

# 野村グローバルSRI 100

## 愛称:野村世界社会的責任投資

### 償還運用報告書(全体版)

第21期（償還日2024年11月7日）

作成対象期間（2024年5月28日～2024年11月7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。  
このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行ない、償還価額が決定いたしました。  
ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

#### ●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／株式／インデックス型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                   |
| 信託期間   | 2024年11月7日をもちまして繰上償還いたします。（設定日2004年5月28日）                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                   |
| 運用方針   | 先進国ESG株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、FTSE4Good Developed 100 Indexに採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式を実質的な主要投資対象とし、円換算したFTSE4Good Developed 100 Index（FTSE4Good Developed 100 Indexに日々の為替レートを乗じて得た指数）の動きをとらえる投資成果を目指して運用を行ないます。<br>株式の実質組入れ比率は高位を保つことを基本としますが、投資対象市場が休場等の場合は組入れ比率を一時的に引き下げる場合があります。<br>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ないません。 |                                                                                                                   |
| 主な投資対象 | 野村グローバルSRI 100<br>マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、株式に直接投資する場合もあります。<br>FTSE4Good Developed 100 Indexに採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村グローバルSRI 100                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。                                                                 |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>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配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、配当等収益等を中心として分配します。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株式会社

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

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

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準<br>(分配落) | 価 額   |      |        | ベンチマーク |      | 株組入比率 | 株先物比率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|--------------|-------|------|--------|--------|------|-------|-------|---------|
|                 |              | 税 込 分 | 配 金  | 期騰落率   | 期騰落率   |      |       |       |         |
|                 | 円 銭          | 円     | %    |        | %      | %    | %     | 百万円   |         |
| 17期(2021年5月27日) | 27,536       | 135   | 40.6 | 373.76 | 42.8   | 99.3 | 0.4   | 3,797 |         |
| 18期(2022年5月27日) | 31,050       | 150   | 13.3 | 428.30 | 14.6   | 98.4 | 1.4   | 2,883 |         |
| 19期(2023年5月29日) | 37,610       | 180   | 21.7 | 523.47 | 22.2   | 98.3 | 1.5   | 739   |         |
| 20期(2024年5月27日) | 53,340       | 260   | 42.5 | 756.22 | 44.5   | 98.5 | 1.4   | 1,049 |         |
| (償還時)           | (償還価額)       |       |      |        |        |      |       |       |         |
| 21期(2024年11月7日) | 55,866.11    | —     | 4.7  | 803.70 | 6.3    | —    | —     | 761   |         |

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。  
\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。  
\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* ベンチマーク（＝円換算したFTSE4Good Developed 100 Index<sup>\*</sup>）は、FTSE4Good Developed 100 Indexをもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で円換算し、設定時を100として指数化しております。  
※配当込みの指数とします。

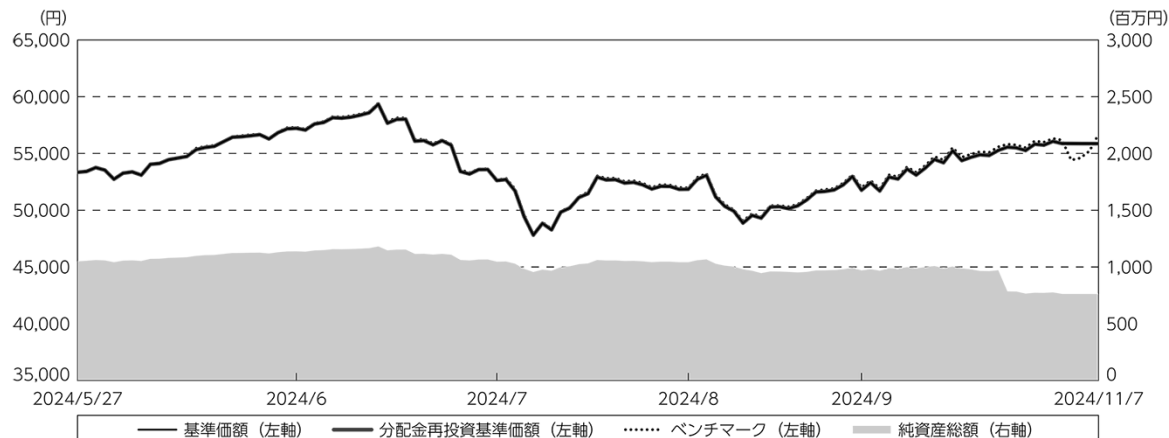
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年          月          日 | 基          準        | 価          額            |        | ベンチマ          ーク        |      | 株組入比率 | 株先物比率 |
|-------------------------|---------------------|-------------------------|--------|-------------------------|------|-------|-------|
|                         |                     | 騰          落          率 |        | 騰          落          率 |      |       |       |
| （期  首）<br>2024年5月27日    | 円  銭                | %                       |        | %                       |      | %     | %     |
|                         | 53,340              | －                       | 756.22 | －                       | 98.5 | 1.4   |       |
| 5月末                     | 52,734              | △1.1                    | 747.66 | △1.1                    | 98.4 | 1.4   |       |
| 6月末                     | 57,217              | 7.3                     | 812.45 | 7.4                     | 97.8 | 2.1   |       |
| 7月末                     | 52,617              | △1.4                    | 746.39 | △1.3                    | 98.8 | 1.1   |       |
| 8月末                     | 51,853              | △2.8                    | 736.84 | △2.6                    | 98.5 | 1.3   |       |
| 9月末                     | 51,768              | △2.9                    | 737.23 | △2.5                    | 97.9 | 1.9   |       |
| 10月末                    | 55,878              | 4.8                     | 796.44 | 5.3                     | 94.2 | 1.2   |       |
| （償還時）<br>2024年11月  7  日 | （償還価額）<br>55,866.11 | 4.7                     | 803.70 | 6.3                     | －    | －     |       |

\* 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、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。  
\* 株式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： 53,340円

期末(償還日)：55,866円11銭 (既払分配金(税込み)：－円)

騰 落 率： 4.7% (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(2024年5月27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、円換算したFTSE4Good Developed 100 Indexです。ベンチマークは、作成期首(2024年5月27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

基準価額は、期首53,340円から償還時55,866.11円に2,526.11円の値上がりとなりました。

先進国株式の株価および為替の変動

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首からFRB（米連邦準備制度理事会）のパウエル議長がインフレ率の鈍化が継続するとの見通しを示し、景気が緩やかに減速することへの期待などから、上昇しました。2024年7月中旬以降は米政府が同盟各国に中国向け半導体輸出に関する規制強化を要請し、米半導体メーカーの業績への悪影響が懸念されたこと、7月の米雇用統計が軟調であったことなどを背景に下落しました。

8月中旬以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）において米金利の0.5%引き下げが決定され、FRBが労働市場を下支えする姿勢を明確化したことや、米半導体メーカーが9-11月期についてAI向けメモリー需要の高まりを受けて市場予想以上に好調な見通しであると示したことなどから、上昇しました。

