

# J P 日米バランスファンド

## <愛称：J P 日米>

追加型投信／内外／資産複合

### 交付運用報告書

第11期(決算日2022年2月15日)

作成対象期間(2021年8月17日～2022年2月15日)

第11期末(2022年2月15日)	
基準価額	9,868円
純資産総額	2,824百万円
第11期	
騰落率	△ 5.0%
分配金(税込み)合計	30円

(注) 騰落率は分配金(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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

- 交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書(全体版)に記載しております。
- 当ファンドは、投資信託約款において運用報告書(全体版)に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供することができる旨を定めております。運用報告書(全体版)は J P 投信のホームページで閲覧・ダウンロードしていただけます。
- 運用報告書(全体版)は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

<運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法>

右記ホームページを開く

⇒「ファンド情報」を選択

⇒「ファンド名」を選択

⇒ファンド詳細ページから「運用報告書(全体版)」を選択

#### 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。

さて、当ファンドは、このたび上記の決算を行いました。

当ファンドは、日本と米国の債券と株式に資産を分散することで、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行いました。

ここに、当作成対象期間の運用状況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。

## JP投信株式会社

東京都中央区日本橋本町一丁目5番11号

<当運用報告書についてのお問い合わせ>

ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp

サポートダイヤル：0120-104-017

(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

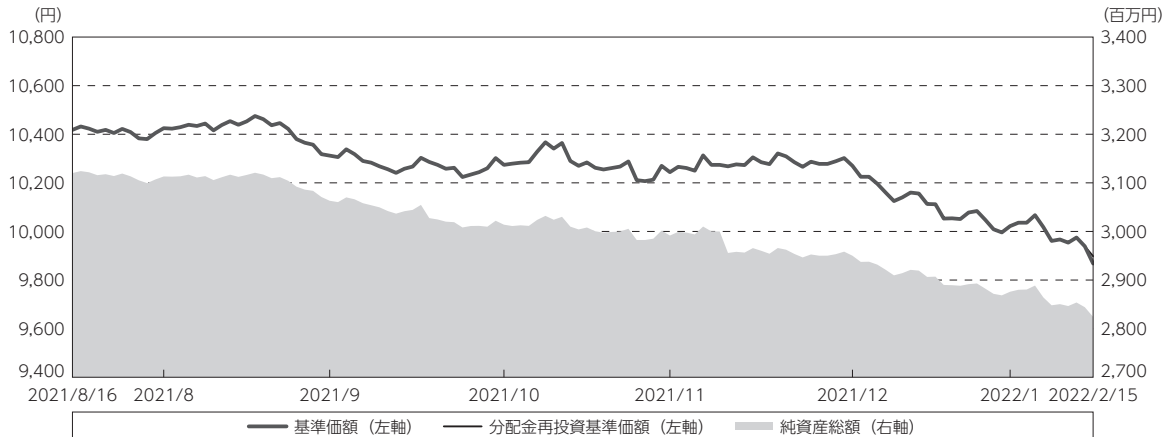
<お客様の取引内容についてのお問い合わせ>

お取扱いの販売会社にお問い合わせください。

## 運用経過

## 期中の基準価額等の推移

(2021年8月17日～2022年2月15日)



期首：10,418円

期末：9,868円 (既払分配金(税込み):30円)

騰落率：△ 5.0% (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。  
 (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、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2021年8月16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) 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10,418円から期末9,868円となりました。なお、当期末には1万口当たり30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下がり額は520円となりました。

投資対象とする3本の組入投資信託証券の当期間の値動きは、日米債券、日本株式、および米国株式が下落しました。日米債券の下落が主な値下がり要因となりました。

## 1 万口当たりの費用明細

(2021年8月17日～2022年2月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	24 円	0.232 %	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(10)	(0.099)	委託した資金の運用の対価
( 販 売 会 社 )	(12)	(0.116)	交付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、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	( 2 )	(0.017)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 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
合 計	24	0.234	
期中の平均基準価額は、10,257円です。			

(注) 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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

