

# 世界銀行債券ファンド（毎月分配型） ＜愛称 ワールドサポーター＞

追加型投信／海外／債券

## 交付運用報告書

第197期（決算日2023年11月13日） 第198期（決算日2023年12月12日） 第199期（決算日2024年1月12日）  
第200期（決算日2024年2月13日） 第201期（決算日2024年3月12日） 第202期（決算日2024年4月12日）

作成対象期間（2023年10月13日～2024年4月12日）

第202期末（2024年4月12日）	
基準価額	2,746円
純資産総額	9,833百万円
第197期～第202期	
騰落率	8.6%
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旨を定めております。運用報告書（全体版）は、下記の手順にて閲覧・ダウンロードいただけます。

<運用報告書（全体版）の閲覧・ダウンロード方法>

右記URLにアクセス⇒ファンド検索機能を利用して該当ファンドのページを表示⇒運用報告書タブを選択⇒該当する運用報告書をクリックしてPDFファイルを表示

○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。

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、「世界銀行債券ファンド（毎月分配型）」は、2024年4月12日に第202期の決算を行ないました。

当ファンドは、主として、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を投資対象とする投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっておりました。

ここに、当作成対象期間の運用経過等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

<940860>

## 日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号  
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

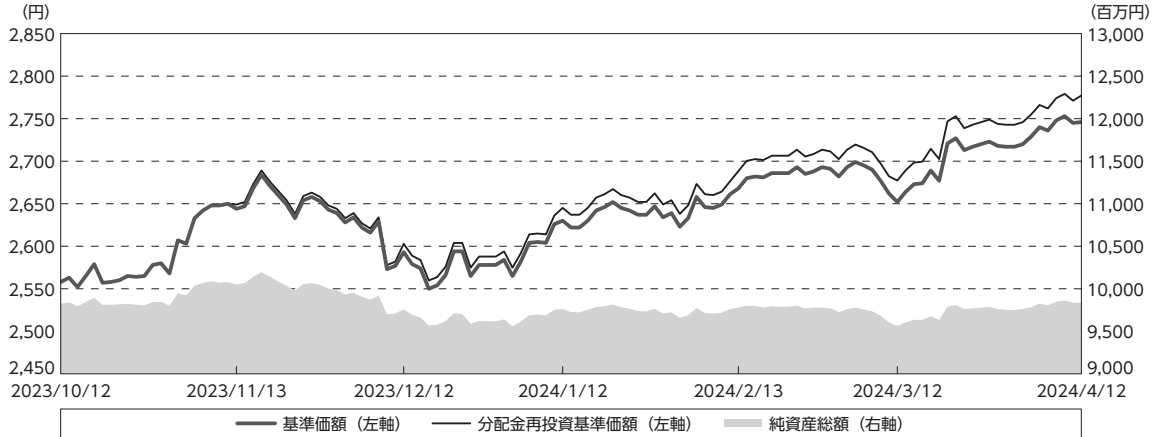
コールセンター 電話番号：0120-25-1404  
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

## 運用経過

## 作成期間中の基準価額等の推移

(2023年10月13日～2024年4月12日)



第197期首：2,558円

第202期末：2,746円 (既払分配金 (税込み)：30円)

騰落率：8.6% (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、作成期首 (2023年10月12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。
- (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。

## ○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を投資対象とする投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

## &lt;値上がり要因&gt;

- ・高利回りの新興国通貨建て世界銀行債券からの利息収入を得たこと。
- ・コロンビアペソ、メキシコペソ、ポーランドズロチなどを中心として、ポートフォリオの一部の組入通貨が対円で上昇したこと。

## ＜値下がり要因＞

- ・信用スプレッド（利回り格差）が拡大したこと。

## 1 万口当たりの費用明細

（2023年10月13日～2024年4月12日）

項 目	第197期～第202期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 13	% 0.495	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	( 4)	(0.149)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	( 9)	(0.330)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（受託会社）	( 0)	(0.016)	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	0.016	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（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
（印刷費用等）	( 0)	(0.014)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
（その他）	( 0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	13	0.511	
作成期間の平均基準価額は、2,636円です。			

(注) 作成期間の費用（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) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託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。

