし、ヘッジコスト等の影響により基準価額は下落しました。

## ○投資環境

インフレの長期化懸念に伴うFRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げ実施、金融引き締め期間の長期化観測などを背景に、米国債利回りは上昇（価格は下落）しました。

また、中国においてゼロコロナ政策の緩和に伴う経済活動の正常化や、政府による景気刺激策への期待が高まったことなどを背景に市場のリスク選好姿勢が強まり、新興国債券（米ドル建て）の対米国債スプレッド（利回り格差）は、縮小しました。

当運用期間では、米国債利回りが上昇したことから、新興国債券利回りは上昇しました。利金収入などから、債券部分のリターンはプラスとなりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型]

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）の中長期的な動きを概ね捉えるために、新興国債券マザーファンドへ投資するとともに、実質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した。マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### [新興国債券マザーファンド]

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行なっておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-1.8%となり、ベンチマークの-0.6%を1.2ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

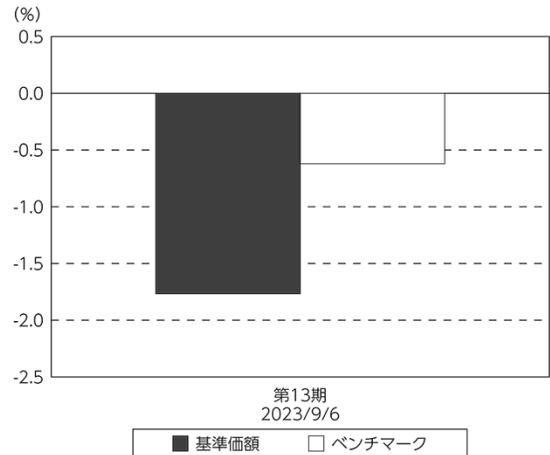
### (マイナス要因)

コスト負担（当ファンドの信託報酬や、債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、JP モルガン・エマーGING・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）です。

## ◎分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準等を勘案し見送らせていただきました。
- (2) 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13期
	2022年9月7日～ 2023年9月6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	7,737

(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

### 【野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型】

引き続き、新興国債券マザーファンドの組入比率を高位に保ち、実質外貨建資産については原則として為替ヘッジを行なうことで、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

### 【新興国債券マザーファンド】

引き続き、新興国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

\*本書に含まれるJP モルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JP モルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行なっている可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくはは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの責任又は義務を負いません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JP モルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、[index.research@jpmorgan.com](mailto:index.research@jpmorgan.com)宛にお願いします。当情報に関する追加の情報は、[www.morgankmarkets.com](http://www.morgankmarkets.com)もご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年9月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 64	% 0.660	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(30)	(0.308)	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 )	(30)	(0.308)	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 )	(0.044)	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	1	0.008	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	( 0 )	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
( 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
( そ の 他 )	( 0 )	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	65	0.668	
期中の平均基準価額は、9,647円です。			

\* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

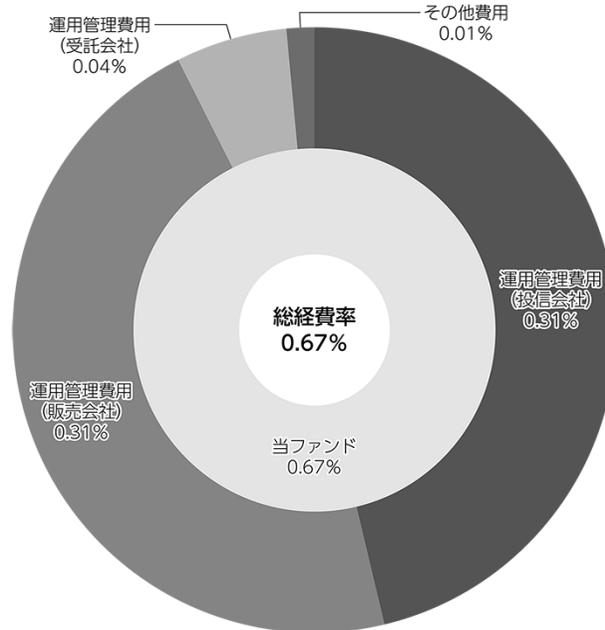
\* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 各比率は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)

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.67%です。



(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、売買委託手数料およ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) 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ます。