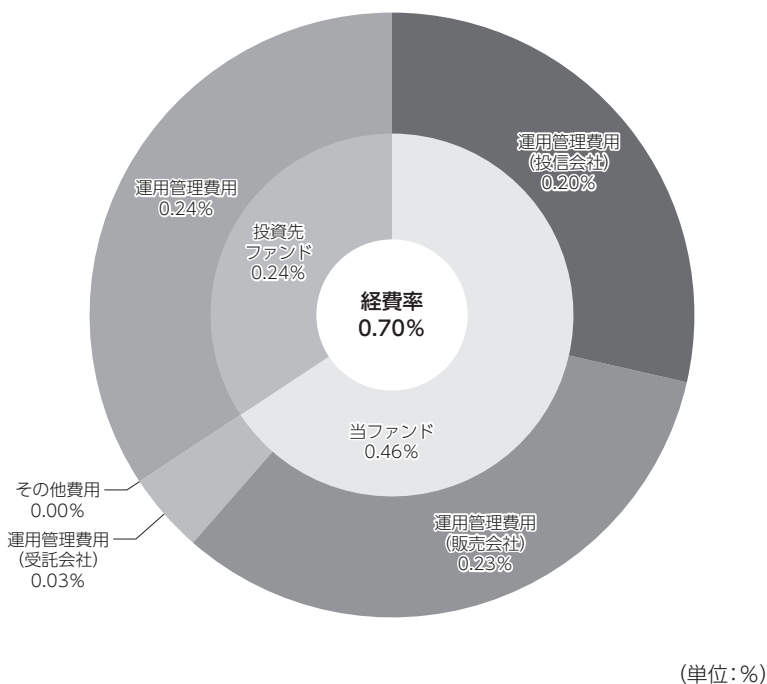
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(注) 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)

## ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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、売買委託手数料およ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経費率（年率）は0.70%です。



経費率 (①+②)	0.70
①当ファンドの費用の比率	0.46
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.24

(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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

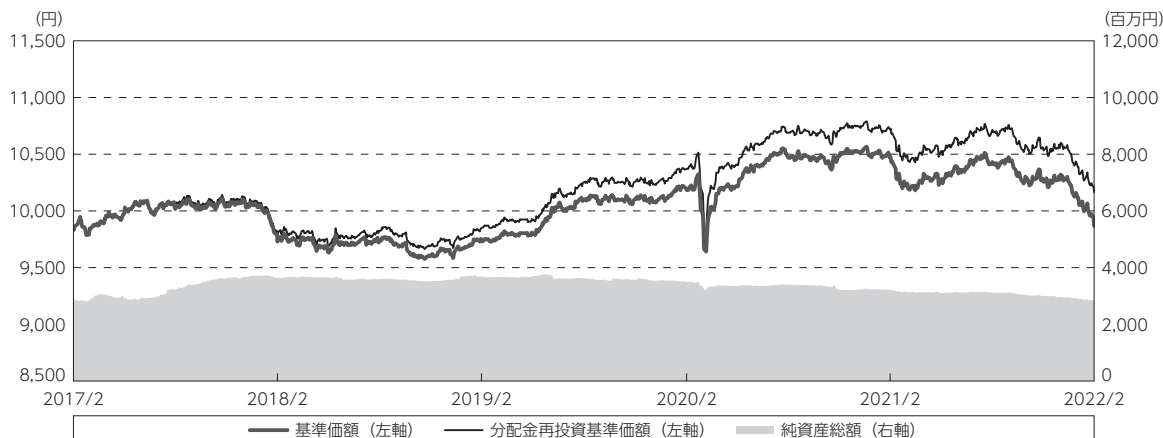
(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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。

## 最近5年間の基準価額等の推移

(2017年2月15日～2022年2月15日)



- (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。  
 (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、お客様の損益の状況を示すものではありません。  
 (注) 分配金再投資基準価額は、2017年2月15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。

