

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14期（決算日2024年9月6日）

作成対象期間（2023年9月7日～2024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に、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	中 率	期 騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
14期(2024年9月6日)	10,312	0	7.8	113.98	9.0	96.9	—	1,096

*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) 2023年9月6日	円	%		%	%	%
	9,565	—	104.55	—	99.8	—
9月末	9,218	△3.6	100.88	△3.5	98.4	—
10月末	9,036	△5.5	98.96	△5.3	97.5	—
11月末	9,609	0.5	105.45	0.9	97.8	—
12月末	10,056	5.1	110.29	5.5	96.8	—
2024年1月末	9,821	2.7	107.84	3.2	97.5	—
2月末	9,883	3.3	108.83	4.1	97.8	—
3月末	10,089	5.5	111.12	6.3	98.0	—
4月末	9,881	3.3	108.87	4.1	98.7	—
5月末	9,922	3.7	109.41	4.7	97.8	—
6月末	9,985	4.4	110.08	5.3	98.2	—
7月末	10,041	5.0	110.86	6.0	96.9	—
8月末	10,290	7.6	113.70	8.8	98.3	—
(期末) 2024年9月6日	10,312	7.8	113.98	9.0	96.9	—

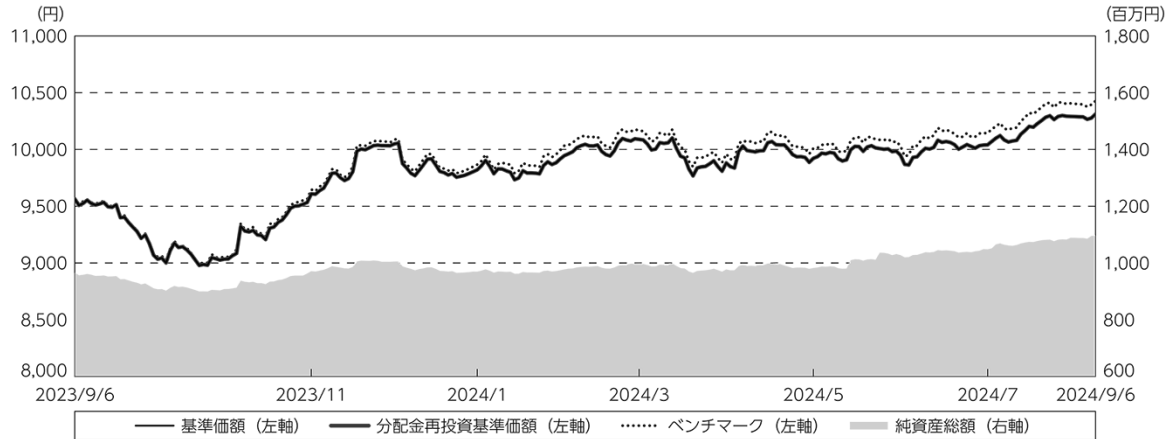
*騰落率は期首比です。

*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：9,565円

期 末：10,312円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：7.8% (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(2023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(2023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)利回りが低下(価格は上昇)したことなどから基準価額は上昇しました。

○投資環境

米国の物価関連指標でインフレ鈍化基調が示されたことからFRB（米連邦準備制度理事会）による利下げ開始が意識されたことなどを背景に、米国債利回りは低下（価格は上昇）しました。一方で、中東情勢の緊迫化を背景に市場のリスク回避姿勢が強まる局面も見られたことから、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）は拡大しました。当運用期間では、米国債利回りが低下したことから、新興国債券利回りは低下しました。

○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+7.8%となり、ベンチマークの+9.0%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。

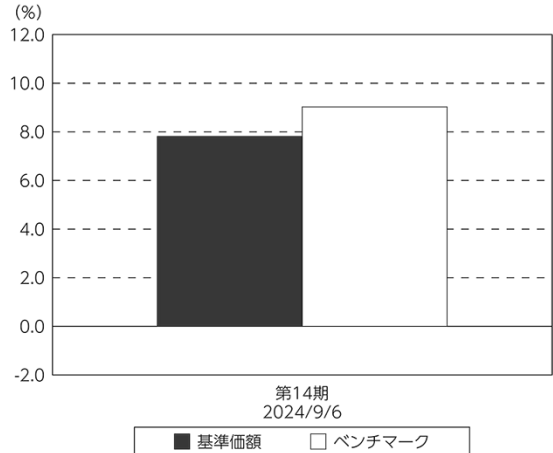
(マイナス要因)