為替市場は、期首から主要投資通貨である米ドルは、米経済指標が堅調であったことを背景に日米金利差の拡大期待が強まったことなどをを受けて上昇（円安）しました。2024年7月中旬以降は米利下げ期待の高まりなどから下落（円高）しましたが、9月中旬以降は、FOMCによる0.5%の米金利利下げや、衆院選で与党の議席が過半数割れしたことで今後の政権の枠組みや日銀の利上げに対する不透明感が広がったこと、米大統領選で共和党のトランプ氏が勝利したことで、同氏の政策が米経済成長とインフレを加速させるとの見方などから上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村グローバルSRI 100]

主要投資対象である[先進国ESG株式インデックスマザーファンド] 受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

ただし、繰上償還に向け、信託終了日前にマザーファンド受益証券を全売却しました。

### [先進国ESG株式インデックスマザーファンド]

#### ・株式組入比率

引き続き「FTSE4Good Developed 100 Index」構成銘柄に投資し、株式組入比率は期を通じ高位に維持しました。

#### ・期中の主な動き

「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index※」の動きをとらえるために、「FTSE4Good Developed 100 Index」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「FTSE4Good Developed 100 Index」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。「FTSE4Good Developed 100 Index」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行ない、また期中の資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

※配当込みの指数とします。

## ○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+4.7%となり、ベンチマークである「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index」の+6.3%を1.6ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

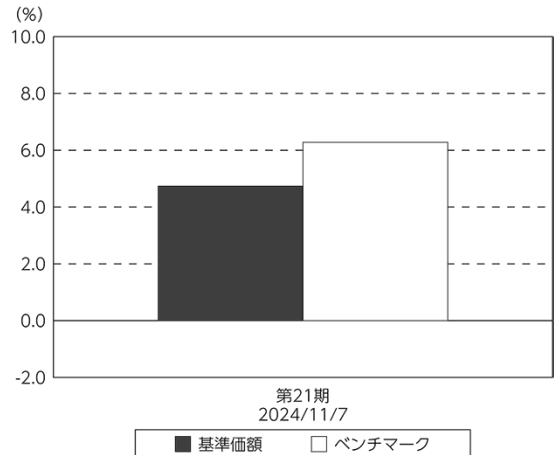
### (マイナス要因)

- ①コスト負担（当ファンドの信託報酬や、マザーファンドにおける売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### (その他、差異を生じた要因)

- ①為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）
- ②国内株式の評価時価による差異（ファンド評価に使用される価格とベンチマークの価格に日時差があり異なるため）
- ③繰上償還対応により、信託終了日前にマザーファンド受益証券を全売却していること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) ベンチマークは、円換算したFTSE4Good Developed 100 Indexです。

## ◎分配金

繰上償還のため分配は行ないませんでした。

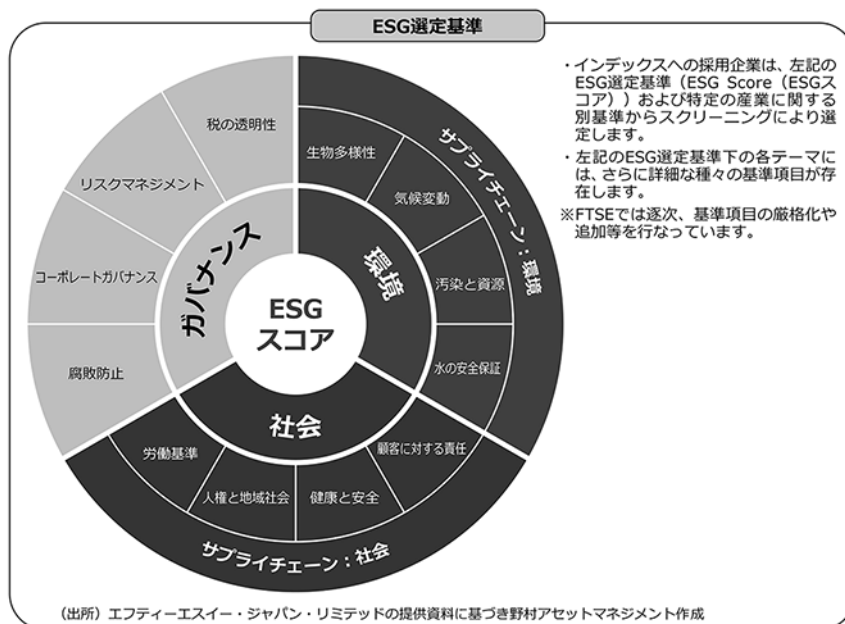
## ◎（ご参考）マザーファンドにおけるESG運用について

### ○対象インデックスについて

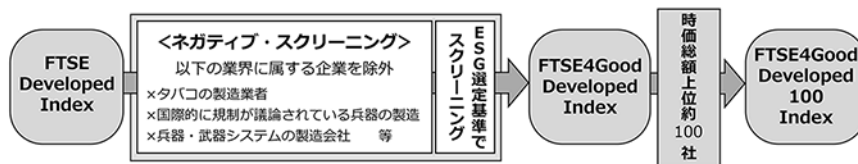
#### ■FTSE4Good Developed 100 Indexについて■

FTSE4Good Developed 100 Indexを含むFTSE4Good Indexシリーズは、世界的に認められかつ受け入れられた「ESG選定基準」に合致する企業を対象とした一連の株式指数です。

- ◆FTSE4Good Indexシリーズは、FTSE International Limited（「FTSE」といいます。）によって編集・計算・公表されています。
- ◆インデックスへの採用企業の選定は、FTSEの独立した専門委員会の監督の下、行なわれています。
- ◆FTSE4Good Developed 100 Indexは、FTSE4Good Indexシリーズの一指数であり、世界の先進国における企業で、ESG選定基準によってスクリーニングされた時価総額上位約100社によって構成されています。



#### FTSE4Good Developed 100 Indexの構築プロセス



上記は、FTSEの資料等に基づいて野村アセットマネジメントが作成したものです。

## ○ファンドの組入銘柄

対象インデックスを構成するすべての銘柄は対象インデックスの算出方法に基づき、ESG特性を重視して選定されています。

## ○スチュワードシップ活動

野村アセットマネジメントは、議決権行使や建設的な対話（エンゲージメント）といったスチュワードシップ活動を通じて、投資先企業の経営陣がESG課題に係るリスクを管理し、ビジネス機会を追求することに加え、国際的なイニシアティブに基づいた情報開示を行なうように働きかけています。野村アセットマネジメントのスチュワードシップ活動の詳細は以下のサイト（「責任投資レポート」）よりご覧いただけます。