	2017年2月15日 決算日	2018年2月15日 決算日	2019年2月15日 決算日	2020年2月17日 決算日	2021年2月15日 決算日	2022年2月15日 決算日
基準価額 (円)	9,843	9,729	9,731	10,185	10,466	9,868
期間分配金合計(税込み) (円)	—	60	60	60	60	60
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 0.6	0.6	5.3	3.3	△ 5.2
純資産総額 (百万円)	2,815	3,616	3,670	3,488	3,213	2,824

- (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。  
 (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。  
 (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。  
 (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

## 投資環境

(2021年8月17日～2022年2月15日)

日本債券市場	期を通じて、日本債券市場(日本10年国債)は利回りが上昇(価格が下落)しました。2021年8月中旬から10月にかけては、国内の株式市場が上昇し投資家のリスク選好姿勢が強まったことや、米国で物価上昇を背景に金融政策の正常化が早まるとの見方が強まり、米長期金利が上昇したことなどから債券は売られました。11月から12月中旬にかけては、11月のFOMC(米連邦公開市場委員会)でパウエルFRB(米連邦準備制度理事会)議長が早期利上げに消極的な姿勢を示したことや、感染力の強いオミクロン株の発生を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから買われました。12月下旬以降は、FRBによる米国金融政策の引き締めが加速するとの見方が強まったことや、ECB(欧州中央銀行)が金融政策の正常化に舵を切る姿勢を示したことなどから各国の債券利回りが急上昇し、連れて日本債券も売られました。
米国債券市場	期を通じて、米国債券市場(米国10年国債)は利回りが上昇(価格が下落)しました。2021年8月中旬から9月中旬にかけては、デルタ株の世界的な感染拡大を受けてリスク回避姿勢が強まり買われる一方、物価上昇への懸念を背景に売られる場面もあり、一進一退の展開となりました。その後、9月下旬から10月にかけては、米国で物価上昇を背景に金融政策の正常化が早まるとの見方が強まったことなどから債券は売られました。11月から12月中旬にかけては、11月のFOMCでパウエルFRB議長が早期利上げに消極的な姿勢を示したことや、感染力の強いオミクロン株の発生を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから買われましたが、12月下旬以降は、2022年1月のFOMCの結果などを受け、米国金融政策の引き締めが加速するとの見方が強まったことなどから、債券は売られました。
日本株式市場	期を通じて、日本株式市場(日経平均株価)は下落しました。2021年8月中旬から10月上旬にかけては、菅首相が自民党総裁選への不出馬を表明し次期首相の政策への期待から上昇する場面もありましたが、その後中国恒大集団の債務問題や世界的な物価上昇懸念を背景にリスク回避姿勢が強まると上げ幅を縮めました。10月中旬から11月中旬にかけては、好決算を背景に米国株式市場が上昇したことや、円安ドル高の進展などから上昇しました。11月下旬から2022年1月上旬にかけては、感染力の強いオミクロン株の発生を受けてリスク回避姿勢が強まり一時急落する場面もありましたが、その後米国株式市場が一時最高値を更新したことなどを背景に上昇するなど一進一退の展開となりました。1月中旬以降は、FRBによる米国金融政策の引き締めが加速するとの見方が強まったことやウクライナ情勢の緊迫化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、軟調に推移しました。
米国株式市場	期を通じて、米国株式市場(NYダウ)は下落しました。2021年8月中旬から10月上旬にかけては、デルタ株の世界的な感染拡大や中国恒大集団の債務問題、世界的な物価上昇懸念を背景にリスク回避姿勢が強まり下落しました。その後10月中旬から11月中旬にかけては、好調な企業決算が相次いだことなどから大きく反発しました。11月下旬から2022年1月上旬にかけては、感染力の強いオミクロン株の発生を受けて一時急落する場面もありましたが、その後消費の堅調さが確認されたことなどから上昇するなど一進一退の展開となりました。1月中旬以降は、FRBによる米国金融政策の引き締めが加速するとの見方が強まったことやウクライナ情勢の緊迫化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、軟調に推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

(2021年8月17日～2022年2月15日)