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。

◎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ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第14期
	2023年9月7日～ 2024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	8,211

(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宛にお願いします。当情報に関する追加の情報は、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

(2023年9月7日～2024年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 65	% 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	0.007	(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)	(0.004)	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	66	0.667	
期中の平均基準価額は、9,819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。

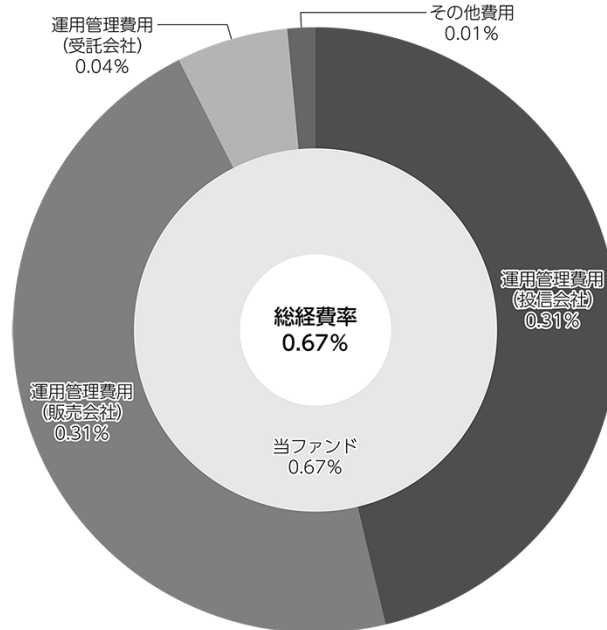
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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

(2023年9月7日～2024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 150,921	千円 356,600	千口 155,878	千円 360,380

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年9月7日～2024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

(2024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 458,454	千口 453,498	千円 1,082,545

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024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 1,082,545	% 98.1
コール・ローン等、その他	20,807	1.9
投資信託財産総額	1,103,352	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(46,814,500千円)の投資信託財産総額(47,318,856千円)に対する比率は98.9%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=143.24円、1ユーロ=159.18円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,195,549,420
コール・ローン等	18,432,366
新興国債券マザーファンド(評価額)	1,082,545,388
未収入金	1,094,571,546
未収利息	120
(B) 負債	1,099,099,184
未払金	1,092,197,027
未払解約金	3,523,209
未払信託報酬	3,367,785
その他未払費用	11,163
(C) 純資産総額(A-B)	1,096,450,236
元本	1,063,280,172
次期繰越損益金	33,170,064
(D) 受益権総口数	1,063,280,172口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,312円

(注) 期首元本額は1,010,257,921円、期中追加設定元本額は276,868,291円、期中一部解約元本額は223,846,040円、1口当たり純資産額は1.0312円です。

○損益の状況 (2023年9月7日～2024年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,251
受取利息	7,269
支払利息	△ 1,018
(B) 有価証券売買損益	77,290,318
売買益	298,691,343
売買損	△221,401,025
(C) 信託報酬等	△ 6,536,068
(D) 当期損益金(A+B+C)	70,760,501
(E) 前期繰越損益金	△181,481,147
(F) 追加信託差損益金	143,890,710
(配当等相当額)	(608,941,652)
(売買損益相当額)	(△465,050,942)
(G) 計(D+E+F)	33,170,064
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	33,170,064
追加信託差損益金	143,890,710
(配当等相当額)	(609,484,858)
(売買損益相当額)	(△465,594,148)
分配準備積立金	263,621,632
繰越損益金	△374,342,278

*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(2023年9月7日～2024年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年9月7日～ 2024年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	49,306,721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	609,484,858円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	214,314,911円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	873,106,490円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	8,211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