<https://www.nomura-am.co.jp/special/esg/library/ri-report.html>

## ◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



## ○基準価額の推移

基準価額は、設定時10,000円から償還時55,866.11円に45,866.11円の値上がりとなりました。

この間、1万口あたり合計1,725円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は47,591.11円となりました。

## ○基準価額の主な変動要因

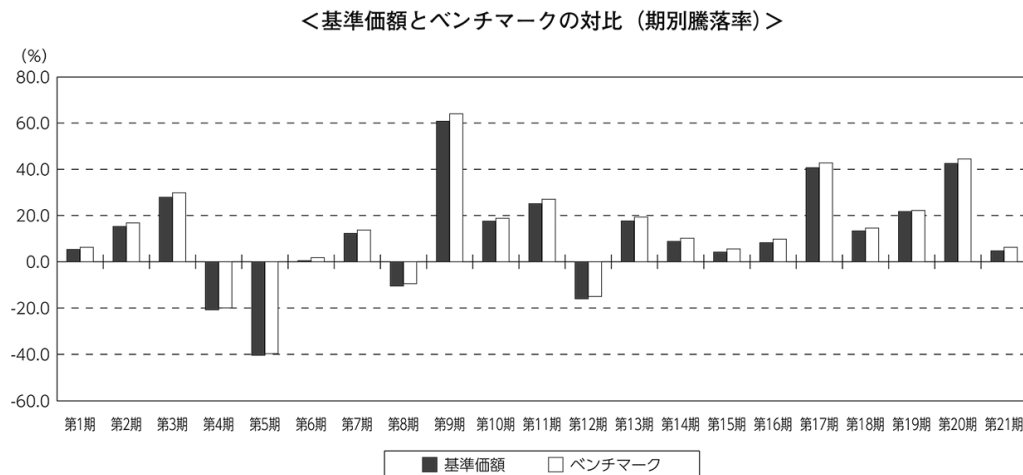
先進国株式の株価および為替の変動

## ○ベンチマーク（円換算したFTSE4Good Developed 100 Index）との対比

設定来では、基準価額の騰落率は+515.4%となり、ベンチマークの+703.7%を188.3ポイント下回りました。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

各期における基準価額とベンチマークの騰落率は次のようになっております。



（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、円換算したFTSE4Good Developed 100 Indexです。

主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（当ファンドの信託報酬や、マザーファンドにおける売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他、差異を生じた要因）

繰上償還対応により、信託終了日前にマザーファンド受益証券を全売却していること

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年 5 月28日～2024年11月 7 日)

| 項 目                   | 当 期   |         | 項 目 の 概 要                                                             |
|-----------------------|-------|---------|-----------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額   | 比 率     |                                                                       |
|                       | 円     | %       |                                                                       |
| (a) 信 託 報 酬           | 252   | 0.470   | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                                               |
| （ 投 信 会 社 ）           | (106) | (0.198) | 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 ）           | (119) | (0.222) | 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 ）           | ( 27) | (0.049) | 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) 売 買 委 託 手 数 料     | 3     | 0.006   | (b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ）               | ( 2)  | (0.005) |                                                                       |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）   | ( 1)  | (0.002) |                                                                       |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税     | 3     | 0.005   | (c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| （ 株 式 ）               | ( 3)  | (0.005) |                                                                       |
| (d) そ の 他 費 用         | 4     | 0.007   | (d)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 ）           | ( 3)  | (0.006) | 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 ）           | ( 1)  | (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)  | (0.000) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                                    |
| 合 計                   | 262   | 0.488   |                                                                       |
| 期中の平均基準価額は、53,677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。

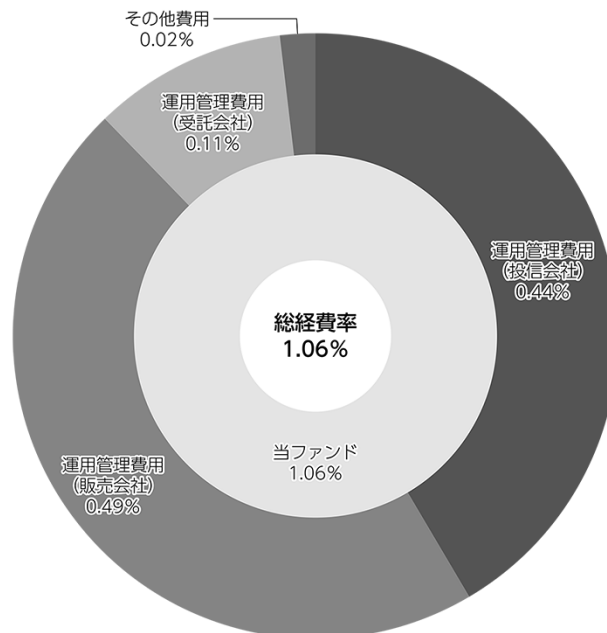
\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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1.06%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

(2024年 5 月28日～2024年11月 7 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             |
| 先進国ESG株式インデックスマザーファンド | 千口<br>3,411 | 千円<br>23,625 | 千口<br>152,295 | 千円<br>1,115,134 |

\*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2024年 5 月28日～2024年11月 7 日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                 | 当 期                   |
|---------------------|-----------------------|
|                     | 先進国ESG株式インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 10,547,587千円          |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 28,171,889千円          |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.37                  |

\*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2024年 5 月28日～2024年11月 7 日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルSRI 100>

該当事項はございません。

<先進国ESG株式インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等<br>A          |               |          | 売付額等<br>C          |               |        |
|-----|--------------------|---------------|----------|--------------------|---------------|--------|
|     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |          | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |        |
| 株式  | 百万円<br>6,288       | 百万円<br>22     | %<br>0.3 | 百万円<br>4,259       | 百万円<br>—      | %<br>— |

平均保有割合 3.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期     |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 62千円    |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.118千円 |
| (B) / (A)        | 0.2%    |

\* 売買委託手数料総額は、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です。

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

(2024年11月7日現在)

2024年11月7日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

| 銘 柄                   | 期首(前期末)       |
|-----------------------|---------------|
|                       | 口 数           |
| 先進国ESG株式インデックスマザーファンド | 千口<br>148,884 |

\* 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年11月7日現在)

| 項 目          | 償 還 時   |       |
|--------------|---------|-------|
|              | 評 価 額   | 比 率   |
| コール・ローン等、その他 | 千円      | %     |
|              | 767,087 | 100.0 |
| 投資信託財産総額     | 767,087 | 100.0 |

\* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2024年11月7日現在)

| 項 目             | 償 還 時        |
|-----------------|--------------|
|                 | 円            |
| (A) 資産          | 767,087,655  |
| コール・ローン等        | 767,082,664  |
| 未収利息            | 4,991        |
| (B) 負債          | 5,394,633    |
| 未払解約金           | 558,941      |
| 未払信託報酬          | 4,820,530    |
| その他未払費用         | 15,162       |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 761,693,022  |
| 元本              | 136,342,603  |
| 償還差益金           | 625,350,419  |
| (D) 受益権総口数      | 136,342,603口 |
| 1万口当たり償還価額(C／D) | 55,866円11銭   |