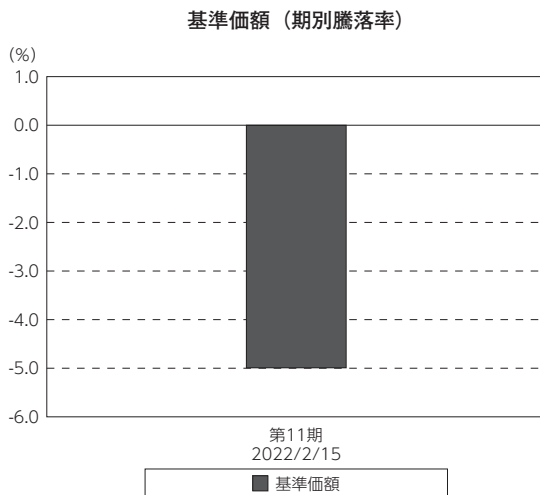
組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、当ファンドにおける日々の追加設定解約に対応した投資信託証券の売買を行うことなどにより、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

(2021年8月17日～2022年2月15日)

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

右記のグラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

## 分配金

(2021年8月17日～2022年2月15日)

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案し以下のとおりといたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり、税込み)

項目	第11期
	2021年8月17日～ 2022年2月15日
当期分配金	30
(対基準価額比率)	0.303%
当期の収益	30
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	598

(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

引き続き、組入投資信託証券を通じて、日米債券、日本株式、米国株式に分散投資を行い、信託財産の着実な成長を目指します。

実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## お知らせ

該当事項はございません。

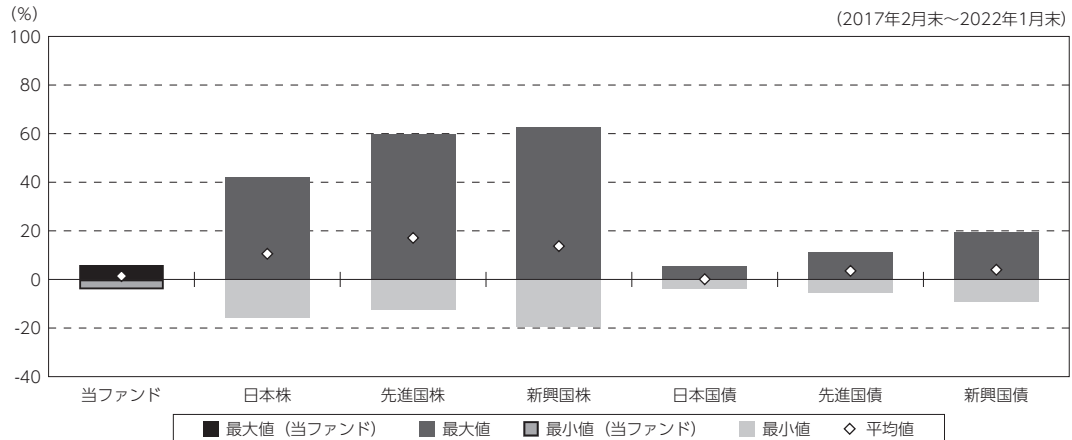


## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	無期限 (2016年10月27日設定)	
運用方針	<p>日本と米国の債券に90%、日本株式に5%、米国株式に5%投資することを基本とします。債券運用で利子収入を獲得し、安定的な収益の確保を目指します。また、株式に投資することで中長期的な成長の享受を目指します。</p> <p>株式に投資する投資対象ファンドは、日経平均株価、ダウ・ジョーンズ工業株価平均と連動する投資成果を目指して運用を行います。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。</p> <p>&lt;基本組入比率&gt;</p> <p>日米債券：90%</p> <p>日本株式：5%</p> <p>米国株式：5%</p>	
主要投資対象	J P 日米バランスファンド	野村FoFs用・日米債券ファンド (適格機関投資家専用)、野村FoFs用・日経225インデックスファンド (適格機関投資家専用)、野村FoFs用・NYダウインデックスファンド (適格機関投資家専用) を主要投資対象とします。
	野村FoFs用・日米債券ファンド (適格機関投資家専用)	米国の国債および日本国債と同等程度以上の信用格付けを有する日米の社債 (日本の社債には、財投機関債を含みます) を主要投資対象とします。
	野村FoFs用・日経225インデックスファンド (適格機関投資家専用)	日本株式を主要投資対象とします。
	野村FoFs用・NYダウインデックスファンド (適格機関投資家専用)	米国株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</p> <p>デリバティブの直接利用は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>	
運用方法	主として、日本と米国の債券、日本と米国の株式を実質的な主要投資対象とする投資対象ファンドへの投資を通じて、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>	