- ①運用の基本方針において、デリバティブ取引の利用目的を明確化する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2023年11月29日＞
- ②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＞

2024年11月5日より、ファンドの設定解約の申込締切時間は以下の記載のとおり変更となる予定です。

原則、午後3時30分までに、販売会社が受付けた分を当日のお申込み分とします。

（販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。）

新興国債券マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日2024年5月10日）

作成対象期間（2023年5月11日～2024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					
12期(2020年5月11日)	18,255	△ 1.5	188.37	△ 3.0	97.9	—	百万円 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
16期(2024年5月10日)	24,601	26.3	254.87	27.0	98.0	—	45,057

*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

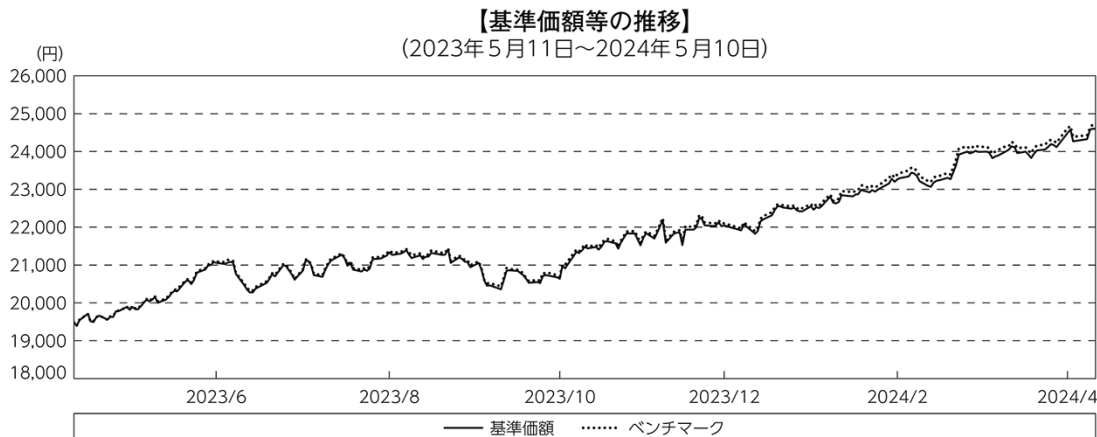
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	騰落率
	円	騰落率					
(期首) 2023年5月10日	19,483	—	200.74	—	98.5	—	—
5月末	19,888	2.1	205.26	2.3	98.4	—	—
6月末	21,058	8.1	217.30	8.2	98.0	—	—
7月末	20,857	7.1	215.23	7.2	97.5	—	—
8月末	21,335	9.5	220.34	9.8	97.9	—	—
9月末	20,944	7.5	216.31	7.8	97.9	—	—
10月末	20,639	5.9	213.24	6.2	97.7	—	—
11月末	21,725	11.5	224.58	11.9	97.7	—	—
12月末	22,043	13.1	227.71	13.4	97.5	—	—
2024年1月末	22,530	15.6	232.89	16.0	97.6	—	—
2月末	23,266	19.4	241.06	20.1	97.8	—	—
3月末	23,988	23.1	248.52	23.8	97.8	—	—
4月末	24,487	25.7	253.61	26.3	97.8	—	—
(期末) 2024年5月10日	24,601	26.3	254.87	27.0	98.0	—	—

*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。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) 利回りが低下 (価格は上昇) したことや、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

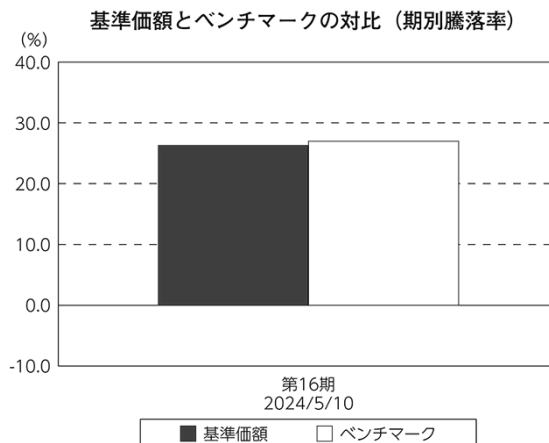
当運用期間の基準価額の騰落率は+26.3%となり、ベンチマークであるJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース) の+27.0%を0.7ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(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、よろしくお願ひ申し上げます。