(注) 期首元本額は196,677,459円、期中追加設定元本額は4,984,972円、期中一部解約元本額は65,319,828円、1口当たり純資産額は5,586611円です。

○損益の状況 (2024年5月28日～2024年11月7日)

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
|                  | 円             |
| (A) 配当等収益        | 15,770        |
| 受取利息             | 15,770        |
| (B) 有価証券売買損益     | 38,728,951    |
| 売買益              | 52,171,009    |
| 売買損              | △ 13,442,058  |
| (C) 信託報酬等        | △ 4,835,692   |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 33,909,029    |
| (E) 前期繰越損益金      | 498,929,199   |
| (F) 追加信託差損益金     | 92,512,191    |
| (配当等相当額)         | ( 83,142,118) |
| (売買損益相当額)        | ( 9,370,073)  |
| 償還差益金(D＋E＋F)     | 625,350,419   |

\* 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。

○投資信託財産運用総括表

| 信 託 期 間   | 投資信託契約締結日      | 2004年 5 月 28 日 |                 |            | 投資信託契約終了時の状況 |              |
|-----------|----------------|----------------|-----------------|------------|--------------|--------------|
|           | 投資信託契約終了日      | 2024年11月 7 日   |                 |            | 資 産 総 額      | 767,087,655円 |
| 区 分       | 投資信託契約締結当初     | 投資信託契約終了時      | 差引増減または追加信託     | 負 債 総 額    | 5,394,633円   |              |
|           |                |                |                 | 純 資 産 総 額  | 761,693,022円 |              |
| 受益権口数     | 4,492,945,525口 | 136,342,603口   | △4,356,602,922口 | 受 益 権 口 数  | 136,342,603口 |              |
| 元 本 額     | 4,492,945,525円 | 136,342,603円   | △4,356,602,922円 | 1 万口当たり償還金 | 55,866円11銭   |              |
| 最近10期末の状況 |                |                |                 |            |              |              |
| 計 算 期     | 元 本 額          | 純資産総額          | 基準価額            | 1 万口当たり分配金 |              |              |
|           |                |                |                 | 金 額        | 分 配 率        |              |
| 第11期      | 2,050,816,331円 | 3,409,377,892円 | 16,624円         | 80円        | 0.80%        |              |
| 第12期      | 2,043,593,845  | 2,839,728,027  | 13,896          | 65         | 0.65         |              |
| 第13期      | 2,024,104,030  | 3,292,393,945  | 16,266          | 80         | 0.80         |              |
| 第14期      | 1,421,179,505  | 2,502,616,371  | 17,609          | 85         | 0.85         |              |
| 第15期      | 1,414,414,269  | 2,582,530,100  | 18,259          | 90         | 0.90         |              |
| 第16期      | 1,390,847,337  | 2,736,604,970  | 19,676          | 95         | 0.95         |              |
| 第17期      | 1,378,997,654  | 3,797,205,001  | 27,536          | 135        | 1.35         |              |
| 第18期      | 928,654,185    | 2,883,492,036  | 31,050          | 150        | 1.50         |              |
| 第19期      | 196,751,164    | 739,984,048    | 37,610          | 180        | 1.80         |              |
| 第20期      | 196,677,459    | 1,049,067,860  | 53,340          | 260        | 2.60         |              |

○償還金のお知らせ

|                 |            |
|-----------------|------------|
| 1 万口当たり償還金（税込み） | 55,866円11銭 |
|-----------------|------------|

○お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する所要の約款変更を行ないました。

＜変更適用日：2024年 7 月 4 日＞

# 先進国ESG株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2024年5月27日）

作成対象期間（2023年5月30日～2024年5月27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   | 円換算したFTSE4Good Developed 100 Index（FTSE4Good Developed 100 Indexに日々の為替レートを乗じた指数）の動きをとらえる投資成果を目指して運用を行ないます。<br>株式の組入れ比率は高位を保つことを基本としますが、投資対象市場が休場等の場合は組入れ比率を一時的に引き下げる場合があります。 |
| 主な投資対象 | FTSE4Good Developed 100 Indexに採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式を主要投資対象とします。                                                                                                            |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。                                                                                                                                |

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 |         | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|---------|---------|-------------|---------|-----------|-----------|---------|
|                   |         | 騰 落 中 率 |             | 騰 落 中 率 |           |           |         |
|                   | 円       | %       |             | %       | %         | %         | 百万円     |
| 16期(2020年 5 月27日) | 24,748  | 9.4     | 261.83      | 9.8     | 99.5      | —         | 3,054   |
| 17期(2021年 5 月27日) | 35,171  | 42.1    | 373.76      | 42.8    | 99.3      | 0.4       | 5,512   |
| 18期(2022年 5 月27日) | 40,216  | 14.3    | 428.30      | 14.6    | 98.4      | 1.4       | 8,677   |
| 19期(2023年 5 月29日) | 48,934  | 21.7    | 523.47      | 22.2    | 98.3      | 1.5       | 11,371  |
| 20期(2024年 5 月27日) | 70,455  | 44.0    | 756.22      | 44.5    | 98.5      | 1.4       | 26,611  |

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* ベンチマーク（＝円換算したFTSE4Good Developed 100 Index<sup>®</sup>）は、FTSE4Good Developed 100 Indexをもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で円換算し、設定時を100として指数化しております。  
※配当込みの指数とします。

○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 |       | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|-----------------------|---------|-------|-------------|-------|-----------|-----------|
|                       |         | 騰 落 率 |             | 騰 落 率 |           |           |
|                       | 円       | %     |             | %     | %         | %         |
| (期 首)<br>2023年 5 月29日 | 48,934  | —     | 523.47      | —     | 98.3      | 1.5       |
| 5 月 末                 | 48,521  | △ 0.8 | 519.31      | △ 0.8 | 98.3      | 1.5       |
| 6 月 末                 | 51,866  | 6.0   | 555.32      | 6.1   | 98.5      | 1.4       |
| 7 月 末                 | 52,627  | 7.5   | 563.28      | 7.6   | 98.8      | 1.0       |
| 8 月 末                 | 54,224  | 10.8  | 580.56      | 10.9  | 98.7      | 1.1       |
| 9 月 末                 | 52,745  | 7.8   | 564.87      | 7.9   | 99.0      | 0.8       |
| 10月 末                 | 51,886  | 6.0   | 555.76      | 6.2   | 97.9      | 1.9       |
| 11月 末                 | 55,730  | 13.9  | 597.00      | 14.0  | 98.8      | 1.0       |
| 12月 末                 | 55,801  | 14.0  | 598.34      | 14.3  | 98.6      | 1.3       |
| 2024年 1 月 末           | 60,824  | 24.3  | 651.55      | 24.5  | 98.7      | 1.1       |
| 2 月 末                 | 63,497  | 29.8  | 680.52      | 30.0  | 98.9      | 1.0       |
| 3 月 末                 | 66,189  | 35.3  | 710.14      | 35.7  | 98.4      | 1.5       |
| 4 月 末                 | 67,074  | 37.1  | 719.30      | 37.4  | 97.7      | 2.2       |
| (期 末)<br>2024年 5 月27日 | 70,455  | 44.0  | 756.22      | 44.5  | 98.5      | 1.4       |