(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。

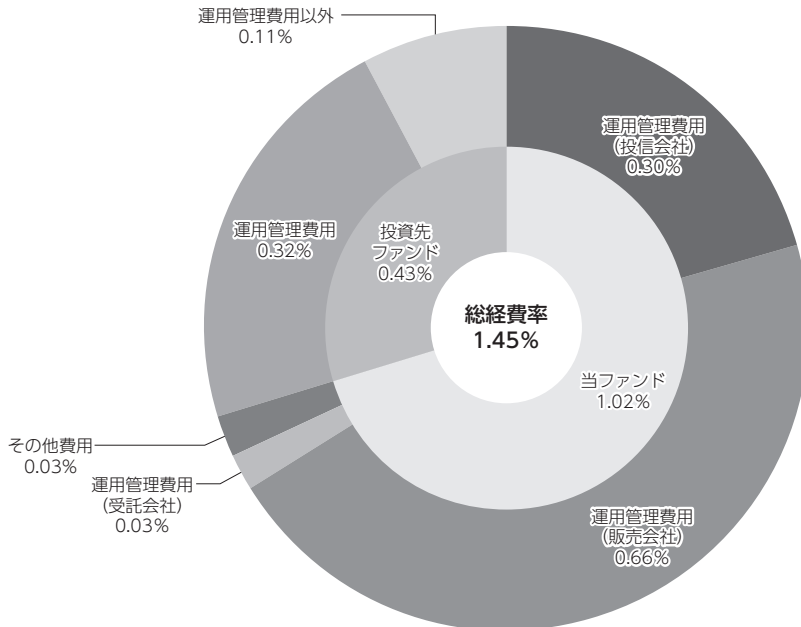
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) この他にファンドが投資対象とする投資先においても信託報酬等が発生する場合があります。

## （参考情報）

### ○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.45%です。



(単位：%)

総経費率(①+②+③)	1.45
①当ファンドの費用の比率	1.02
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.32
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11

(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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認ください。期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(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（親投資信託を除く。）です。

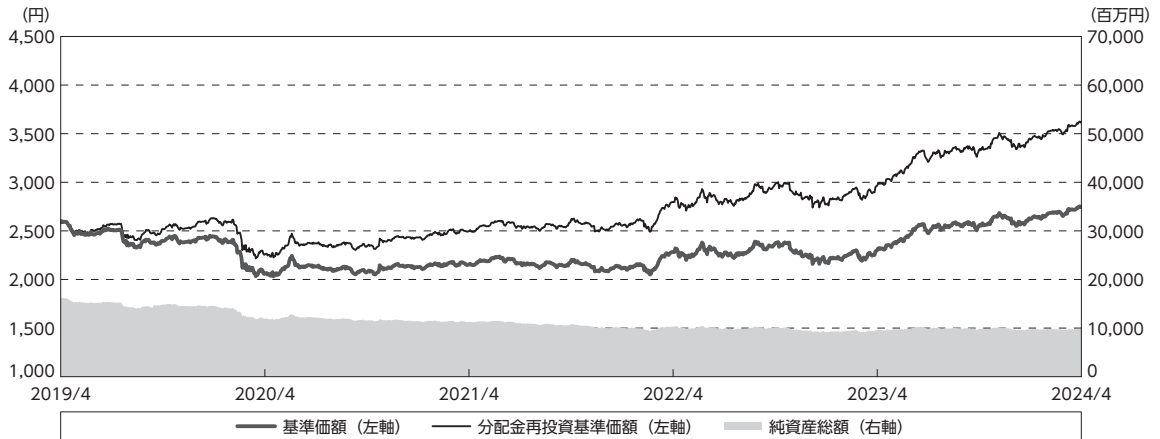
(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(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) 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

(2019年4月12日～2024年4月12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、2019年4月12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。

	2019年4月12日 決算日	2020年4月13日 決算日	2021年4月12日 決算日	2022年4月12日 決算日	2023年4月12日 決算日	2024年4月12日 決算日
基準価額 (円)	2,586	2,095	2,154	2,273	2,289	2,746
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	220	120	120	115	60
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 11.2	8.8	11.5	5.9	22.8
純資産総額 (百万円)	16,153	12,141	11,272	10,265	9,528	9,833