## (参考情報)

## ○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位: %)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	5.9	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値	△ 4.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 5.4	△ 9.4
平均値	1.4	10.6	17.1	13.7	0.1	3.5	4.0

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2017年2月から2022年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドは2017年10月以降の年間騰落率を用いております。

(注) 上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 各資産クラスの指数

日本株・・・TOPIX (東証株価指数、配当込み)

先進国株・・・MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株・・・MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債・・・NOMURA-BPI 国債

先進国債・・・FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

新興国債・・・JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

## 各資産クラスの騰落率について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPIに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド (円ベース) に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

## 当ファンドのデータ

## 組入資産の内容

(2022年2月15日現在)

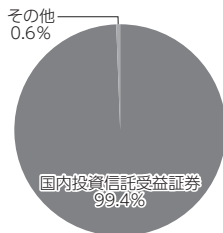
## ○組入上位ファンド

銘 柄 名	第11期末
	%
野村FoFs用・日米債券ファンド(適格機関投資家専用)	89.7
野村FoFs用・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用)	4.9
野村FoFs用・NYダウインデックスファンド(適格機関投資家専用)	4.9
組入銘柄数	3銘柄

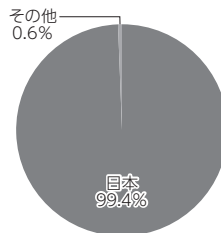
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

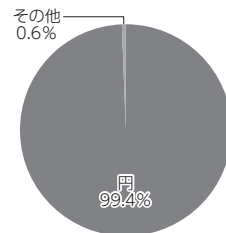
## ○資産別配分



## ○国別配分



## ○通貨別配分



(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

## 純資産等

項 目	第11期末
	2022年2月15日
純 資 産 総 額	2,824,257,716円
受 益 権 総 口 数	2,862,133,395口
1万円当たり基準価額	9,868円

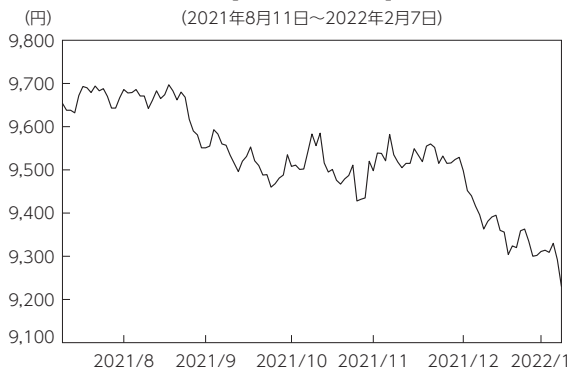
(注) 期中における追加設定元本額は61,980,271円、同解約元本額は194,858,031円です。

## 組入上位ファンドの概要

## 野村FoFs用・日米債券ファンド（適格機関投資家専用）

【基準価額の推移】

(2021年8月11日～2022年2月7日)



(注) 上記グラフは分配金再投資基準価額です。

【1万口当たりの費用明細】

(2021年8月11日～2022年2月7日)

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 信 託 報 酬	12	0.125
( 投 信 会 社 )	(10)	(0.109)
( 販 売 会 社 )	( 1)	(0.005)
( 受 託 会 社 )	( 1)	(0.011)
(b) そ の 他 費 用	0	0.004
( 保 管 費 用 )	( 0)	(0.003)
( 監 査 費 用 )	( 0)	(0.001)
( そ の 他 )	( 0)	(0.000)
合 計	12	0.129

