

# 野村インデックスファンド・ 先進国ESG株式

## 愛称: Funds-i 先進国ESG株式

### 運用報告書(全体版)

第4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。

商品分類	追加型投信/内外/株式/インデックス型	
信託期間	2021年1月21日以降、無期限とします。	
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います。 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。 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・ 先進国ESG株式	マザーファンド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があります。
	マザーファンド	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	野村インデックスファンド・ 先進国ESG株式	株式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。 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、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/>

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税 達 配 金		期 騰 落 中 率		ベンチマーク 騰 落 中 率	株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		分	配	騰	落				
(設定日)	円		円		%		%	%	百万円
2021年1月21日	10,000		—		—	10,000.00	—	—	1
1期(2021年5月27日)	11,501		0		15.0	11,538.19	15.4	99.3	1,131
2期(2022年5月27日)	13,134		0		14.2	13,221.61	14.6	98.4	1,588
3期(2023年5月29日)	15,946		0		21.4	16,159.76	22.2	98.3	1,845
4期(2024年5月27日)	22,910		0		43.7	23,344.58	44.5	98.5	2,852

\*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10,000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	騰 落 率		ベンチマーク 騰 落 率		株式組入比率	株式先物比率
		騰	落	騰	落		
(期首)	円		%		%	%	%
2023年5月29日	15,946		—	16,159.76	—	98.3	1.5
5月末	15,811	△	0.8	16,031.09	△	98.2	1.5
6月末	16,899		6.0	17,142.90	6.1	98.5	1.4
7月末	17,143		7.5	17,388.51	7.6	98.8	1.0
8月末	17,660		10.7	17,922.16	10.9	98.7	1.1
9月末	17,175		7.7	17,437.56	7.9	99.0	0.8
10月末	16,893		5.9	17,156.42	6.2	97.9	1.9
11月末	18,141		13.8	18,429.42	14.0	98.8	1.0
12月末	18,161		13.9	18,470.88	14.3	98.6	1.3
2024年1月末	19,792		24.1	20,113.57	24.5	98.7	1.1
2月末	20,658		29.5	21,007.93	30.0	98.9	1.0
3月末	21,530		35.0	21,922.09	35.7	98.4	1.5
4月末	21,814		36.8	22,204.97	37.4	97.7	2.2
(期末)							
2024年5月27日	22,910		43.7	23,344.58	44.5	98.5	1.4

\*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：15,946円

期 末：22,910円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 43.7% (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(2023年5月29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(2023年5月29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

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

### [野村インデックスファンド・先進国ESG株式]

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。

### [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<sup>※</sup>」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+43.7%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0.8ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

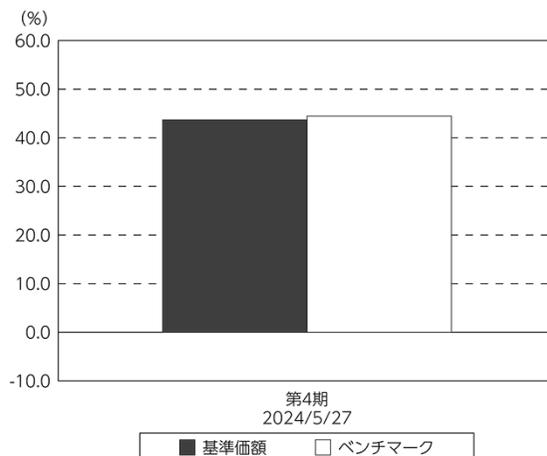
### (マイナス要因)

- 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）

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、円換算したFTSE4Good Developed 100 Indexです。

## ◎分配金

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。

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4期
	2023年5月30日～ 2024年5月27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	12,909