- (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**

（2023年10月13日～2024年4月12日）

**（債券市況）**

期間中に市場の主要テーマとなったのは、米国を中心とした好調な経済活動と緩やかに減速しながらも高止まりするインフレで、これらが市場価格に影響を及ぼし、こうした環境が債券利回りに上昇（債券価格は下落）圧力をもたらしました。市場では米国連邦準備制度理事会（F R B）や欧州中央銀行（E C B）がともに政策金利を高水準で長期間維持するとの見方が広がりました。地政学的な不透明感があるなかでも、ソフトランディング（経済の軟着陸）のテーマが再浮上したことやF R Bを中心として各中央銀行がハト派（金融緩和的な政策を支持）的な姿勢を示したことを受けて、市場のセンチメントはポジティブなものとなりました。投資家の間では利上げサイクルが終了したかもしれないとの見方が強まりました。2023年11月の米国連邦公開市場委員会（F O M C）では、金融環境が十分に引き締められているとの見方が示され、投資家心理は一層良好なものとなりました。F R Bが予想外に政策に関する姿勢を転換したことを受けて、市場ではF R Bの姿勢の転換は積極的な引き締めサイクルの終了や利下げ開始の可能性を示唆していると解釈され、相場は上昇しました。期間の後半はリスク選好度が高まったことから、アメリカドルには大きな逆風がかかりました。その後も、引き続き米国の経済指標は市場予想を上回り、2023年第4四半期の国内総生産（G D P）成長率（速報値）は前四半期比で3.3%と、市場予想を上回りました。12月の消費者物価指数（C P I）上昇率も加速し、総合およびコア指数がともに市場予想を上回りました。ユーロ圏では、様々な国で一連の購買担当者景気指数（P M I）が良好な結果となり、サービス部門の顕著な回復が示されました。経済指標が総じて底堅く推移していることから、債券利回りは上昇傾向が続きました。

世界の新興国市場は、世界的な景気後退に陥るとの懸念が後退したことなどを受けて、下支えされた状態が続きました。こうしたなか、新興国の信用スプレッドは縮小し、現地通貨建て債券利回りが低下（債券価格は上昇）するなど、多くのリスク資産が上昇しました。インフレが鈍化し、経済成長が堅調となるなど良好な環境となっていることを受けて、新興国の各中央銀行は為替レートに過度な圧力を与えることなく利下げを継続することが可能となりました。このところ新興国通貨は幾分軟調となっていますが、これは新興国通貨の下落よりもアメリカドルの上昇が主な要因となっています。

**（国内短期金利市況）**

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの-0.03%近辺から、日銀によるマイナス金利政策の下でコール市場でもマイナス圏での取引が続いたものの、2024年3月の金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除が決定されたことから、0.08%近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（T B）3ヵ月物金利は、期間の初めの-0.21%近辺から、日銀による国債買入れの継続などを受けてマイナス圏での推移が続いたものの、2024年3月にはマイナス金利政策の解除が決定されたことから、0.00%近辺で期間末を迎えました。

**当ファンドのポートフォリオ**

（2023年10月13日～2024年4月12日）

**（当ファンド）**

当ファンドは、収益性を追求するため、「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券を高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制しました。

### （ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA）

当ファンドでは、新興国通貨建ての世界銀行の短期債券を中心に分散投資を行ないました。期間末時点では、メキシコペソ、インドネシアルピア、ポーランドズロチ、ブラジルレアル、インドルピー、南アフリカランド、チリペソ、中国人民元、コロンビアペソなどの通貨建ての世界銀行債券に投資を行なっています。期間中、ファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）面の追い風が強く、インカム創出力が魅力的な水準にあるとみられる通貨の投資比率を高位に維持しました。

インドについては、多くの多国籍企業がサプライチェーン（供給網）の分散を図っており、競争力のある賃金、労働力の増加、力強い生産性の伸びに支えられ、テクノロジーセクター内で主要な恩恵を受ける立場にあるとみられることから、インドルピーに対して中期的にポジティブな見方を維持しています。また、JPモルガンの新興国債券指数「GBI-EMインデックス」に同国が採用されることにより資金が流入するとみられます。EMEA（欧州・中東・アフリカ）地域では、ポーランドの状況が際立っています。同国は、堅調な内需と競争力のある輸出基盤によって下支えされた、中東欧最大且つ非常に多様性のある経済を持ち、様々な外部環境が低迷する局面でその影響が緩和されてきました。特に新型コロナウイルス危機の間に、ポーランドは輸出や大幅な財政出動・金融緩和が追い風となり、多くの欧州諸国をアウトパフォームしました。欧州連合（EU）加盟以降、EU基金の最大の受益国の1つとなっており、最近の地政学的な動向を受けてロシア産エネルギー（炭化水素）からの独立性を確保しています。中南米では、ファンダメンタルズが堅固であり米国の近隣国であるメキシコを選好しました。メキシコ経済は米国の経済動向と密接に関連しており、2%の成長が見込まれていますが、これまでの金融引き締め措置の影響で減速する可能性があります。しかし、足元で米国経済の底堅さが市場予想を上回っている模様であり、これがメキシコの経済見通しに好影響をもたらすかもしれません。メキシコは、世界の経済状況の変化によってもたらされる成長機会を捉えながら、潜在的な経済問題を克服するための戦略的な準備を整えています。