期中の平均基準価額は、9,508円です。

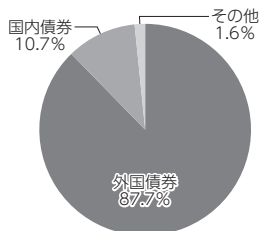
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

## 【組入上位10銘柄】

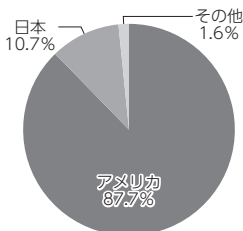
	銘 柄 名	業 種 / 種 別 等	通 貨	国 ( 地 域 )	比 率
1	US TREASURY N/B 2.75% 2028/2/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.5
2	US TREASURY N/B 1.125% 2031/2/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.5
3	US TREASURY N/B 2.625% 2029/2/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.5
4	US TREASURY N/B 1.5% 2030/2/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.4
5	US TREASURY N/B 1.25% 2031/8/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.4
6	US TREASURY N/B 0.625% 2030/8/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.4
7	US TREASURY N/B 2.25% 2027/8/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.4
8	US TREASURY N/B 2.875% 2028/8/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.4
9	US TREASURY BOND 6.125% 2029/8/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.3
10	US TREASURY N/B 2.25% 2027/2/15	国債証券	米ドル	アメリカ	4.1
	組入銘柄数		71銘柄		

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

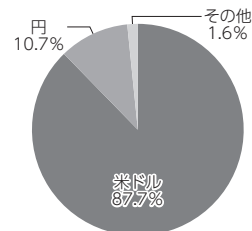
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 上記の比率は全て純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。

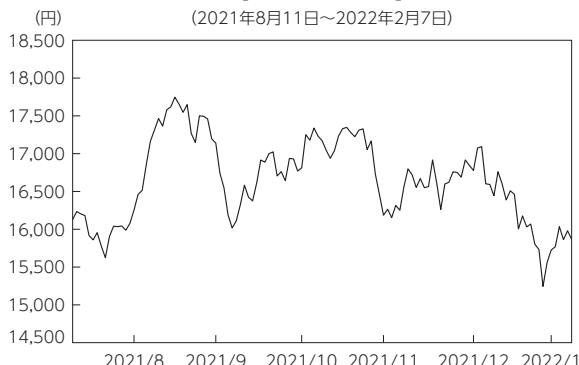
(注) 国 (地域) および国別配分は、原則として発行国 (地域) もしくは投資国 (地域) を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(注) 組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2022年2月7日現在のものです。

野村FoFs用・日経225インデックスファンド (適格機関投資家専用)

【基準価額の推移】



(注) 上記グラフは分配金再投資基準価額です。

【1万口当たりの費用明細】

(2021年8月11日～2022年2月7日)

項目	当期	
	金額	比率
(a) 信託報酬 ( 投信会社 ) ( 販売会社 ) ( 受託会社 )	13 (10) ( 1 ) ( 2 )	0.076 (0.060) (0.005) (0.011)
(b) 売買委託手数料 ( 株 ) ( 先物・オプション )	0 ( 0 ) ( 0 )	0.002 (0.000) (0.002)
(c) その他費用 ( 監査費用 )	0 ( 0 )	0.002 (0.002)
合計	13	0.080

期中の平均基準価額は、16,482円です。

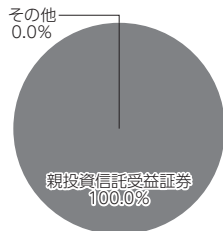
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

【組入上位ファンド】

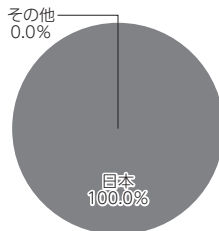
銘柄名	第11期末
ミリオン・インデックスマザーファンド	100.0 %
組入銘柄数	1銘柄

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

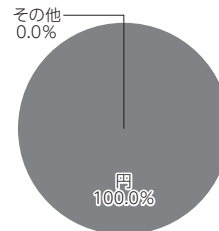
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 上記の比率は全て純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。