\* 騰落率は期首比です。

\* 株式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、円換算したFTSE4Good Developed 100 Index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

先進国株式の株価および為替の変動

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から2023年7月末にかけて、米地銀セクターの健全性に対する不安の後退や米大手半導体企業の業績見通しが市場予想を上回ったことなどが好感されたこと、FOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利が据え置かれるとの期待感が高まったことなどをを受けて上昇しました。8月以降は、大手格付機関が米国債の格付けを引き下げたことや米国の金融引き締めが長期化するとの懸念などから下落しましたが、11月以降は、米企業決算において市場予想を上回る決算が相次いだことや市場予想を上回る経済指標の発表、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が利下げ開始に前向きな見解を示したことなどが好感され再び上昇しました。

為替市場は、期首から主要投資通貨である米ドルは、日米金融政策の行方を巡り一進一退となりました。2023年7月中旬以降はFRBの金融引き締め継続観測と日銀の金融緩和策の維持が示されたことから日米金利差の拡大期待が強まったことなどをを受けて上昇（円安）しました。11月中旬以降は、FRBによる利下げ期待の高まりなどから下落（円高）しましたが、2024年1月に入るとFRBによる早期利下げ期待の後退などにより再び上昇（円安）に転じました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

引き続き「FTSE4Good Developed 100 Index」構成銘柄に投資し、株式組入比率は期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index※」の動きをとらえるために、「FTSE4Good Developed 100 Index」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「FTSE4Good Developed 100 Index」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。「FTSE4Good Developed 100 Index」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行ない、また期中の資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

※配当込みの指数とします。

## ○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+44.0%となり、ベンチマークである「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index」の+44.5%を0.5ポイント下回りました。

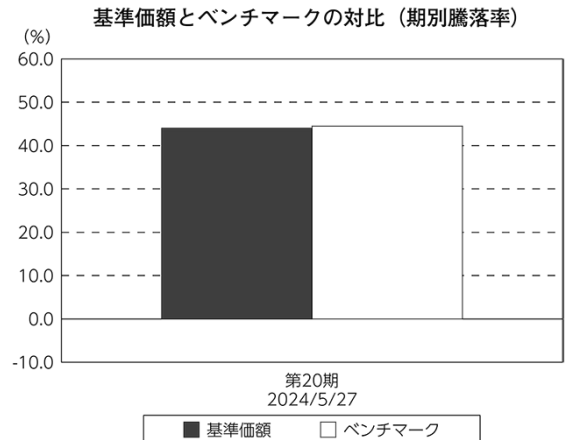
主な差異要因は以下の通りです。

### (マイナス要因)

- ① ファンドでは売買コストや保管費用などのコスト負担が発生したこと
- ② 配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### (その他、差異を生じた要因)

- ① 為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）
- ② 国内株式の評価時価による差異（ファンド評価に使用される価格とベンチマークの価格に日時差があり異なるため）



(注) ベンチマークは、円換算したFTSE4Good Developed 100 Indexです。

## ◎今後の運用方針

引き続き「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index」の中長期的な動きをとらえる投資成果を目指して運用を行ないます。

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。

先進国ESG株式インデックスマザーファンドは、FTSE International Limited（以下「FTSE」）、ロンドン証券取引所（以下「取引所」）、（以下総称して「ライセンス供与者」と呼ぶ）のいずれによっても、後援、推薦、販売または販売促進されるものではありません。ライセンス供与者は、FTSE4Good Developed 100 Index（以下、本指数）の使用およびいかなる時点における本指数値の利用から生じるいかなる結果に対しても、明示的か黙示的かを問わず、何ら表明や保証を行なうものではありません。本指数はFTSEにより編集、算出されます。ライセンス供与者は本指数の誤差脱漏について何人に対しても責任を負わず（過失の有無を問わず）、かつ本指数の誤差脱漏に関して通知する義務を負いません。FTSE®は、取引所の登録商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 5 月30日～2024年 5 月27日)

| 項 目                   | 当 期   |         | 項 目 の 概 要                                                              |
|-----------------------|-------|---------|------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額   | 比 率     |                                                                        |
|                       | 円     | %       |                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 10    | 0.017   | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式)                 | ( 7 ) | (0.012) |                                                                        |
| (先物・オプション)            | ( 3 ) | (0.005) |                                                                        |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 11    | 0.020   | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (株 式)                 | (11)  | (0.020) |                                                                        |
| (c) そ の 他 費 用         | 10    | 0.017   | (c) 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)             | (10)  | (0.017) |                                                                        |
| (そ の 他)               | ( 0 ) | (0.000) |                                                                        |
| 合 計                   | 31    | 0.054   |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、56,748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

(2023年5月30日～2024年5月27日)

株式

|     |         | 買 付                   |                                   | 売 付             |                      |
|-----|---------|-----------------------|-----------------------------------|-----------------|----------------------|
|     |         | 株 数                   | 金 額                               | 株 数             | 金 額                  |
| 国 内 | 上場      | 千株<br>182<br>( 127)   | 千円<br>286,342<br>(       —)       | 千株<br>6         | 千円<br>29,110         |
|     | アメリカ    | 百株<br>3,178<br>(   —) | 千米ドル<br>47,252<br>(△     7)       | 百株<br>521       | 千米ドル<br>6,007        |
| 外 国 | カナダ     | 189                   | 千カナダドル<br>1,677                   | 50              | 千カナダドル<br>513        |
|     | イギリス    | 1,042                 | 千英ポンド<br>2,080                    | —               | 千英ポンド<br>—           |
|     | スイス     | 372<br>(   21)        | 千スイスフラン<br>2,431<br>(△     6)     | 21              | 千スイスフラン<br>53        |
|     | ノルウェー   | 20                    | 千ノルウェークローネ<br>662                 | —               | 千ノルウェークローネ<br>—      |
|     | デンマーク   | 74<br>(   78)         | 千デンマーククローネ<br>6,399<br>(       —) | 1               | 千デンマーククローネ<br>145    |
|     | ユーロ     |                       | 千ユーロ                              |                 | 千ユーロ                 |
|     | ドイツ     | 183<br>(   —)         | 1,497<br>(△    16)                | 28              | 229                  |
|     | フランス    | 176                   | 2,610                             | 8               | 56                   |
|     | オランダ    | 11                    | 811                               | —               | —                    |
|     | スペイン    | 418<br>(  619)        | 558<br>(     14)                  | 0.19<br>(  606) | 0.00458<br>(     14) |
|     | ベルギー    | 36                    | 201                               | —               | —                    |
|     | 香港      | 344                   | 千香港ドル<br>2,356                    | —               | 千香港ドル<br>—           |
|     | オーストラリア | 212                   | 千豪ドル<br>1,601                     | —               | 千豪ドル<br>—            |