### （マネー・オープン・マザーファンド）

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コール・ローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

当ファンドは、原則として世界銀行が発行する債券でポートフォリオを構築しており、その運用方針においてESG（環境・社会・ガバナンス（企業統治））を主要な要素としていることから、日興アセットマネジメントが「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」を踏まえて定めた「ESG投信」です。世界銀行は、発行する債券を通じて調達した資金で、貧困削減と持続的成長の実現に向け、主に新興国に対して融資や政策助言などを提供しています。

ESGを主要な要素として選定した投資対象への投資比率は100%（当期間末、組入債券の純資産比）としました。

日興アセットマネジメントのESG投資の詳細につきましては、以下のWEBサイトをご参照ください。

<https://www.nikkoam.com/sustainability>

日興アセットマネジメントヨーロッパリミテッドは日興アセットマネジメントのグループ会社として、同グループのステewardシップ方針に基づき、ステewardシップ責任を果たしています。日興アセットマネジメントグループ（以下、「当社グループ」）では、ESG要素の考慮について、お客様に対する受託者責任の不可欠な一部であると考えています。ESG課題に関する投資先企業とのエンゲージメント（目的を持った建設的な対話）および議決権行使は、株式運用におけるステewardシップ活動の主な手段であり、当社グループは議決権行使がお客様の利益に資するよう、細心の注意を払いました。債券運用においては、発行体とのエンゲージメントなど、他のステewardシップ手段を用いることで、積極的な投資家となることをめざしました。

当社グループのステewardシップ方針の詳細は、ホームページでご確認いただけます。

<https://www.nikkoam.com/about/stewardshipcode/policy>

## 当ファンドのベンチマークとの差異

（2023年10月13日～2024年4月12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。

## 分配金

（2023年10月13日～2024年4月12日）

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりいたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第197期	第198期	第199期	第200期	第201期	第202期
	2023年10月13日 ～2023年11月13日	2023年11月14日 ～2023年12月12日	2023年12月13日 ～2024年1月12日	2024年1月13日 ～2024年2月13日	2024年2月14日 ～2024年3月12日	2024年3月13日 ～2024年4月12日
当期分配金	5	5	5	5	5	5
（対基準価額比率）	0.189 %	0.192 %	0.190 %	0.187 %	0.188 %	0.182 %
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	84	85	87	90	90	93

（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

### （当ファンド）

引き続き、「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券を原則として高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制する方針です。

### （ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA）

新興国市場では、2024年上半期に米国経済のリセッション入り回避されるなかで世界経済が減速するとの予想が追い風となり、現地通貨建て債券市場を中心に新興国資産の短期的な見通しが楽観的になっているように思われます。世界的にインフレ率は引き続き低水準で推移しており、新興国市場では低下傾向が継続すると予想されることから、現地通貨建て新興国債券にとって有利な環境が生まれるとみています。中国では、中国政府が経済成長を下支えするために実施した財政、金融、住宅の各政策によって、経済成長率が2024年1-3月期まで5.5%に維持されると見込まれていますが、それ以降は通常のペースに戻る可能性が高いとみられています。ブラジル、中欧、トルコを含む、中国以外の新興国市場では、内需の回復に牽引され、2024年1-3月期の経済成長が回復すると予想されています。しかし、足元でハイテク産業の生産高が回復しているにもかかわらず、世界の製造業PMIが示唆する世界的な設備投資の鈍化の可能性がアジア新興国市場の先行き見通しに暗い影を落としています。