(注) 当ファンドのその他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託事務の処理に要するその他の諸費用等が含まれます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2022年9月7日～2023年9月6日)

## 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
新興国債券マザーファンド	千口 219,170	千円 425,500	千口 240,224	千円 475,500

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年9月7日～2023年9月6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

(2023年9月6日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
新興国債券マザーファンド	千口 479,508	千口 458,454	千円 980,863

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新興国債券マザーファンド	千円 980,863	% 98.7
コール・ローン等、その他	12,538	1.3
投資信託財産総額	993,401	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*新興国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(35,409,066千円)の投資信託財産総額(35,953,759千円)に対する比率は98.5%です。

\*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=147.86円、1ユーロ=158.46円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,932,280,043
コール・ローン等	12,537,998
新興国債券マザーファンド(評価額)	980,863,004
未収入金	938,879,041
(B) 負債	965,968,942
未払金	961,694,858
未払解約金	1,046,104
未払信託報酬	3,217,294
未払利息	23
その他未払費用	10,663
(C) 純資産総額(A-B)	966,311,101
元本	1,010,257,921
次期繰越損益金	△ 43,946,820
(D) 受益権総口数	1,010,257,921口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,565円

(注) 期首元本額は953,396,123円、期中追加設定元本額は241,537,799円、期中一部解約元本額は184,676,001円、1口当たり純資産額は0.9565円です。

## ○損益の状況 (2022年9月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,113
受取利息	1
支払利息	△ 6,114
(B) 有価証券売買損益	△ 10,880,831
売買益	326,821,369
売買損	△337,702,200
(C) 信託報酬等	△ 6,314,618
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 17,201,562
(E) 前期繰越損益金	△210,120,269
(F) 追加信託差損益金	183,375,011
(配当等相当額)	( 514,023,399)
(売買損益相当額)	(△330,648,805)
(G) 計(D+E+F)	△ 43,946,820
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 43,946,820
追加信託差損益金	183,375,011
(配当等相当額)	( 514,493,399)
(売買損益相当額)	(△331,118,388)
分配準備積立金	267,187,892
繰越損益金	△494,509,723

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

\*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2022年9月7日～2023年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年9月7日～ 2023年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	43,759,641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	514,493,399円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	223,428,251円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	781,681,291円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,737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。

# 新興国債券マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日2023年5月10日）

作成対象期間（2022年5月11日～2023年5月10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	JP モルガン・エマーGING・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

### 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		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	円	騰落率					
11期(2019年5月10日)	18,539	5.7	194.17	5.8	98.4	—	19,915
12期(2020年5月11日)	18,255	△ 1.5	188.37	△ 3.0	97.9	—	20,577
13期(2021年5月10日)	20,286	11.1	209.94	11.5	98.4	—	22,196
14期(2022年5月10日)	18,593	△ 8.3	190.84	△ 9.1	98.0	—	21,184
15期(2023年5月10日)	19,483	4.8	200.74	5.2	98.5	—	30,723

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (US\$ベース) をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。

\*JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus) は、J.P. Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建てのプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

(出所) J.P. Morgan Securities LLC、ブルームバーグ

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率				
(期首) 2022年5月10日	18,593	—	190.84	—	98.0	—
5月末	19,062	2.5	195.93	2.7	98.1	—
6月末	18,805	1.1	193.44	1.4	97.6	—
7月末	19,073	2.6	196.60	3.0	97.5	—
8月末	19,553	5.2	200.40	5.0	98.0	—
9月末	18,827	1.3	193.51	1.4	97.6	—
10月末	19,492	4.8	200.43	5.0	97.6	—
11月末	19,583	5.3	201.40	5.5	97.7	—
12月末	18,795	1.1	193.44	1.4	97.5	—
2023年1月末	19,094	2.7	196.48	3.0	97.5	—
2月末	19,309	3.9	198.91	4.2	98.2	—
3月末	19,101	2.7	196.97	3.2	98.2	—
4月末	19,277	3.7	198.48	4.0	98.7	—
(期末) 2023年5月10日	19,483	4.8	200.74	5.2	98.5	—

\*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



(注) ベンチマークは、JP モルガン・エマーGING・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース) です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新興国債券 (米ドル建て) 利回りが上昇 (価格は下落) したことはマイナスに影響しましたが、利金収入などから債券リターンがプラスとなったことや、米ドルが対円で上昇 (円安) したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