(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。

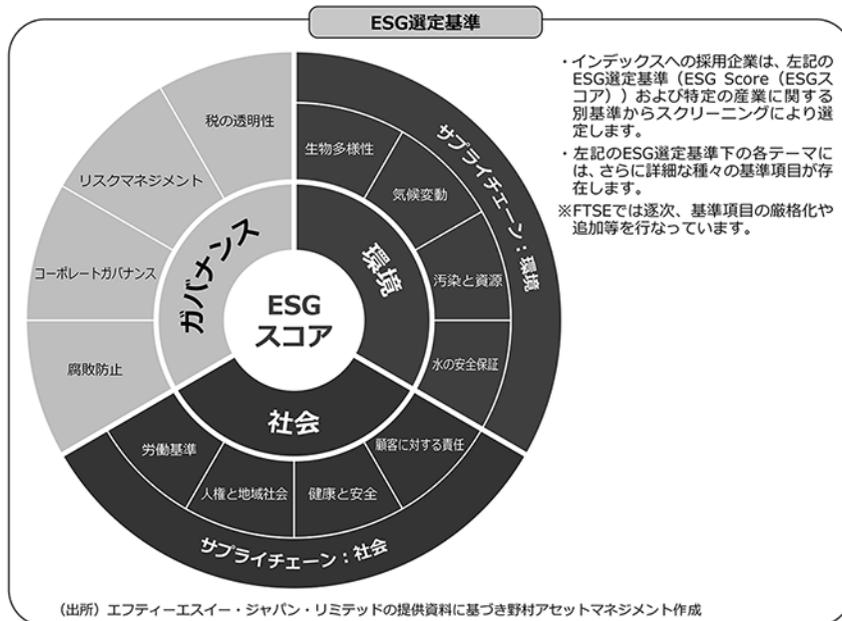
## ◎（ご参考）マザーファンドにおけるESG運用について

### ○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>

## ◎今後の運用方針

### [野村インデックスファンド・先進国ESG株式]

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] 受益証券を高位に組み入れ、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。

### [先進国ESG株式インデックスマザーファンド]

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。

野村インデックスファンド・先進国ESG株式は、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	
(a) 信 託 報 酬	円 55	% 0.295	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(38)	(0.208)	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 )	(10)	(0.055)	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 )	( 6 )	(0.033)	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	0.017	(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 ※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 )	(0.012)	
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	( 1 )	(0.005)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	4	0.020	(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 ※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 )	( 4 )	(0.020)	
(d) そ の 他 費 用	4	0.020	(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 )	(0.017)	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 )	(0.003)	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	66	0.352	
期中の平均基準価額は、18,473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。

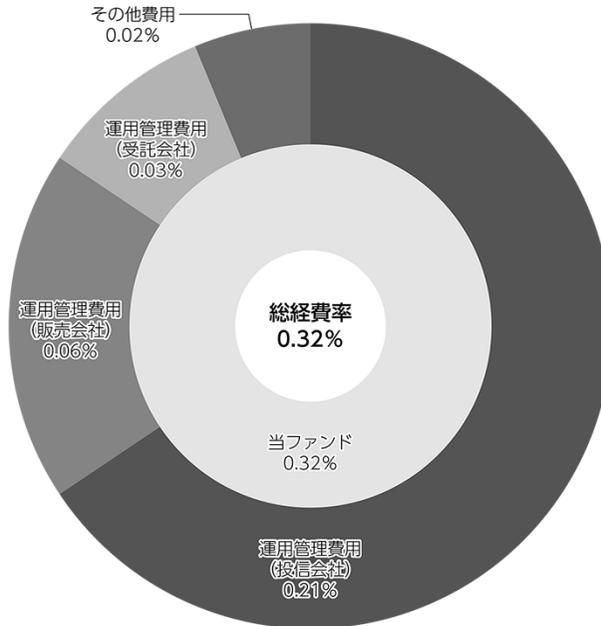
\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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0.32%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5月30日～2024年5月27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 71,612	千円 428,089	千口 43,871	千円 243,329

\*単位未満は切り捨て。

## ○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
	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	10,518,104千円
(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

&lt;野村インデックスファンド・先進国ESG株式&gt;

該当事項はございません。

&lt;先進国ESG株式インデックスマザーファンド&gt;

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

平均保有割合 12.3%

※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)	369千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	0.4%

\* 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5月27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
先進国ESG株式インデックスマザーファンド	千口 377,139	千口 404,880	千円 2,852,585

\* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

## ○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
先進国ESG株式インデックスマザーファンド	千円 2,852,585	% 99.8
コール・ローン等、その他	6,470	0.2
投資信託財産総額	2,859,055	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 先進国ESG株式インデックスマザーファンドにおいて、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	2,859,055,878
コール・ローン等	6,311,000
先進国ESG株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,852,585,013
未収入金	159,851
未収利息	14
(B) 負債	6,186,941
未払解約金	2,611,477
未払信託報酬	3,536,235
その他未払費用	39,229
(C) 純資産総額(A-B)	2,852,868,937
元本	1,245,277,658
次期繰越損益金	1,607,591,279
(D) 受益権総口数	1,245,277,658口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,910円

(注) 期首元本額は1,157,480,303円、期中追加設定元本額は435,879,910円、期中一部解約元本額は348,082,555円、1口当たり純資産額は2.2910円です。