(注) 国別配分は、原則として発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(注) 組入上位ファンド、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2022年2月7日現在のものです。

<ご参考> ミリオン・インデックスマザーファンド

【基準価額の推移】



【1万口当たりの費用明細】

(2020年11月10日～2021年11月8日)

項目	当期	
	金額	比率
	円	%
(a) 売買委託手数料	1	0.003
(株 式)	(0)	(0.000)
(先物・オプション)	(1)	(0.003)
合計	1	0.003
期中の平均基準価額は、18,012円です。		

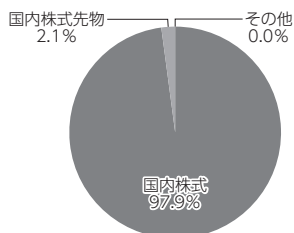
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

【組入上位10銘柄】

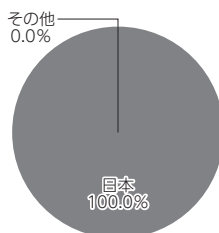
銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1 ファーストリテイリング	小売業	円	日本	9.2%
2 東京エレクトロン	電気機器	円	日本	6.7%
3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	円	日本	4.3%
4 ダイキン工業	機械	円	日本	3.0%
5 リクルートホールディングス	サービス業	円	日本	2.8%
6 ファナック	電気機器	円	日本	2.6%
7 KDDI	情報・通信業	円	日本	2.4%
8 信越化学工業	化学	円	日本	2.4%
9 アドバンテスト	電気機器	円	日本	2.4%
10 テルモ	精密機器	円	日本	2.3%
組入銘柄数		226銘柄		

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

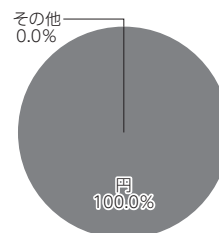
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 上記の比率は全て純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。

(注) 国(地域)および国別配分は、原則として発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

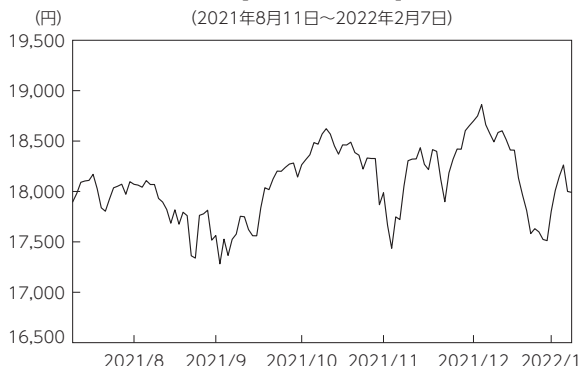
(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(注) 組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2021年11月8日現在のものです。

## 野村FoFs用・NYダウインデックスファンド (適格機関投資家専用)

## 【基準価額の推移】

(2021年8月11日～2022年2月7日)



(注) 上記グラフは分配金再投資基準価額です。

## 【1万口当たりの費用明細】

(2021年8月11日～2022年2月7日)

項 目	当 期	
	金 額	比 率
	円	%
(a) 信 託 報 酬	16	0.087
( 投 信 会 社 )	(13)	(0.071)
( 販 売 会 社 )	( 1)	(0.005)
( 受 託 会 社 )	( 2)	(0.011)
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002
( 株 式 )	( 0)	(0.000)
( 投 資 信 託 証 券 )	( 0)	(0.000)
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	( 0)	(0.001)
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000
( 株 式 )	( 0)	(0.000)
( 投 資 信 託 証 券 )	( 0)	(0.000)
(d) そ の 他 費 用	6	0.033
( 保 管 費 用 )	( 5)	(0.029)
( 監 査 費 用 )	( 0)	(0.002)
( そ の 他 )	( 1)	(0.003)
合 計	22	0.122