*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・チェース・バンク・エヌ・エー、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が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

(2023年5月11日～2024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)	(0.005)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
	(0)	(0.000)	
合 計	1	0.005	
期中の平均基準価額は、21,896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11日～2024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 157,713	千米ドル 108,382

*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

(2023年5月11日～2024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

(2024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	341,464	283,676	44,168,450	98.0	40.3	81.3	10.5	6.3
合 計	341,464	283,676	44,168,450	98.0	40.3	81.3	10.5	6.3

*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。

*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&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	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						
	ABU DHABI GOVT INT'L	2.5	1,600	1,558	242,582	2025/4/16	
	ABU DHABI GOVT INT'L	1.625	2,200	1,928	300,339	2028/6/2	
	ABU DHABI GOVT INT'L	2.5	2,200	1,954	304,385	2029/9/30	
	ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	2,500	2,268	353,248	2030/4/16	
	ABU DHABI GOVT INT'L	1.7	600	489	76,239	2031/3/2	
	ABU DHABI GOVT INT'L	1.875	1,500	1,222	190,300	2031/9/15	
	ABU DHABI GOVT INT'L	5.0	1,200	1,203	187,447	2034/4/30	
	ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	2,300	1,558	242,720	2049/9/30	
	ABU DHABI GOVT INT'L	3.875	3,700	2,867	446,465	2050/4/16	
	ABU DHABI GOVT INT'L	5.5	600	595	92,748	2054/4/30	
	ABU DHABI GOVT INT'L	2.7	800	443	69,055	2070/9/2	
	ARAB REPUBLIC OF EGYPT	5.875	1,200	952	148,326	2031/2/16	
	ARAB REPUBLIC OF EGYPT	7.625	2,800	2,369	368,950	2032/5/29	
	ARAB REPUBLIC OF EGYPT	8.875	3,200	2,565	399,494	2050/5/29	
	CHINA GOVT INTL BOND	1.95	1,400	1,374	213,968	2024/12/3	
	CHINA GOVT INTL BOND	0.55	3,400	3,188	496,505	2025/10/21	
	CHINA GOVT INTL BOND	1.25	1,600	1,470	229,018	2026/10/26	
	CHINA GOVT INTL BOND	2.125	1,400	1,238	192,792	2029/12/3	
	CHINA GOVT INTL BOND	1.2	2,600	2,133	332,167	2030/10/21	
	DOMINICAN REPUBLIC	5.5	1,800	1,727	268,934	2029/2/22	
	DOMINICAN REPUBLIC	4.5	2,300	2,083	324,445	2030/1/30	
	DOMINICAN REPUBLIC	4.875	2,600	2,305	359,028	2032/9/23	
	DOMINICAN REPUBLIC	6.0	2,300	2,209	343,964	2033/2/22	
	DOMINICAN REPUBLIC	5.3	1,500	1,261	196,425	2041/1/21	
	DOMINICAN REPUBLIC	6.4	2,000	1,848	287,887	2049/6/5	
	DOMINICAN REPUBLIC	5.875	2,700	2,260	352,036	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	1,040	161,943	2026/2/28
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.875	1,500	1,456	226,778	2025/6/6
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.875	3,200	2,862	445,660	2030/6/12
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.25	2,400	2,412	375,686	2031/3/18
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.75	600	518	80,798	2031/9/12
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.0	2,800	2,728	424,842	2033/10/20
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.125	1,200	1,170	182,208	2034/3/15
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.75	4,200	3,054	475,507	2050/1/14
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	7.125	1,700	1,662	258,831	2054/5/13
	HAZINE MUSTESARLIGI VARL	7.25	1,700	1,735	270,195	2027/2/24
	HAZINE MUSTESARLIGI VARL	8.5091	1,300	1,379	214,807	2029/1/14
	HUNGARY	6.125	1,900	1,931	300,805	2028/5/22
	HUNGARY	5.25	2,200	2,152	335,158	2029/6/16
	HUNGARY	2.125	800	628	97,802	2031/9/22
	HUNGARY	6.25	3,300	3,378	526,038	2032/9/22
	HUNGARY	5.5	2,400	2,272	353,800	2036/3/26
	HUNGARY	3.125	1,800	1,112	173,209	2051/9/21
	KSA SUKUK LTD	5.268	700	707	110,133	2028/10/25
	KSA SUKUK LTD	4.274	2,000	1,932	300,923	2029/5/22
	KSA SUKUK LTD	2.969	1,200	1,081	168,462	2029/10/29
	KSA SUKUK LTD	4.511	1,100	1,052	163,852	2033/5/22
	MEXICO GLOBAL	3.75	1,700	1,039	161,804	2071/4/19
	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.0	3,100	3,133	487,943	2029/8/1
	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.25	2,900	2,968	462,159	2031/1/25
	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	4.4	1,300	1,269	197,669	2027/6/6
	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	4.7	1,600	1,539	239,686	2032/6/6
	REPUBLIC OF ARGENTINA	1.0	3,975	2,335	363,618	2029/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	0.75	5,665	3,288	512,061	2030/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	3.625	10,837	4,961	772,518	2035/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	4.25	7,786	3,890	605,699	2038/1/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	3.5	3,800	1,627	253,344	2041/7/9
	REPUBLIC OF ARGENTINA	3.625	2,000	939	146,351	2046/7/9
	REPUBLIC OF CHILE	2.75	1,200	1,123	174,949	2027/1/31
	REPUBLIC OF CHILE	4.85	1,500	1,478	230,146	2029/1/22
	REPUBLIC OF CHILE	2.55	1,100	919	143,097	2032/1/27
	REPUBLIC OF CHILE	2.55	2,000	1,611	250,981	2033/7/27
	REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,300	1,125	175,276	2034/1/31
	REPUBLIC OF CHILE	4.95	1,800	1,718	267,502	2036/1/5
	REPUBLIC OF CHILE	3.1	2,000	1,452	226,153	2041/5/7
	REPUBLIC OF CHILE	4.34	2,100	1,802	280,709	2042/3/7
	REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,600	1,142	177,860	2050/1/25
	REPUBLIC OF CHILE	3.5	1,200	845	131,615	2053/4/15
	REPUBLIC OF CHILE	3.1	2,300	1,409	219,524	2061/1/22
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.0	1,600	1,317	205,117	2030/1/30
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.125	3,000	2,382	370,999	2031/4/15
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.25	1,600	1,238	192,861	2032/4/22
	REPUBLIC OF COLOMBIA	8.0	2,600	2,715	422,735	2033/4/20

