

J P 日米バランスファンド(DC)

追加型投信／内外／資産複合

交付運用報告書

第6期(決算日2023年2月15日)

作成対象期間(2022年2月16日～2023年2月15日)

| 第6期末(2023年2月15日) | |
|------------------|--------|
| 基準価額 | 9,282円 |
| 純資産総額 | 176百万円 |
| 第6期 | |
| 騰落率 | △ 9.2% |
| 分配金(税込み)合計 | 0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JP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人形町一丁目11番2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)

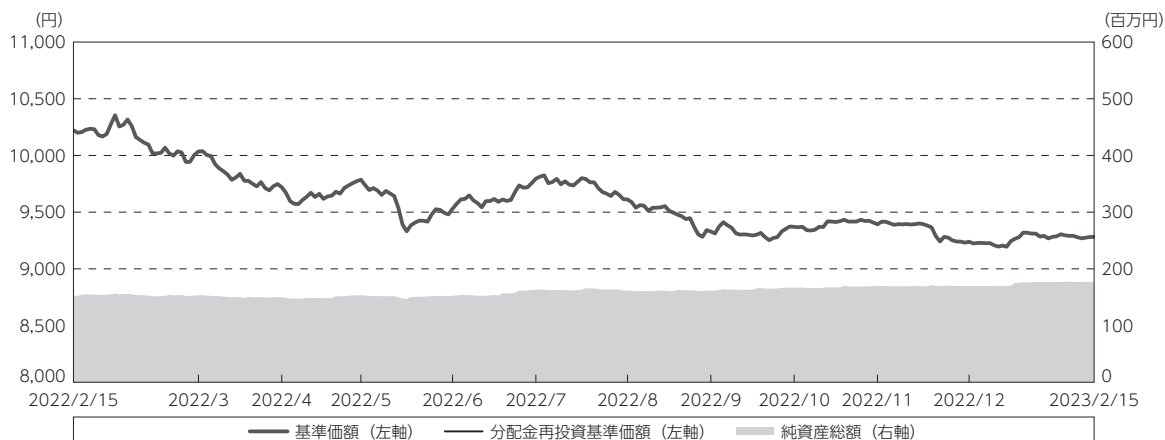
<お客様の取引内容についてのお問い合わせ>

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

(2022年2月16日～2023年2月15日)



期首：10,222円

期末：9,282円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 9.2% (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(2022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。

(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10,222円から期末9,282円となり、値下がり額は940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、米国株式が下落し、日本株式が上昇しました。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

(2022年2月16日～2023年2月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|---------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 20 円 | 0.209 % | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| (投 信 会 社) | (8) | (0.088) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販 売 会 社) | (8) | (0.088) | 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) | (3) | (0.033) | 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 | 0.004 | (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) | (0.004) | 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 | 20 | 0.213 | |
| 期中の平均基準価額は、9,605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。

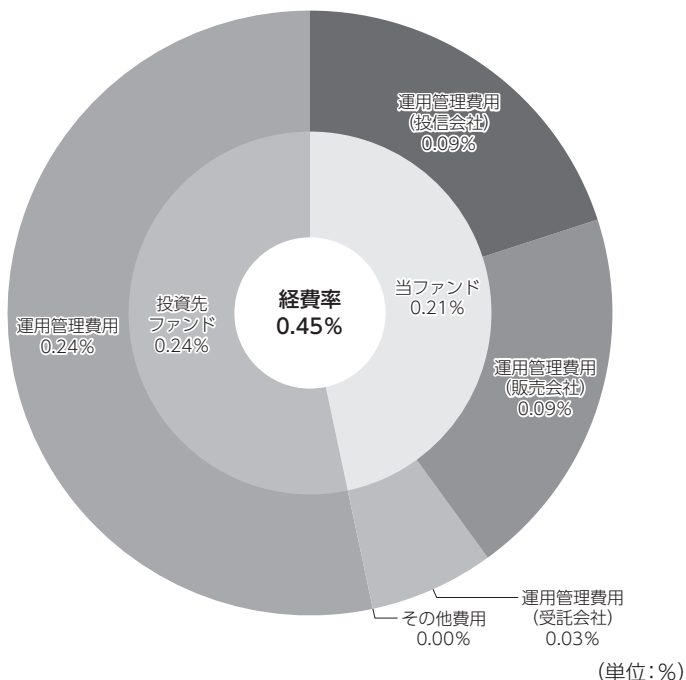
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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0.45%です。



| | |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②) | 0.45 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.21 |
| 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。