JP モルガン・エマーGING・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース) の中長期的な動きを概ね捉えるため、地域構成、満期構成、デュレーション (金利感応度)、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値 (地域構成や平均デュレーションなど) を指数に合わせるようにリバランス (投資比率の再調整) を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ (為替の売り予約) は行なっておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

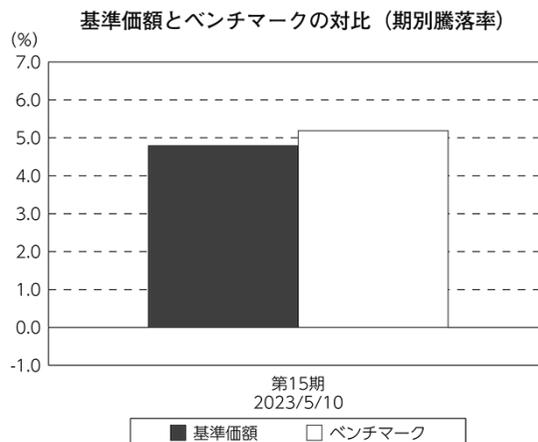
当運用期間の基準価額の騰落率は+4.8%となり、ベンチマークであるJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の+5.2%を0.4ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること。

### （その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること。



（注）ベンチマークは、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、新興国債券（米ドル建て）の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしく申し上げます。

\*本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行っている可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。ジェー・ビー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ビー・モルガン・チェアーズ・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ビー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。当情報に関して追加に必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。当情報の著作権は、ジェー・ビー・モルガン・チェアーズ・アンド・カンパニーに帰属します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年5月11日～2023年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(1)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
( そ の 他 )	(1)	(0.007)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、19,164円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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。

## ○売買及び取引の状況

(2022年5月11日～2023年5月10日)

## 公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 226,547	千米ドル 153,204

\*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。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年5月11日～2023年5月10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

(2023年5月10日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	287,364	223,951	30,267,004	98.5	38.5	83.1	10.1	5.4
合 計	287,364	223,951	30,267,004	98.5	38.5	83.1	10.1	5.4

\*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\*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。

\*S&amp;Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末						償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
アメリカ	%	千米ドル	千米ドル	千円			
国債証券							
ABU DHABI GOVT INT'L	2.125	2,100	2,028	274,106	2024/9/30		
ABU DHABI GOVT INT'L	2.5	1,200	1,160	156,895	2025/4/16		
ABU DHABI GOVT INT'L	1.625	1,200	1,075	145,378	2028/6/2		
ABU DHABI GOVT INT'L	2.5	1,600	1,476	199,524	2029/9/30		
ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	2,400	2,289	309,468	2030/4/16		
ABU DHABI GOVT INT'L	1.7	400	341	46,204	2031/3/2		
ABU DHABI GOVT INT'L	1.875	400	342	46,263	2031/9/15		
ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	1,800	1,349	182,440	2049/9/30		
ABU DHABI GOVT INT'L	3.875	3,300	2,818	380,896	2050/4/16		
ABU DHABI GOVT INT'L	2.7	800	496	67,079	2070/9/2		
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	7.6003	2,100	1,270	171,679	2029/3/1		
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	7.625	2,200	1,218	164,646	2032/5/29		
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	8.7002	1,400	732	99,051	2049/3/1		
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	8.875	3,200	1,663	224,838	2050/5/29		
CHINA GOVT INTL BOND	1.95	1,400	1,355	183,147	2024/12/3		
CHINA GOVT INTL BOND	0.55	2,400	2,203	297,823	2025/10/21		
CHINA GOVT INTL BOND	1.25	1,600	1,461	197,567	2026/10/26		
CHINA GOVT INTL BOND	2.125	1,400	1,289	174,307	2029/12/3		
CHINA GOVT INTL BOND	1.2	1,500	1,265	171,049	2030/10/21		
DOMINICAN REPUBLIC	5.5	1,800	1,714	231,726	2029/2/22		
DOMINICAN REPUBLIC	4.5	1,700	1,506	203,610	2030/1/30		
DOMINICAN REPUBLIC	4.875	1,500	1,295	175,152	2032/9/23		
DOMINICAN REPUBLIC	6.0	2,600	2,424	327,729	2033/2/22		
DOMINICAN REPUBLIC	5.3	900	712	96,289	2041/1/21		
DOMINICAN REPUBLIC	6.4	2,300	1,932	261,132	2049/6/5		
DOMINICAN REPUBLIC	5.875	2,000	1,522	205,700	2060/1/30		