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	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.5	1,800	1,812	282,200	2034/2/2
	REPUBLIC OF COLOMBIA	8.0	1,600	1,659	258,389	2035/11/14
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4.125	1,400	853	132,812	2051/5/15
	REPUBLIC OF COLOMBIA	8.75	1,800	1,917	298,518	2053/11/14
	REPUBLIC OF ECUADOR	6.0	4,100	2,881	448,648	2030/7/31
	REPUBLIC OF ECUADOR	3.5	7,100	3,892	606,066	2035/7/31
	REPUBLIC OF ECUADOR	2.5	3,300	1,654	257,675	2040/7/31
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.85	2,800	2,590	403,331	2030/10/15
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.2	2,500	2,037	317,239	2050/10/15
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.05	800	538	83,861	2051/3/12
	REPUBLIC OF NIGERIA	7.375	1,900	1,601	249,414	2033/9/28
	REPUBLIC OF PANAMA	3.16	2,400	1,998	311,228	2030/1/23
	REPUBLIC OF PANAMA	2.252	1,100	783	121,920	2032/9/29
	REPUBLIC OF PANAMA	6.4	3,100	2,922	454,986	2035/2/14
	REPUBLIC OF PANAMA	4.5	2,900	1,859	289,507	2056/4/1
	REPUBLIC OF PANAMA	3.87	800	454	70,813	2060/7/23
	REPUBLIC OF PANAMA	4.5	2,700	1,706	265,685	2063/1/19
	REPUBLIC OF PERU	2.783	3,700	3,141	489,071	2031/1/23
	REPUBLIC OF PERU	3.0	2,000	1,614	251,370	2034/1/15
	REPUBLIC OF PERU	3.55	1,900	1,331	207,290	2051/3/10
	REPUBLIC OF PERU	2.78	2,200	1,225	190,844	2060/12/1
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	2.65	1,500	958	149,294	2045/12/10
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.2	2,200	1,534	238,922	2046/7/6
	REPUBLIC OF POLAND	4.625	2,700	2,649	412,498	2029/3/18
	REPUBLIC OF POLAND	5.75	3,000	3,090	481,230	2032/11/16
	REPUBLIC OF POLAND	5.125	4,100	3,996	622,285	2034/9/18
	REPUBLIC OF POLAND	5.5	2,500	2,421	377,087	2053/4/4
	REPUBLIC OF POLAND	5.5	3,500	3,350	521,708	2054/3/18
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.85	1,300	1,178	183,561	2029/9/30
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.75	1,700	1,248	194,348	2049/9/30
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.3	3,200	2,797	435,546	2052/4/20
	REPUBLIC OF SRI LANKA	—	600	354	55,269	2027/5/11
	REPUBLIC OF TURKEY	4.25	1,500	1,483	230,940	2025/3/13
	REPUBLIC OF TURKEY	6.375	2,800	2,821	439,369	2025/10/14
	REPUBLIC OF TURKEY	4.75	2,100	2,063	321,293	2026/1/26
	REPUBLIC OF TURKEY	8.6	1,000	1,064	165,695	2027/9/24
	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	3,000	3,316	516,442	2028/1/15
	REPUBLIC OF TURKEY	9.375	1,800	1,965	306,014	2029/3/14
	REPUBLIC OF TURKEY	5.25	1,000	911	141,867	2030/3/13
	REPUBLIC OF TURKEY	9.125	2,200	2,396	373,154	2030/7/13
	REPUBLIC OF TURKEY	5.95	1,100	1,020	158,920	2031/1/15
	REPUBLIC OF TURKEY	5.875	600	552	86,056	2031/6/26
	REPUBLIC OF TURKEY	9.375	2,600	2,906	452,604	2033/1/19
	REPUBLIC OF TURKEY	6.5	1,000	938	146,171	2033/9/20
	REPUBLIC OF TURKEY	7.625	1,500	1,508	234,941	2034/5/15
	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	5.75	2,500	2,585	402,520	2034/10/28
	ROMANIA	6.625	1,200	1,226	190,894	2028/2/17