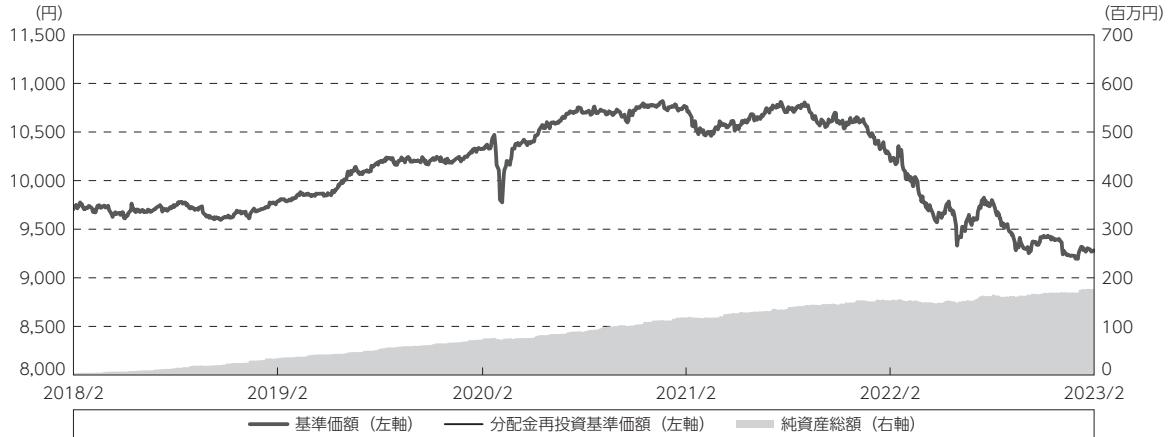
(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(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

(2018年2月15日～2023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、2018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。

| | 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 | 2023年2月15日 決算日 |
|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (円) | 9,706 | 9,788 | 10,330 | 10,749 | 10,222 | 9,282 |
| 期間分配金合計(税込み) (円) | — | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額騰落率 (%) | — | 0.8 | 5.5 | 4.1 | △ 4.9 | △ 9.2 |
| 純資産総額 (百万円) | 3 | 34 | 72 | 118 | 152 | 176 |

- (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

(2022年2月16日～2023年2月15日)