期中の平均基準価額は、18,064円です。

(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書 (全体版) をご参照ください。

## 【組入上位ファンド】

銘 柄 名	第11期末
NYダウインデックスマザーファンド	% 97.6
組入銘柄数	1銘柄

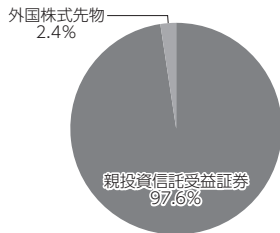
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書 (全体版) に記載しております。

## 【組入上位10銘柄】

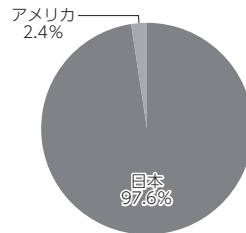
	銘 柄 名	業 種 / 種 別 等	通 貨	国 ( 地 域 )	比率
1	DJIAMICR2203	株式先物(買建)	米ドル	アメリカ	% 2.4
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-
	組入銘柄数				1銘柄

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書 (全体版) に記載しております。

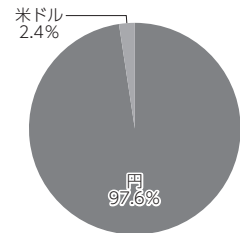
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



- (注) 上記の比率は全て純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。  
 (注) 国（地域）および国別配分は、原則として発行国（地域）もしくは投資国（地域）を表示しております。  
 (注) 組入上位ファンド、組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2022年2月7日現在のものです。



## &lt;ご参考&gt; NYダウインデックスマザーファンド

## 【基準価額の推移】

(2021年2月9日～2022年2月7日)



## 【1万口当たりの費用明細】

(2021年2月9日～2022年2月7日)

項 目	当 期	
	金 額	比 率
	円	%
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式 ) ( 投 資 信 託 証 券 ) ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	1 ( 0 ) ( 0 ) ( 0 )	0.004 ( 0.002 ) ( 0.001 ) ( 0.001 )
(b) 有 価 証 券 取 引 税 ( 株 式 ) ( 投 資 信 託 証 券 )	0 ( 0 ) ( 0 )	0.000 ( 0.000 ) ( 0.000 )
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	11 ( 11 ) ( 0 )	0.049 ( 0.048 ) ( 0.001 )
合 計	12	0.053

期中の平均基準価額は、22,035円です。

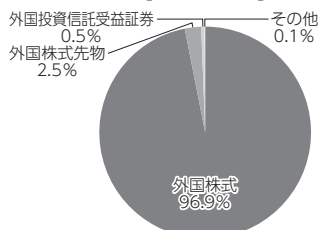
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

## 【組入上位10銘柄】

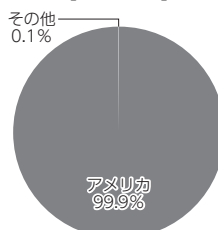
	銘 柄 名	業 種 / 種 別 等	通 貨	国 ( 地 域 )	比率
					%
1	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	米ドル	アメリカ	8.8
2	GOLDMAN SACHS GROUP	資本市場	米ドル	アメリカ	6.7
3	HOME DEPOT	専門小売り	米ドル	アメリカ	6.5
4	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	米ドル	アメリカ	5.6
5	MCDONALD'S CORP	ホテル・レストラン・レジャー	米ドル	アメリカ	4.7
6	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	米ドル	アメリカ	4.2
7	AMGEN INC	バイオテクノロジー	米ドル	アメリカ	4.0
8	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア	米ドル	アメリカ	4.0
9	BOEING CO	航空宇宙・防衛	米ドル	アメリカ	3.8
10	CATERPILLAR INC DEL	機械	米ドル	アメリカ	3.6
	組入銘柄数		32銘柄		

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

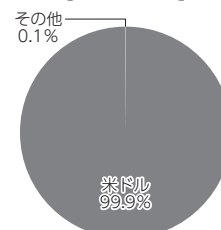
## 【資産別配分】



## 【国別配分】



## 【通貨別配分】



(注) 上記の比率は全て純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。

(注) 国(地域)および国別配分は、原則として発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(注) 組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2022年2月7日現在のものです。