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					
	ROMANIA	5.875	2,200	2,178	339,251	2029/1/30
	ROMANIA	7.125	1,800	1,890	294,301	2033/1/17
	ROMANIA	6.375	2,000	1,995	310,652	2034/1/30
	ROMANIA	4.0	1,900	1,314	204,729	2051/2/14
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.9	1,500	1,451	225,969	2025/10/22
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.75	2,200	2,176	338,804	2028/1/18
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.75	1,700	1,667	259,691	2030/1/16
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.25	1,900	1,701	264,995	2030/10/22
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.5	2,600	2,650	412,621	2032/10/25
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.25	500	396	61,807	2033/2/2
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.875	2,400	2,331	363,067	2033/7/18
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.0	2,400	2,349	365,812	2034/1/16
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.0	2,500	2,174	338,532	2053/1/18
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	5.75	2,500	2,401	373,902	2054/1/16
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.75	900	626	97,574	2055/1/21
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	4.5	2,400	1,889	294,198	2060/4/22
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	3.45	900	573	89,259	2061/2/2
	STATE OF QATAR	3.4	1,700	1,670	260,101	2025/4/16
	STATE OF QATAR	3.75	3,000	2,821	439,307	2030/4/16
	STATE OF QATAR	4.4	5,100	4,338	675,515	2050/4/16
	UAE INT'L GOVT BOND	4.05	1,100	1,038	161,693	2032/7/7
	UAE INT'L GOVT BOND	4.917	1,200	1,201	187,137	2033/9/25
	UAE INT'L GOVT BOND	3.25	1,500	983	153,134	2061/10/19
	UKRAINE GOVERNMENT	—	2,000	641	99,912	2028/11/1
	UKRAINE GOVERNMENT	—	1,200	326	50,894	2029/5/21
	UKRAINE GOVERNMENT	—	2,100	576	89,819	2033/3/15
	UNITED MEXICAN STATES	3.25	2,100	1,852	288,394	2030/4/16
	UNITED MEXICAN STATES	2.659	1,600	1,322	205,870	2031/5/24
	UNITED MEXICAN STATES	4.75	1,700	1,584	246,680	2032/4/27
	UNITED MEXICAN STATES	4.875	1,500	1,394	217,126	2033/5/19
	UNITED MEXICAN STATES	3.5	800	654	101,972	2034/2/12
	UNITED MEXICAN STATES	6.35	2,100	2,126	331,057	2035/2/9
	UNITED MEXICAN STATES	6.0	2,900	2,849	443,628	2036/5/7
	UNITED MEXICAN STATES	4.28	1,100	863	134,371	2041/8/14
	UNITED MEXICAN STATES	4.5	400	306	47,683	2050/1/31
	UNITED MEXICAN STATES	5.0	2,200	1,795	279,613	2051/4/27
	UNITED MEXICAN STATES	4.4	1,700	1,261	196,475	2052/2/12
	UNITED MEXICAN STATES	6.338	2,700	2,578	401,472	2053/5/4
	UNITED MEXICAN STATES	6.4	1,500	1,447	225,317	2054/5/7
	UNITED MEXICAN STATES	3.771	1,300	817	127,265	2061/5/24
合	計				44,168,450	