| | |
|--------|--|
| 日本債券市場 | <p>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。2022年2月中旬から3月上旬にかけて、ウクライナを巡る地政学リスクの高まりを受けてリスク回避姿勢が強まり、相対的に安全資産とされる債券は買われました。3月中旬から12月中旬にかけては、日銀金融政策決定会合で強力な金融緩和策の維持を決定し買われる局面や、米国の金融引き締めへの懸念が強まり売られる局面もありましたが、日銀が指値オペなどを通じて金利上昇を抑制する姿勢を示したことなどから、債券の値動きは限定的となりました。12月下旬から2023年1月上旬にかけては、日銀が金融政策決定会合で、従来の金融緩和策の一部修正し、長短金利操作(イールドカーブコントロール)について、長期金利(10年国債金利)の変動許容幅を従来の±0.25%程度から±0.50%程度へと拡大したことなどから日本国債は大きく売られました。その後、1月中旬の金融政策決定会合で金融緩和策の維持を決定し買われる局面もありましたが、その後発表された東京都部のCPI(消費者物価指数)が市場予想を上回ったことなどから日本国債は売られました。</p> |
| 米国債券市場 | <p>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。2022年2月中旬から3月上旬にかけてはウクライナを巡る地政学リスクの高まりを受けてリスク回避姿勢が強まり債券は買われました。その後、3月中旬から10月中旬にかけては、欧米で景気の減速を示す経済指標の発表が相次ぎ、先行き景気への懸念から債券は買われる局面もありましたが、物価上昇圧力の強さを示す経済指標が相次いで発表され、FRB(米連邦準備制度理事会)が金融引き締めを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。10月下旬から12月半ばにかけては、10月の米CPIの伸び率が予想を下回るなど、インフレの鈍化を示す指標の発表が相次ぎ、債券の価格は堅調に推移しました。12月後半から2022年末にかけては、日銀が金融政策決定会合で長期金利の変動許容幅を拡大し、日本の長期債売りが米国債にも波及したことなどから売られました。その後、2023年に入り、米CPIの伸び率が鈍化し、金融引き締め長期化への懸念が後退したことから買われる一方、2月の雇用統計の結果を受けて一転して売りが優勢となるなど、一進一退となりました。</p> |
| 日本株式市場 | <p>期を通じて、日本株式市場(日経平均株価)は上昇しました。2022年2月中旬以降、ロシアによるウクライナ侵攻を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから下落しました。3月中旬から下旬にかけては、円安ドル高が加速し輸出企業の業績が改善するとの見方が強まったことなどから反発しました。4月から8月中旬にかけては、中国での新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界景気の下押し懸念が強まったことや、物価指標の上振れを受けてFRBが相次いで大幅な利上げを実施し、米国の景気後退懸念が強まったことなどから下落する一方、円安ドル高の進行や、国内の経済再開期待などから上昇する場面もあり、一進一退の展開となりました。8月下旬から9月末にかけては、米長期金利の上昇が一服したことなどから上昇する局面もあったものの、9月のFOMC(米連邦公開市場委員会)を受けて金融引き締めが想定よりも長期間続くとの見方から米国の景気悪化への懸念が高まり、米国株式市場の大幅な下落に追従したことなどから、下落しました。10月から11月にかけては、米国企業の好決算が発表されたことや、米CPIの上昇が一服したことなどから上昇したものの、12月から2023年1月上旬にかけては、日銀が12月の金融政策決定会合で長期金利の変動許容幅の拡大を決定したことなどから下落しました。その後は日銀が2023年1月の金融政策決定会合で金融緩和策の維持を決定すると、買い戻しが優勢となり反発しました。</p> |
| 米国株式市場 | <p>期を通じて、米国株式市場(NYダウ)は下落しました。2022年2月中旬以降はロシアによるウクライナ侵攻を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから下落しました。その後3月中旬から下旬にかけては、ロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待などから一時上昇しました。4月から6月中旬にかけては、中国での新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界景気への懸念が高まったことや、物価指標の上振れを受けてFRBが相次いで大幅な利上げを実施し、米国の景気後退への懸念が強まったことなどから大幅に下落しました。6月下旬から8月中旬にかけては、7月の米CPIの伸び率が予想を下回り、FRBによる利上げ加速観測が後退したことなどから上昇しました。8月下旬から10月上旬にかけては、FRBによる金融引き締めが長期化するとの見方が改めて強まり、米国の景気悪化への懸念が高まったことなどから下落しました。10月中旬から11月下旬にかけては、米主要企業の決算が相次いで市場予想を上回ったことや、インフレの鈍化を示す米CPIが発表され、FRBが利上げペースを緩めるとの見方が強まったことなどから堅調に推移しました。その後は12月のFOMCで政策金利見通しが引き上げられたことから下落する局面もあった一方、米CPIの伸び率が鈍化し、金融引き締め長期化への懸念が後退したことから上昇する局面もあり、一進一退となりました。</p> |

当ファンドのポートフォリオ

(2022年2月16日～2023年2月15日)

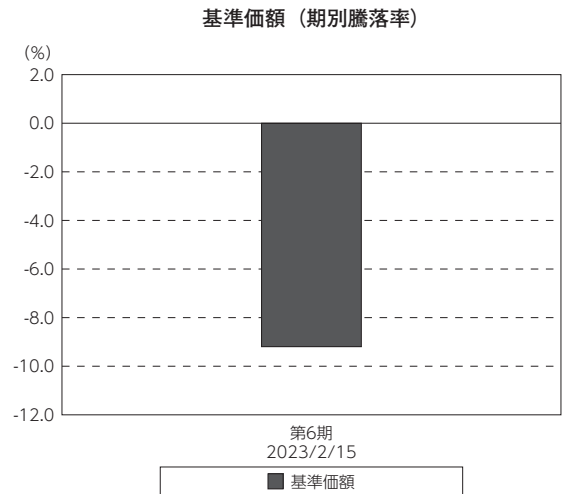
組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、当ファンドにおける日々の追加設定解約に対応した投資信託証券の売買を行うことなどにより、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年2月16日～2023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いません。