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	EGYPT TASKEEK COMPANY	10.875	1,000	825	111,575	2026/2/28
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.875	1,500	1,439	194,509	2025/6/6
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.5	1,500	1,427	192,862	2029/5/30
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.875	3,700	3,304	446,620	2030/6/12
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.75	1,000	864	116,776	2031/9/12
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.0	2,200	2,152	290,923	2033/10/20
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.75	3,400	2,490	336,602	2050/1/14
	HUNGARY	6.125	1,000	1,041	140,793	2028/5/22
	HUNGARY	5.25	1,700	1,695	229,146	2029/6/16
	HUNGARY	2.125	1,400	1,098	148,421	2031/9/22
	HUNGARY	6.25	2,200	2,293	309,966	2032/9/22
	HUNGARY	3.125	1,800	1,121	151,575	2051/9/21
	MEXICO GLOBAL	3.75	1,700	1,113	150,461	2071/4/19
	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.0	3,300	3,375	456,262	2029/8/1
	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.25	2,300	2,380	321,697	2031/1/25
	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	4.4	1,000	1,006	136,049	2027/6/6
	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	4.7	1,500	1,529	206,706	2032/6/6
	REPUBLIC OF ARGENTINA	1.0	3,975	1,020	137,883	2029/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	0.5	4,165	1,093	147,821	2030/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	1.5	10,237	2,467	333,500	2035/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	3.875	6,286	1,891	255,585	2038/1/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	3.5	3,800	1,035	139,922	2041/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	1.5	1,000	245	33,237	2046/7/9
	REPUBLIC OF CHILE	2.75	1,200	1,137	153,730	2027/1/31
	REPUBLIC OF CHILE	2.45	1,400	1,230	166,369	2031/1/31
	REPUBLIC OF CHILE	2.55	1,100	955	129,199	2032/1/27
	REPUBLIC OF CHILE	2.55	1,100	918	124,113	2033/7/27
	REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,800	1,617	218,594	2034/1/31
	REPUBLIC OF CHILE	3.1	1,200	914	123,620	2041/5/7
	REPUBLIC OF CHILE	4.34	2,700	2,422	327,428	2042/3/7
	REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,600	1,204	162,818	2050/1/25
	REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,700	1,265	171,097	2053/4/15
	REPUBLIC OF CHILE	3.1	1,200	782	105,813	2061/1/22
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4.5	1,900	1,657	223,996	2029/3/15
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.0	1,800	1,383	186,961	2030/1/30
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.125	2,100	1,565	211,585	2031/4/15
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.25	1,600	1,160	156,782	2032/4/22
	REPUBLIC OF COLOMBIA	8.0	1,700	1,695	229,085	2033/4/20
	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.5	1,200	1,149	155,335	2034/2/2
	REPUBLIC OF COLOMBIA	5.2	2,600	1,739	235,037	2049/5/15
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4.125	1,500	875	118,364	2051/5/15
	REPUBLIC OF ECUADOR	5.5	3,400	1,886	254,907	2030/7/31
	REPUBLIC OF ECUADOR	2.5	7,500	3,000	405,500	2035/7/31
	REPUBLIC OF ECUADOR	1.5	2,600	936	126,500	2040/7/31
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.85	1,600	1,540	208,190	2030/10/15
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.2	2,300	2,008	271,444	2050/10/15
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.05	800	594	80,409	2051/3/12