\*金額は受け渡し代金。  
\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。  
\* (   ) 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 |        | 買 建          |              | 売 建      |          |
|-------|--------|--------------|--------------|----------|----------|
|       |        | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外 国   | 株式先物取引 | 百万円<br>7,146 | 百万円<br>7,035 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。  
\*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2023年5月30日～2024年5月27日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                 | 当 期          |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額       | 10,518,104千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 17,294,417千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.60         |

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年5月30日～2024年5月27日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A           |               |          | 売付額等<br>C           |               |        |
|-----|---------------------|---------------|----------|---------------------|---------------|--------|
|     | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ |          | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |        |
| 株式  | 百万円<br>9,511        | 百万円<br>37     | %<br>0.4 | 百万円<br>1,006        | 百万円<br>—      | %<br>— |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期     |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 2,970千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 12千円    |
| (B) / (A)        | 0.4%    |

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證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2024年 5 月27日現在)

国内株式

| 銘                 | 柄             | 期首(前期末) | 当 期   |     | 末       |
|-------------------|---------------|---------|-------|-----|---------|
|                   |               | 株 数     | 株 数   | 評 価 | 額       |
| 電気機器 (18.3%)      |               | 千株      | 千株    |     | 千円      |
| ソニーグループ           |               | 4.8     | 8.5   |     | 106,717 |
| 輸送用機器 (48.1%)     |               |         |       |     |         |
| トヨタ自動車            |               | 46.9    | 81.3  |     | 280,485 |
| 情報・通信業 (5.3%)     |               |         |       |     |         |
| 日本電信電話            |               | 4.5     | 197.9 |     | 30,832  |
| ソフトバンクグループ        |               | 3.8     | —     |     | —       |
| 小売業 (7.7%)        |               |         |       |     |         |
| ファーストリテイリング       |               | —       | 1.1   |     | 44,913  |
| 銀行業 (20.6%)       |               |         |       |     |         |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ |               | —       | 75.3  |     | 119,764 |
| 合 計               | 株 数 ・ 金 額     | 60      | 364   |     | 582,712 |
|                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 5     |     | <2.2%>  |

\*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

\*銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

\*評価額欄の< >内は、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。

## 外国株式

| 銘柄                              | 株数  | 期首(前期末) | 当期末    |           | 業種等                     |
|---------------------------------|-----|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                                 |     | 株数      | 評価額    |           |                         |
|                                 |     |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                          | 百株  | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |
| AT & T INC                      | 276 | 483     | 846    | 132,720   | 各種電気通信サービス              |
| ABBVIE INC                      | 68  | 121     | 1,907  | 299,203   | バイオテクノロジー               |
| ADOBE INC                       | 17  | 31      | 1,479  | 232,020   | ソフトウェア                  |
| ALPHABET INC-CL C               | 204 | 344     | 6,073  | 952,723   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALPHABET INC-CL A               | 234 | 407     | 7,134  | 1,119,164 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| AMERICAN EXPRESS CO             | 22  | —       | —      | —         | 消費者金融                   |
| AMGEN INC                       | 20  | 36      | 1,127  | 176,891   | バイオテクノロジー               |
| ELEVANCE HEALTH INC             | 9   | 16      | 834    | 130,869   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APPLE INC                       | 505 | 726     | 13,803 | 2,165,335 | コンピュータ・周辺機器             |
| APPLIED MATERIALS               | 33  | 57      | 1,273  | 199,728   | 半導体・半導体製造装置             |
| AUTOMATIC DATA PROCESS          | 16  | 27      | 696    | 109,247   | 専門サービス                  |
| BANK OF AMERICA CORP            | 274 | 468     | 1,861  | 291,962   | 銀行                      |
| BLACKROCK INC                   | 5   | 10      | 785    | 123,147   | 資本市場                    |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP          | —   | 101     | 766    | 120,218   | ヘルスケア機器・用品              |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO         | 83  | 135     | 559    | 87,756    | 医薬品                     |
| THE CIGNA GROUP                 | 11  | 19      | 647    | 101,535   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CVS HEALTH CORP                 | 48  | 84      | 467    | 73,263    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CISCO SYSTEMS                   | 160 | 279     | 1,298  | 203,645   | 通信機器                    |
| CITIGROUP                       | 74  | 130     | 831    | 130,447   | 銀行                      |
| COCA COLA CO                    | 152 | 265     | 1,643  | 257,795   | 飲料                      |
| CONOCOPHILLIPS                  | 47  | 81      | 959    | 150,473   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DEERE & COMPANY                 | 10  | 17      | 670    | 105,111   | 機械                      |
| DISNEY (WALT) CO                | 71  | 124     | 1,268  | 198,932   | 娯楽                      |
| GOLDMAN SACHS GROUP             | 12  | 21      | 1,004  | 157,640   | 資本市場                    |
| HOME DEPOT                      | 39  | 68      | 2,236  | 350,818   | 専門小売り                   |
| INTEL CORP                      | 162 | 285     | 877    | 137,728   | 半導体・半導体製造装置             |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 34  | 61      | 1,046  | 164,169   | 情報技術サービス                |
| INTUIT INC                      | 10  | 18      | 1,130  | 177,392   | ソフトウェア                  |
| JOHNSON & JOHNSON               | 102 | 165     | 2,435  | 382,047   | 医薬品                     |
| LAM RESEARCH                    | —   | 9       | 883    | 138,550   | 半導体・半導体製造装置             |
| ELI LILLY & CO.                 | 32  | 58      | 4,691  | 735,903   | 医薬品                     |
| LOWES COS INC                   | 23  | 39      | 849    | 133,216   | 専門小売り                   |
| MARSH & MCLENNAN COS            | 19  | 33      | 704    | 110,586   | 保険                      |
| MASTERCARD INC                  | 33  | 57      | 2,575  | 403,992   | 金融サービス                  |
| MERCK & CO INC                  | 98  | 174     | 2,262  | 354,869   | 医薬品                     |
| MICROSOFT CORP                  | 291 | 384     | 16,525 | 2,592,348 | ソフトウェア                  |
| MICRON TECHNOLOGY               | —   | 75      | 978    | 153,445   | 半導体・半導体製造装置             |
| NIKE INC-B                      | 46  | 81      | 746    | 117,157   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NVIDIA CORP                     | 92  | 162     | 17,345 | 2,721,055 | 半導体・半導体製造装置             |
| ORACLE CORPORATION              | 59  | 105     | 1,292  | 202,796   | ソフトウェア                  |
| PNC FINANCIAL                   | 15  | —       | —      | —         | 銀行                      |
| PAYPAL HOLDINGS INC             | 44  | —       | —      | —         | 金融サービス                  |
| PROCTER & GAMBLE CO             | 92  | 161     | 2,675  | 419,711   | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO                  | 22  | 39      | 814    | 127,789   | 保険                      |
| QUALCOMM INC                    | 43  | 76      | 1,598  | 250,793   | 半導体・半導体製造装置             |
| REGENERON PHARMACEUTICALS       | 4   | 7       | 691    | 108,473   | バイオテクノロジー               |
| S&P GLOBAL INC                  | 12  | 21      | 948    | 148,767   | 資本市場                    |
| SALESFORCE INC                  | 37  | 63      | 1,733  | 272,003   | ソフトウェア                  |
| SCHLUMBERGER LTD                | 55  | —       | —      | —         | エネルギー設備・サービス            |
| SERVICENOW INC                  | 7   | 13      | 1,013  | 159,062   | ソフトウェア                  |
| STARBUCKS CORP                  | 44  | 75      | 593    | 93,064    | ホテル・レストラン・レジャー          |