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

(2022年2月16日～2023年2月15日)

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、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、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6期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2022年2月16日～ 2023年2月15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 | 1,016 |

(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

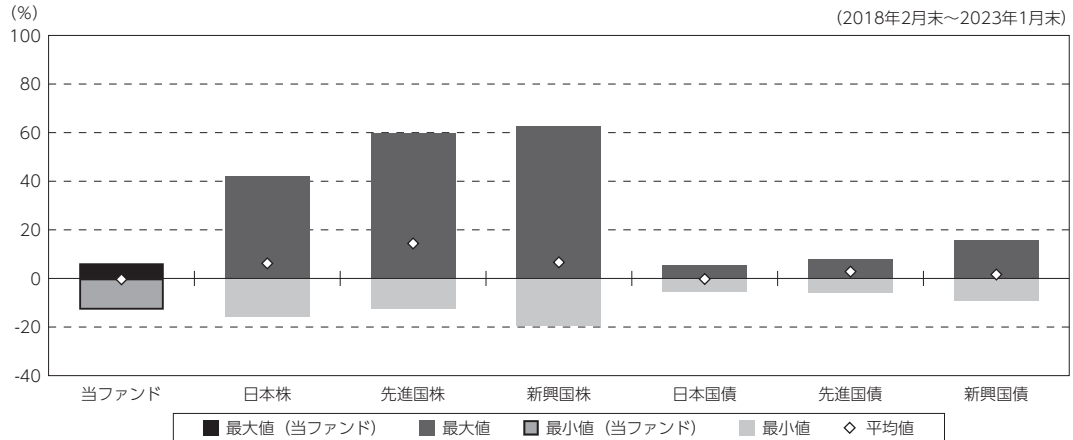
該当事項はございません。

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 (2017年8月31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><基本組入比率></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(DC) | 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 | 6.2 | 42.1 | 59.8 | 62.7 | 5.4 | 7.9 | 15.7 |
| 最小値 | △ 12.9 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 9.4 |
| 平均値 | △ 0.4 | 6.2 | 14.4 | 6.6 | △ 0.2 | 2.8 | 1.6 |

(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) 2018年2月から2023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2018年8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株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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

(2023年2月15日現在)

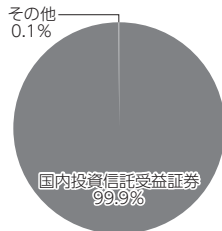
○組入上位ファンド

| 銘 柄 名 | 第6期末 |
|------------------------------------|------|
| | % |
| 野村FoFs用・日米債券ファンド(適格機関投資家専用) | 90.2 |
| 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 |

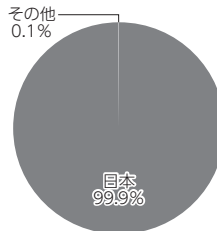
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(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。

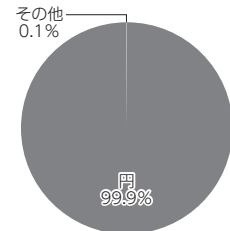
○資産別配分



○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6期末 |
|------------|--------------|
| | 2023年2月15日 |
| 純資産総額 | 176,304,576円 |
| 受益権総口数 | 189,949,343口 |
| 1万円当たり基準価額 | 9,282円 |

(注) 期中における追加設定元本額は52,401,263円、同解約元本額は11,959,415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】



【1万口当たりの費用明細】

(2022年8月9日～2023年2月7日)

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------|-------|-----------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 信 託 報 酬 | 10 | 0.127 |
| (投 信 会 社) | (9) | (0.110) |
| (販 売 会 社) | (0) | (0.006) |
| (受 託 会 社) | (1) | (0.011) |
| (b) そ の 他 費 用 | 1 | 0.009 |
| (保 管 費 用) | (1) | (0.007) |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.001) |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) |
| 合 計 | 11 | 0.136 |

期中の平均基準価額は、8,271円です。

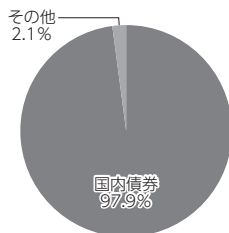
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