銘柄	当	期	末			償還年月日	
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
国債証券	REPUBLIC OF NIGERIA	7.375	1,300	880	119,033	2033/9/28	
	REPUBLIC OF PANAMA	3.16	1,200	1,055	142,639	2030/1/23	
	REPUBLIC OF PANAMA	2.252	1,500	1,151	155,594	2032/9/29	
	REPUBLIC OF PANAMA	6.4	2,400	2,510	339,298	2035/2/14	
	REPUBLIC OF PANAMA	4.5	3,200	2,374	320,978	2056/4/1	
	REPUBLIC OF PANAMA	3.87	1,200	781	105,676	2060/7/23	
	REPUBLIC OF PANAMA	4.5	1,900	1,365	184,486	2063/1/19	
	REPUBLIC OF PERU	2.783	3,000	2,580	348,801	2031/1/23	
	REPUBLIC OF PERU	3.0	2,200	1,823	246,440	2034/1/15	
	REPUBLIC OF PERU	3.55	1,800	1,324	178,960	2051/3/10	
	REPUBLIC OF PERU	2.78	1,500	891	120,496	2060/12/1	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.75	1,600	1,551	209,718	2029/1/14	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	2.65	900	622	84,065	2045/12/10	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.2	2,300	1,732	234,179	2046/7/6	
	REPUBLIC OF POLAND	5.5	1,500	1,577	213,176	2027/11/16	
	REPUBLIC OF POLAND	5.75	1,200	1,305	176,398	2032/11/16	
	REPUBLIC OF POLAND	4.875	2,200	2,244	303,321	2033/10/4	
	REPUBLIC OF POLAND	5.5	2,300	2,375	321,065	2053/4/4	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.85	1,700	1,520	205,488	2029/9/30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.75	2,000	1,415	191,283	2049/9/30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.3	2,200	1,849	250,015	2052/4/20	
	REPUBLIC OF SRI LANKA	—	600	203	27,545	2027/5/11	
	REPUBLIC OF TURKEY	6.35	2,100	2,046	276,648	2024/8/10	
	REPUBLIC OF TURKEY	5.6	1,500	1,434	193,861	2024/11/14	
	REPUBLIC OF TURKEY	4.25	1,500	1,383	187,001	2025/3/13	
	REPUBLIC OF TURKEY	6.375	2,800	2,643	357,232	2025/10/14	
	REPUBLIC OF TURKEY	4.75	2,000	1,807	244,302	2026/1/26	
	REPUBLIC OF TURKEY	8.6	1,400	1,388	187,673	2027/9/24	
	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	3,300	3,385	457,524	2028/1/15	
	REPUBLIC OF TURKEY	9.375	400	401	54,315	2029/3/14	
	REPUBLIC OF TURKEY	7.625	1,300	1,228	166,017	2029/4/26	
	REPUBLIC OF TURKEY	5.25	1,000	824	111,451	2030/3/13	
	REPUBLIC OF TURKEY	9.125	1,200	1,191	161,095	2030/7/13	
	REPUBLIC OF TURKEY	5.95	1,100	922	124,677	2031/1/15	
	REPUBLIC OF TURKEY	5.875	600	499	67,531	2031/6/26	
	REPUBLIC OF TURKEY	9.375	2,100	2,112	285,483	2033/1/19	
	REPUBLIC OF TURKEY	6.5	500	422	57,097	2033/9/20	
	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4.375	2,000	2,009	271,644	2031/1/23	
	ROMANIA	7.125	1,500	1,610	217,672	2033/1/17	
	ROMANIA	4.0	1,500	1,043	141,091	2051/2/14	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.9	2,100	2,034	274,997	2025/10/22	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.75	1,700	1,736	234,677	2028/1/18	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.375	4,100	4,131	558,377	2029/4/16	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.25	2,800	2,615	353,434	2030/10/22	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.5	2,400	2,594	350,623	2032/10/25	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.25	1,200	997	134,799	2033/2/2	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.875	500	514	69,584	2033/7/18	