| 銘柄                               |                  | 株数    | 株数    | 当期        |            | 業種等         |
|----------------------------------|------------------|-------|-------|-----------|------------|-------------|
|                                  |                  |       |       | 期末        |            |             |
|                                  |                  |       |       | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |             |
| (アメリカ)                           |                  | 百株    | 百株    | 千米ドル      | 千円         |             |
| TJX COS INC                      |                  | 44    | 78    | 806       | 126,531    | 専門小売り       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC            |                  | 35    | 62    | 1,247     | 195,689    | 半導体・半導体製造装置 |
| 3M CORP                          |                  | 21    | —     | —         | —          | コングロマリット    |
| UNION PAC CORP                   |                  | 24    | 41    | 953       | 149,610    | 陸上運輸        |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B       |                  | 28    | 49    | 687       | 107,866    | 航空貨物・物流サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS           |                  | 164   | 290   | 1,154     | 181,091    | 各種電気通信サービス  |
| VISA INC-CLASS A SHARES          |                  | 63    | 109   | 3,008     | 471,972    | 金融サービス      |
| WELLS FARGO CO                   |                  | 149   | —     | —         | —          | 銀行          |
| ACCENTURE PLC-CL A               |                  | 24    | 43    | 1,296     | 203,313    | 情報技術サービス    |
| EATON CORP PLC                   |                  | —     | 26    | 915       | 143,688    | 電気設備        |
| LINDE PLC                        |                  | 18    | 33    | 1,455     | 228,283    | 化学          |
| MEDTRONIC PLC                    |                  | 51    | 92    | 757       | 118,761    | ヘルスケア機器・用品  |
| CHUBB LTD                        |                  | 16    | 28    | 745       | 116,873    | 保険          |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,434 | 7,090 | 127,616   | 20,019,263 |             |
|                                  |                  | 60    | 58    | —         | <75.2%>    |             |
| (カナダ)                            |                  |       |       | 千カナダドル    |            |             |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO         |                  | 23    | 39    | 682       | 78,380     | 陸上運輸        |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD |                  | 36    | —     | —         | —          | 陸上運輸        |
| ENBRIDGE INC                     |                  | 78    | 143   | 711       | 81,645     | 石油・ガス・消耗燃料  |
| ROYAL BANK OF CANADA             |                  | 53    | 95    | 1,379     | 158,341    | 銀行          |
| TORONTO DOMINION BANK            |                  | 71    | 123   | 951       | 109,235    | 銀行          |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 263   | 402   | 3,726     | 427,603    |             |
|                                  |                  | 5     | 4     | —         | <1.6%>     |             |
| (イギリス)                           |                  |       |       | 千英ポンド     |            |             |
| DIAGEO PLC                       |                  | 87    | 150   | 404       | 80,827     | 飲料          |
| HSBC HOLDINGS PLC                |                  | 786   | 1,320 | 915       | 182,919    | 銀行          |
| RIO TINTO PLC-REG                |                  | 42    | 72    | 412       | 82,463     | 金属・鉱業       |
| ASTRAZENECA PLC                  |                  | 57    | 100   | 1,237     | 247,345    | 医薬品         |
| UNILEVER PLC                     |                  | 96    | 171   | 737       | 147,406    | パーソナルケア用品   |
| GSK PLC                          |                  | 155   | 276   | 490       | 97,952     | 医薬品         |
| SHELL PLC-NEW                    |                  | 271   | 447   | 1,241     | 248,166    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,497 | 2,539 | 5,439     | 1,087,080  |             |
|                                  |                  | 7     | 7     | —         | <4.1%>     |             |
| (スイス)                            |                  |       |       | 千スイスフラン   |            |             |
| NOVARTIS AG-REG                  |                  | 77    | 141   | 1,293     | 221,904    | 医薬品         |
| ROCHE HOLDINGS AG-BEARER         |                  | 0.94  | 1     | 43        | 7,390      | 医薬品         |
| ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)    |                  | 27    | 47    | 1,089     | 186,820    | 医薬品         |
| NESTLE SA-REG                    |                  | 105   | 184   | 1,700     | 291,640    | 食品          |
| UBS GROUP AG                     |                  | —     | 209   | 589       | 101,085    | 資本市場        |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 210   | 583   | 4,716     | 808,840    |             |
|                                  |                  | 4     | 5     | —         | <3.0%>     |             |
| (ノルウェー)                          |                  |       |       | 千ノルウェークロネ |            |             |
| EQUINOR ASA                      |                  | 33    | 54    | 1,659     | 24,577     | 石油・ガス・消耗燃料  |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 33    | 54    | 1,659     | 24,577     |             |
|                                  |                  | 1     | 1     | —         | <0.1%>     |             |
| (デンマーク)                          |                  |       |       | 千デンマーククロネ |            |             |
| NOVO NORDISK A/S-B               |                  | 61    | —     | —         | —          | 医薬品         |
| NOVO NORDISK A/S-B               |                  | —     | 212   | 19,760    | 450,730    | 医薬品         |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 61    | 212   | 19,760    | 450,730    |             |
|                                  |                  | 1     | 1     | —         | <1.7%>     |             |
| (ユーロ…ドイツ)                        |                  |       |       | 千ユーロ      |            |             |
| SAP SE                           |                  | 43    | 74    | 1,346     | 229,101    | ソフトウェア      |
| ALLIANZ SE-REG                   |                  | 15    | 27    | 717       | 122,026    | 保険          |
| SIEMENS AG                       |                  | 28    | 51    | 913       | 155,532    | コングロマリット    |