【組入上位10銘柄】

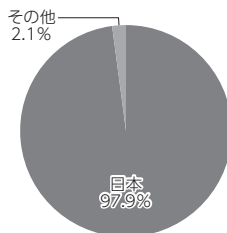
| | 銘 柄 名 | 業 種 / 種 別 等 | 通 貨 | 国 (地 域) | 比 率 |
|----|-----------------------------|-------------|------|-----------|-----|
| 1 | 国庫債券 利付(20年)第105回 | 国債 | 円 | 日本 | 8.2 |
| 2 | 国庫債券 利付(20年)第101回 | 国債 | 円 | 日本 | 7.8 |
| 3 | 国庫債券 利付(20年)第121回 | 国債 | 円 | 日本 | 7.4 |
| 4 | 国庫債券 利付(20年)第130回 | 国債 | 円 | 日本 | 6.8 |
| 5 | 国庫債券 利付(20年)第125回 | 国債 | 円 | 日本 | 6.4 |
| 6 | 東日本旅客鉄道 第86回社債間限定同順位特約付 | 社債 | 円 | 日本 | 4.8 |
| 7 | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第83回 | 特殊債 | 円 | 日本 | 4.8 |
| 8 | 日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付 | 社債 | 円 | 日本 | 4.5 |
| 9 | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第57回 | 特殊債 | 円 | 日本 | 4.4 |
| 10 | 三菱地所 第132回担保提供制限等財務上特約無 | 社債 | 円 | 日本 | 4.3 |
| | 組入銘柄数 | | 22銘柄 | | |

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

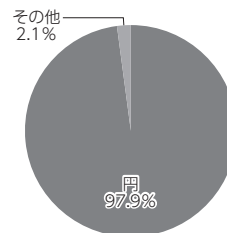
【資産別配分】



【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。

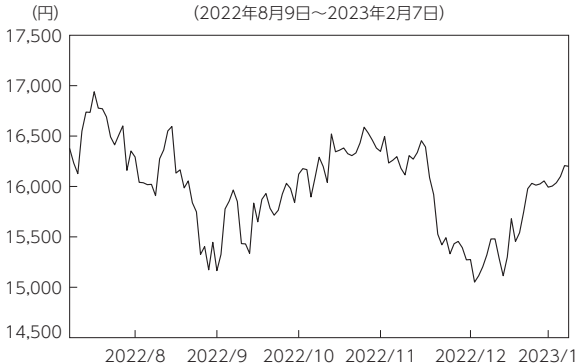
(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(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2023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】

(2022年8月9日～2023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】

(2022年8月9日～2023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) | 12 (10) (1) (2) | 0.077 (0.061) (0.006) (0.011) |
| (b) 売買委託手数料 (株 式) (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 | 12 | 0.081 |

期中の平均基準価額は、15,865円です。

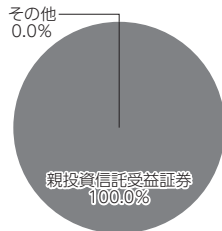
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

【組入上位ファンド】

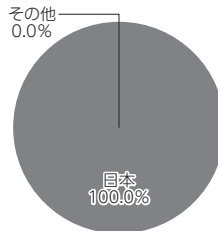
| 銘柄名 | 第13期末 |
|--------------------|---------|
| ミリオン・インデックスマザーファンド | 100.0 % |
| 組入銘柄数 | 1銘柄 |

(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。

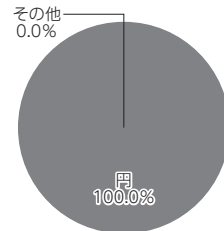
【資産別配分】



【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。

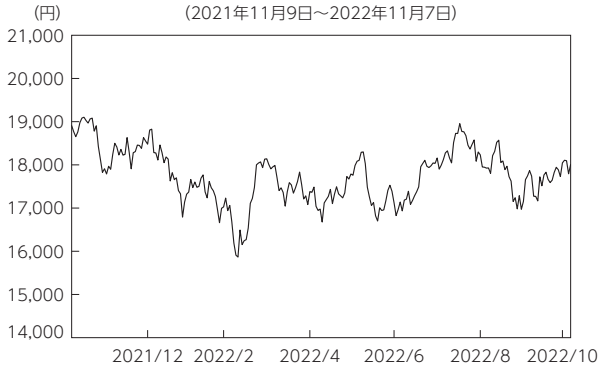
(注) 国別配分は、原則として発行国(地域)もしくは投資国(地域)を表示しております。