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.25	1,300	1,275	172,382	2050/1/16
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.0	2,700	2,528	341,699	2053/1/18
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.75	900	689	93,242	2055/1/21
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.5	1,800	1,581	213,712	2060/4/22
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.45	900	642	86,797	2061/2/2
	STATE OF QATAR	3.375	1,400	1,381	186,674	2024/3/14
	STATE OF QATAR	3.4	1,400	1,373	185,692	2025/4/16
	STATE OF QATAR	4.0	3,500	3,513	474,843	2029/3/14
	STATE OF QATAR	3.75	1,800	1,775	240,010	2030/4/16
	STATE OF QATAR	4.817	4,200	4,113	555,908	2049/3/14
	STATE OF QATAR	4.4	3,700	3,424	462,800	2050/4/16
	UAE INT'L GOVT BOND	4.05	1,800	1,803	243,761	2032/7/7
	UAE INT'L GOVT BOND	3.25	1,000	744	100,633	2061/10/19
	UKRAINE GOVERNMENT	—	2,000	357	48,326	2028/11/1
	UKRAINE GOVERNMENT	—	1,200	203	27,460	2029/5/21
	UKRAINE GOVERNMENT	—	2,100	346	46,810	2033/3/15
	UNITED MEXICAN STATES	4.5	1,800	1,769	239,133	2029/4/22
	UNITED MEXICAN STATES	3.25	1,100	990	133,816	2030/4/16
	UNITED MEXICAN STATES	2.659	1,600	1,342	181,498	2031/5/24
	UNITED MEXICAN STATES	4.75	1,000	965	130,484	2032/4/27
	UNITED MEXICAN STATES	4.875	2,200	2,115	285,871	2033/5/19
	UNITED MEXICAN STATES	3.5	1,300	1,102	149,036	2034/2/12
	UNITED MEXICAN STATES	6.35	1,500	1,591	215,094	2035/2/9
	UNITED MEXICAN STATES	4.28	1,700	1,386	187,376	2041/8/14
	UNITED MEXICAN STATES	4.5	400	320	43,261	2050/1/31
	UNITED MEXICAN STATES	5.0	2,500	2,127	287,476	2051/4/27
	UNITED MEXICAN STATES	4.4	2,200	1,691	228,572	2052/2/12
	UNITED MEXICAN STATES	6.338	300	299	40,529	2053/5/4
	UNITED MEXICAN STATES	3.771	1,300	866	117,111	2061/5/24
合	計				30,267,004	

\*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	30,267,004	98.3
コール・ローン等、その他	509,815	1.7
投資信託財産総額	30,776,819	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建純資産(30,661,762千円)の投資信託財産総額(30,776,819千円)に対する比率は99.6%です。

\*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=135.15円、1ユーロ=148.23円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月10日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	30,822,691,069
コール・ローン等	124,989,078
公社債(評価額)	30,267,004,052
未収入金	45,937,400
未収利息	331,173,773
前払費用	53,586,766
(B) 負債	99,475,609
未払金	86,579,096
未払解約金	12,780,992
未払利息	121
その他未払費用	115,400
(C) 純資産総額(A-B)	30,723,215,460
元本	15,769,488,089
次期繰越損益金	14,953,727,371
(D) 受益権総口数	15,769,488,089口
1万円当たり基準価額(C/D)	19,483円

(注) 期首元本額は11,393,726,957円、期中追加設定元本額は11,617,235,118円、期中一部解約元本額は7,241,473,986円、1口当たり純資産額は1.9483円です。

## ○損益の状況 (2022年5月11日～2023年5月10日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,414,889,323
受取利息	1,414,894,851
その他収益金	49,386
支払利息	△ 54,914
(B) 有価証券売買損益	△ 173,352,877
売買益	1,506,111,336
売買損	△ 1,679,464,213
(C) 保管費用等	△ 3,599,247
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,237,937,199
(E) 前期繰越損益金	9,790,397,683
(F) 追加信託差損益金	10,518,939,541
(G) 解約差損益金	△ 6,593,547,052
(H) 計(D+E+F+G)	14,953,727,371
次期繰越損益金(H)	14,953,727,371

\*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(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。

\*損益の状況の中で(G)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
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	6,421,426,002
野村外国債券(含む新興国)インデックスBコース(野村投資一任口座向け)	3,203,165,523
野村外国債券(含む新興国)インデックスAコース(野村投資一任口座向け)	1,732,782,619
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	1,274,022,973
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,063,526,437
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	490,828,703
野村DC運用戦略ファンド	410,408,126
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	403,850,406
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	361,064,318
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	165,207,991

ファンド名	当期末 元本額
	円
オールウェザー・ファクターアロケーションオープン投信(適格機関投資家専用)	160,785,574
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	35,103,135
インデックス・ブレンド(タイプIII)	12,734,694
ネクストコア	11,375,571
インデックス・ブレンド(タイプV)	9,012,001
インデックス・ブレンド(タイプIV)	3,841,919
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	3,168,844
インデックス・ブレンド(タイプI)	2,843,861
インデックス・ブレンド(タイプII)	2,175,790
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,163,602

## ○お知らせ

該当事項はございません。