*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

(2024年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 44,168,450	% 97.1
コール・ローン等、その他	1,315,207	2.9
投資信託財産総額	45,483,657	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(44,607,774千円)の投資信託財産総額(45,483,657千円)に対する比率は98.1%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=155.70円、1ユーロ=167.83円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	45,909,008,762
コール・ローン等	744,495,000
公社債(評価額)	44,168,450,350
未収入金	426,412,992
未収利息	508,039,049
前払費用	61,611,371
(B) 負債	851,776,384
未払金	782,771,534
未払解約金	68,834,850
その他未払費用	170,000
(C) 純資産総額(A-B)	45,057,232,378
元本	18,315,232,372
次期繰越損益金	26,742,000,006
(D) 受益権総口数	18,315,232,372口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,601円

(注) 期首元本額は15,769,488,089円、期中追加設定元本額は9,273,409,274円、期中一部解約元本額は6,727,664,991円、1口当たり純資産額は2.4601円です。

○損益の状況 (2023年5月11日~2024年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,193,379,101
受取利息	2,193,405,400
その他収益金	19,878
支払利息	△ 46,177
(B) 有価証券売買損益	6,770,573,376
売買益	8,022,038,359
売買損	△ 1,251,464,983
(C) 保管費用等	△ 1,741,977
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,962,210,500
(E) 前期繰越損益金	14,953,727,371
(F) 追加信託差損益金	10,789,010,606
(G) 解約差損益金	△ 7,962,948,471
(H) 計(D+E+F+G)	26,742,000,006
次期繰越損益金(H)	26,742,000,006

*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)	7,057,230,305
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)	3,846,537,572
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	2,092,583,584
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)	1,558,713,599
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	1,218,701,794
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	769,842,158
野村DC運用戦略ファンド	557,628,957
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	557,580,797
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	402,787,935
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	155,270,650

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	42,501,519
ホールウェザー・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)	25,441,361
ネクストコア	10,323,733
インデックス・ブレンド(タイプIII)	5,657,769
インデックス・ブレンド(タイプV)	5,545,661
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	2,249,977
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)	2,147,955
インデックス・ブレンド(タイプIV)	2,060,535
インデックス・ブレンド(タイプI)	1,382,266
インデックス・ブレンド(タイプII)	1,044,245

○お知らせ

該当事項はございません。