## ○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	23
受取利息	899
支払利息	△ 876
(B) 有価証券売買損益	742,866,926
売買益	821,329,906
売買損	△ 78,462,980
(C) 信託報酬等	△ 6,529,684
(D) 当期損益金(A+B+C)	736,337,265
(E) 前期繰越損益金	317,957,703
(F) 追加信託差損益金	553,296,311
(配当等相当額)	( 253,449,415)
(売買損益相当額)	( 299,846,896)
(G) 計(D+E+F)	1,607,591,279
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,607,591,279
追加信託差損益金	553,296,311
(配当等相当額)	( 254,429,444)
(売買損益相当額)	( 298,866,867)
分配準備積立金	1,054,294,968

\*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5月30日～2024年5月27日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年5月30日～ 2024年5月27日
a. 配当等収益(経費控除後)	32,751,177円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	703,586,088円
c. 信託約款に定める収益調整金	553,296,311円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	317,957,703円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,607,591,279円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,909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。

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。）

# 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。 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。 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
	円	騰落率	円	騰落率			
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
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 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) 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<sup>※</sup>」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）

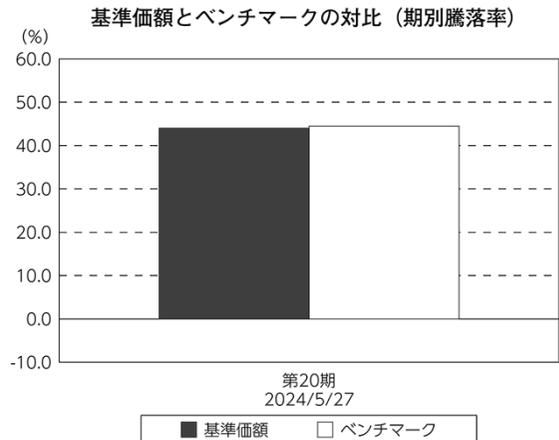
### (その他、差異を生じた要因)

- 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）

## ◎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。



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

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	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	円 10 ( 7 ) ( 3 )	% 0.017 (0.012) (0.005)	(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 ※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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 ( 株 式 )	11 (11)	0.020 (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 ※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
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	10 (10) ( 0 )	0.017 (0.017) (0.000)	(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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
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 182 ( 127)	千円 286,342 ( -)	千株 6	千円 29,110
	アメリカ	百株 3,178 ( -)	千米ドル 47,252 (△ 7)	百株 521	千米ドル 6,007
外 国	カナダ	189	千カナダドル 1,677	50	千カナダドル 513
	イギリス	1,042	千英ポンド 2,080	-	千英ポンド -
	スイス	372 ( 21)	千スイスフラン 2,431 (△ 6)	21	千スイスフラン 53
	ノルウェー	20	千ノルウェークローネ 662	-	千ノルウェークローネ -
	デンマーク	74 ( 78)	千デンマーククローネ 6,399 ( -)	1	千デンマーククローネ 145
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	183 ( -)	1,497 (△ 16)	28	229
	フランス	176	2,610	8	56
	オランダ	11	811	-	-
	スペイン	418 ( 619)	558 ( 14)	0.19 ( 606)	0.00458 ( 14)
ベルギー	36	201	-	-	
香港	344	千香港ドル 2,356	-	千香港ドル -	
オーストラリア	212	千豪ドル 1,601	-	千豪ドル -	

\*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 7,146	百万円 7,035	百万円 -	百万円 -

\*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 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 9,511	百万円 37	% 0.4	百万円 1,006	百万円 -	% -

## 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	株数	期首(前期末)	当	期	末
		株数	株数	評価額	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	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	
(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	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		
(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 銘柄 数 < 比 率 >	4,434 60	7,090 58	127,616 —	20,019,263 <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 銘柄 数 < 比 率 >	263 5	402 4	3,726 —	427,603 <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 銘柄 数 < 比 率 >	1,497 7	2,539 7	5,439 —	1,087,080 <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 (GENUSSCHEINE)	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 銘柄 数 < 比 率 >	210 4	583 5	4,716 —	808,840 <3.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
EQUINOR ASA	33	54	1,659	24,577	石油・ガス・消耗燃料	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	33 1	54 1	1,659 —	24,577 <0.1%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
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 銘柄 数 < 比 率 >	61 1	212 1	19,760 —	450,730 <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	
DEUTSCHE TELEKOM-REG		133	222	483	82,337	各種電気通信サービス
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
AIR 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 DISENO 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	
			買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	SP500MIC	百万円 363	百万円 —

\*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	
	評 価 額	比 率
株式	千円 26,205,121	% 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。