(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2023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】

(2021年11月9日～2022年11月7日)

| 項目 | 当期 | |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | 金額 | 比率 |
| | 円 | % |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) | 1 (0) (1) | 0.003 (0.000) (0.003) |
| 合計 | 1 | 0.003 |
| 期中の平均基準価額は、17,676円です。 | | |

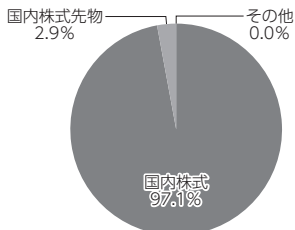
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

【組入上位10銘柄】

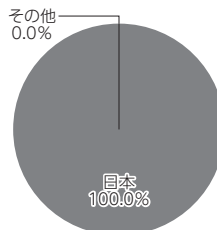
| | 銘柄名 | 業種/種別等 | 通貨 | 国(地域) | 比率 |
|-------|--------------|----------|-------|-------|-------|
| 1 | ファーストリテイリング | 小売業 | 円 | 日本 | 10.1% |
| 2 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 円 | 日本 | 4.8 |
| 3 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 円 | 日本 | 4.8 |
| 4 | KDDI | 情報・通信業 | 円 | 日本 | 3.1 |
| 5 | 日経平均225 2212 | 株式先物(買建) | 円 | 日本 | 2.9 |
| 6 | ダイキン工業 | 機械 | 円 | 日本 | 2.8 |
| 7 | ファナック | 電気機器 | 円 | 日本 | 2.4 |
| 8 | テルモ | 精密機器 | 円 | 日本 | 2.1 |
| 9 | 信越化学工業 | 化学 | 円 | 日本 | 1.9 |
| 10 | アドバンテスト | 電気機器 | 円 | 日本 | 1.9 |
| 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。

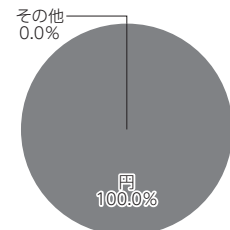
【資産別配分】



【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。

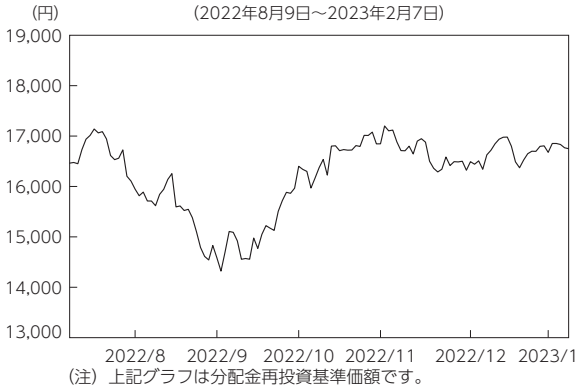
(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(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2022年11月7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】

(2022年8月9日～2023年2月7日)



【1万口当たりの費用明細】

(2022年8月9日～2023年2月7日)

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 信 託 報 酬 | 14 | 0.088 |
| (投 信 会 社) | (12) | (0.072) |
| (販 売 会 社) | (1) | (0.006) |
| (受 託 会 社) | (2) | (0.011) |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 4 | 0.023 |
| (株 式) | (2) | (0.010) |
| (投 資 信 託 証 券) | (0) | (0.000) |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (2) | (0.013) |
| (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 | 7 | 0.042 |
| (保 管 費 用) | (6) | (0.038) |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.002) |
| (そ の 他) | (0) | (0.002) |
| 合 計 | 25 | 0.153 |

期中の平均基準価額は、16,157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13期末 |
|-------------------|-------|
| NYダウインデックスマザーファンド | 99.6% |
| 組入銘柄数 | 1銘柄 |

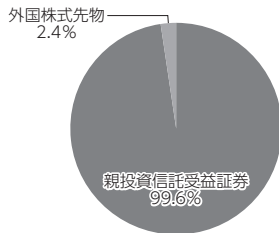
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