| 銘柄                                  |           | 期首(前期末) |        | 当 期 末  |            | 業 種 等       |
|-------------------------------------|-----------|---------|--------|--------|------------|-------------|
|                                     |           | 株 数     | 株 数    | 評 価 額  |            |             |
|                                     |           |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |             |
| (ユーロ…ドイツ)                           |           | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円         | 各種電気通信サービス  |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG                |           | 133     | 222    | 483    | 82,337     |             |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 221     | 375    | 3,461  | 588,997    |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 4       | 4      | —      | <2.2%>     |             |
| (ユーロ…フランス)                          |           |         |        |        |            |             |
| LOREAL-ORD                          |           | 9       | 15     | 700    | 119,136    | パーソナルケア用品   |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE |           | 9       | 16     | 1,264  | 215,179    | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               |           | 20      | 36     | 879    | 149,653    | 電気設備        |
| HERMES INTERNATIONAL                |           | 1       | 2      | 518    | 88,291     | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SANOFI                              |           | 42      | 74     | 667    | 113,581    | 医薬品         |
| ESSILORLUXOTTICA                    |           | 11      | 21     | 437    | 74,401     | ヘルスケア機器・用品  |
| BNP PARIBAS                         |           | 43      | 68     | 460    | 78,435     | 銀行          |
| TOTALENERGIES SE                    |           | 88      | 142    | 940    | 160,054    | 石油・ガス・消耗燃料  |
| ATR LIQUIDE SA                      |           | 19      | 35     | 641    | 109,192    | 化学          |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 246     | 413    | 6,510  | 1,107,926  |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 9       | 9      | —      | <4.2%>     |             |
| (ユーロ…オランダ)                          |           |         |        |        |            |             |
| ASML HOLDING NV                     |           | 15      | 27     | 2,388  | 406,501    | 半導体・半導体製造装置 |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 15      | 27     | 2,388  | 406,501    |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 1       | 1      | —      | <1.5%>     |             |
| (ユーロ…スペイン)                          |           |         |        |        |            |             |
| IBERDROLA SA                        |           | —       | 403    | 485    | 82,556     | 電力          |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA       |           | 41      | 69     | 307    | 52,309     | 専門小売り       |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 41      | 473    | 792    | 134,866    |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 1       | 2      | —      | <0.5%>     |             |
| (ユーロ…ベルギー)                          |           |         |        |        |            |             |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          |           | 33      | 69     | 416    | 70,913     | 飲料          |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 33      | 69     | 416    | 70,913     |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 1       | 1      | —      | <0.3%>     |             |
| ユ ー ロ 計                             | 株 数 ・ 金 額 | 558     | 1,359  | 13,569 | 2,309,205  |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 16      | 17     | —      | <8.7%>     |             |
| (香港)                                |           |         |        | 千香港ドル  |            |             |
| AIA GROUP LTD                       |           | 446     | 790    | 4,775  | 95,893     | 保険          |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 446     | 790    | 4,775  | 95,893     |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 1       | 1      | —      | <0.4%>     |             |
| (オーストラリア)                           |           |         |        | 千豪ドル   |            |             |
| BHP GROUP LIMITED                   |           | 196     | 343    | 1,535  | 159,598    | 金属・鉱業       |
| CSL LIMITED                         |           | 18      | 32     | 917    | 95,392     | バイオテクノロジー   |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA      |           | 66      | 116    | 1,387  | 144,223    | 銀行          |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 281     | 493    | 3,840  | 399,214    |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 3       | 3      | —      | <1.5%>     |             |
| 合 計                                 | 株 数 ・ 金 額 | 7,787   | 13,526 | —      | 25,622,408 |             |
| 銘柄 数 < 比 率 >                        |           | 98      | 97     | —      | <96.3%>    |             |

\* 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。

\* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 |        |          | 当 期        | 末        |
|-----|--------|----------|------------|----------|
|     |        |          | 買 建 額      | 売 建 額    |
| 外国  | 株式先物取引 | SP500MIC | 百万円<br>363 | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。  
\*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。

○投資信託財産の構成 (2024年 5 月27日現在)

| 項 目          | 当 期              | 末         |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>26,205,121 | %<br>98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 422,102          | 1.6       |
| 投資信託財産総額     | 26,627,223       | 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（25,934,679千円）の投資信託財産総額（26,627,223千円）に対する比率は97.4%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＝156.87円、1 カナダドル＝114.76 円、1 英ポンド＝199.84円、1 スイスフラン＝171.50円、1 ノルウェークローネ＝14.81円、1 デンマーククローネ＝22.81円、1 ユーロ＝170.17円、1 香港ドル＝20.08円、1 豪ドル＝103.94円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月27日現在)

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 26,695,546,930 |
| コール・ローン等        | 273,748,199    |
| 株式(評価額)         | 26,205,121,512 |
| 未収入金            | 69,524,855     |
| 未収配当金           | 38,651,192     |
| 未収利息            | 223            |
| 差入委託証拠金         | 108,500,949    |
| (B) 負債          | 83,700,190     |
| 未払金             | 76,420,967     |
| 未払解約金           | 7,177,423      |
| その他未払費用         | 101,800        |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 26,611,846,740 |
| 元本              | 3,777,122,216  |
| 次期繰越損益金         | 22,834,724,524 |
| (D) 受益権総口数      | 3,777,122,216口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 70,455円        |

(注) 期首元本額は2,323,917,149円、期中追加設定元本額は1,595,577,713円、期中一部解約元本額は142,372,646円、1口当たり純資産額は7,0455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  
・野村世界ESG株式インデックスファンド(確定拠出年金向け) 3,223,357,719円  
・野村インデックスファンド・先進国ESG株式 404,880,422円  
・野村グローバルSRI 100 148,884,075円

○損益の状況 (2023年5月30日～2024年5月27日)

| 項 目                | 当 期            |
|--------------------|----------------|
|                    | 円              |
| (A) 配当等収益          | 309,342,781    |
| 受取配当金              | 303,458,677    |
| 受取利息               | 2,709,194      |
| その他収益金             | 3,194,538      |
| 支払利息               | △ 19,628       |
| (B) 有価証券売買損益       | 6,593,551,526  |
| 売買益                | 6,950,107,387  |
| 売買損                | △ 356,555,861  |
| (C) 先物取引等取引損益      | 56,768,154     |
| 取引益                | 96,159,937     |
| 取引損                | △ 39,391,783   |
| (D) 保管費用等          | △ 2,927,087    |
| (E) 当期損益金(A＋B＋C＋D) | 6,956,735,374  |
| (F) 前期繰越損益金        | 9,048,034,100  |
| (G) 追加信託差損益金       | 7,506,867,695  |
| (H) 解約差損益金         | △ 676,912,645  |
| (I) 計(E＋F＋G＋H)     | 22,834,724,524 |
| 次期繰越損益金(I)         | 22,834,724,524 |

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引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(G)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(H)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。

○お知らせ

該当事項はございません。