【組入上位10銘柄】

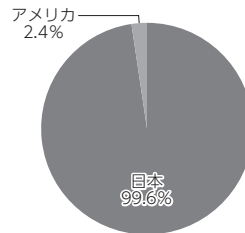
| | 銘 柄 名 | 業 種 / 種 別 等 | 通 貨 | 国 (地 域) | 比率 |
|----|--------------|-------------|-----|-----------|------|
| 1 | DJIAMICR2303 | 株式先物(買建) | 米ドル | アメリカ | 2.4% |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | - | - |
| 7 | - | - | - | - | - |
| 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。

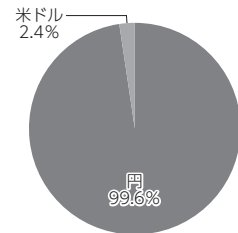
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】

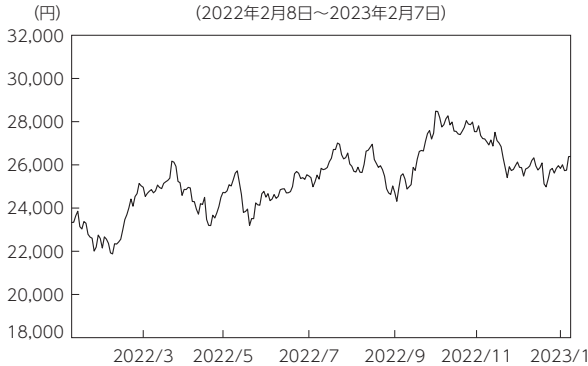


- (注) 上記の比率は全て純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。
 (注) 国（地域）および国別配分は、原則として発行国（地域）もしくは投資国（地域）を表示しております。
 (注) 組入上位ファンド、組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2023年2月7日現在のものです。

<ご参考> NYダウインデックスマザーファンド

【基準価額の推移】

(2022年2月8日～2023年2月7日)



【1万口当たりの費用明細】

(2022年2月8日～2023年2月7日)

| 項 目 | 当 期 | |
|---|------------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 8 (4) (0) (3) | 0.031 (0.017) (0.001) (0.013) |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) (0) | 0.001 (0.000) (0.000) |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 22 (22) (0) | 0.088 (0.087) (0.001) |
| 合 計 | 30 | 0.120 |

期中の平均基準価額は、25,467円です。

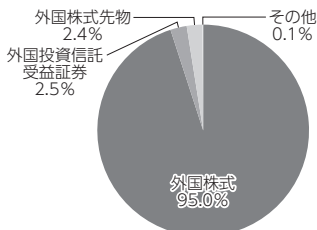
(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

【組入上位10銘柄】

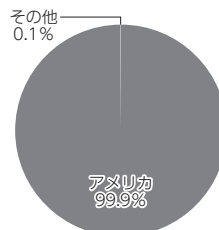
| | 銘 柄 名 | 業 種 / 種 別 等 | 通 貨 | 国 (地 域) | 比率 |
|-------|-----------------------------|-------------------------|------|-----------|-----|
| 1 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 米ドル | アメリカ | 8.8 |
| 2 | GOLDMAN SACHS GROUP | 資本市場 | 米ドル | アメリカ | 6.8 |
| 3 | HOME DEPOT | 専門小売り | 米ドル | アメリカ | 6.1 |
| 4 | MCDONALD'S CORP | ホテル・レストラン・レジャー | 米ドル | アメリカ | 4.9 |
| 5 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 米ドル | アメリカ | 4.7 |
| 6 | CATERPILLAR INC DEL | 機械 | 米ドル | アメリカ | 4.6 |
| 7 | AMGEN INC | バイオテクノロジー | 米ドル | アメリカ | 4.5 |
| 8 | VISA INC-CLASS A SHARES | 情報技術サービス | 米ドル | アメリカ | 4.2 |
| 9 | BOEING CO | 航空宇宙・防衛 | 米ドル | アメリカ | 3.8 |
| 10 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | コングロマリット | 米ドル | アメリカ | 3.8 |
| 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。

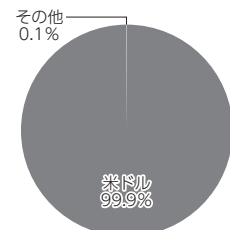
【資産別配分】



【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2023年2月7日現在のものです。