アジア新興国市場での金融緩和は、流動性オベの強化から始まると予想されていますが、従来予想されていた2024年下半年よりも早い時期に利下げが実施される可能性もあるとみています。こうした変化の背景には、足元での外部金融環境の改善が追い風となり、インド、インドネシア、マレーシアなどの国々が国際収支の悪化問題に対処するために2023年に実施した金融引き締め措置を緩和する動きを強めていることがあります。欧州・中東・アフリカ（EMEA）新興国市場では、インフレの鈍化を受けて、数カ国の中央銀行が金融政策の緩和を開始しています。特にハンガリー国立銀行とポーランド国立銀行は2023年から利下げを開始しており、チェコ国立銀行とイスラエル銀行が追随して利下げを開始しています。ルーマニア国立銀行は2024年7-9月期に利下げに踏み切ると予想されていますが、前倒して4-6月期に利下げを開始する可能性があります。その一方で、ポーランド国立銀行は、インフレ動向や財政上の懸念から追加利下げを先送りしており、10-12月期に利下げを再開すると予想されています。南アフリカ準備銀行は2024年5月に利下げを開始し、南アフリカランドの対ドル為替レートの安定化がインフレへ及ぼす影響を注視しながら、段階的に利下げを進めていくと見込まれています。中南米新興国市場は、世界的な経済リスクからある程度隔離されており、世界の主要国経済が景気の急減速を回避しソフトランディングするとの予想を前提として、2024年の見通しは良好となっています。世界の主要国経済でインフレの減速ペースが緩やかになり、金融緩和に対して慎重な姿勢が見られるなかで、中南米新興国経済は底堅い成長を維持すると予想されています。ブラジル中央銀行は2024年3月の金融政策委員会で6会合連続となる0.50%の利下げを決定しました。コロンビア共和国銀行は2023年12月の金融政策決定会合における利下げから金融緩和サイクルを開始し、2024年3月の会合では0.50%の利下げを決定しています。今後の政策決定はインフレ動向次第になると思われそうですが、追加利下げが実施されるとの予想が多くなっています。チリ中央銀行は、積極的な金融緩和に有利な国内経済環境を利用して、利下げペースを加速しています。ペルー中央準備銀行は金融緩和政策を継続しています。メキシコ銀行はハト派的なシフトを表明し、2024年3月に利下げを開始しました。

引き続き、新興国通貨建ての世界銀行の短期債券に分散投資を行なっていく方針です。原則として、中・長期的に高いリターンが予想される主要新興国の投資比率を高位に維持していく方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（マネー・オープン・マザーファンド）

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主要投資対象は、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コール・ローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

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。

## お知らせ

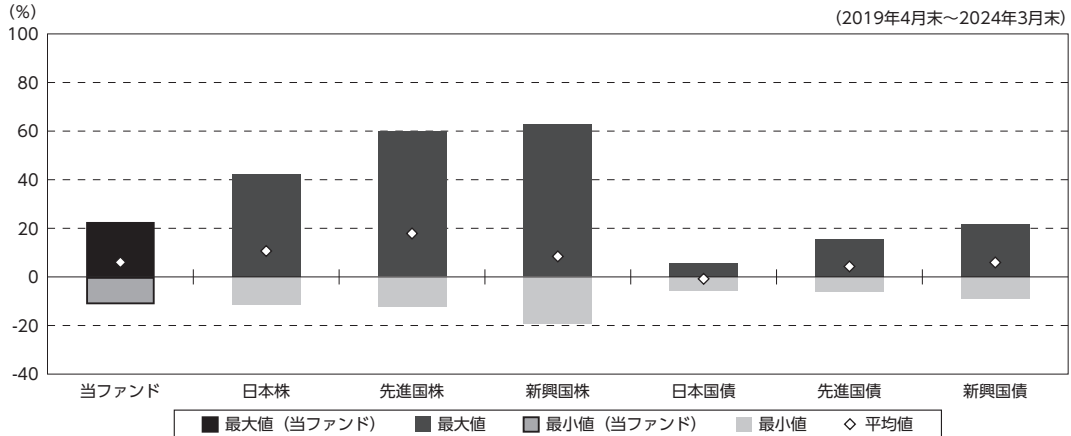
2023年10月13日から2024年4月12日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	2007年6月21日から原則無期限です。
運用方針	主として投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」 受益証券 「マネー・オープン・マザーファンド」 受益証券 上記の投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	主として、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を主な投資対象とすることで、安定的な収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。各通貨への投資比率は、各国の経済状況、金利水準、市場の流動性などにに基づき決定します。組み入れる債券は、原則として残存期間が3年以下（変動利付債の場合は10年以下）のものとし、ファンドの流動性を確保するため、一部米ドルやユーロなどの主要国通貨建ての債券に投資することがあります。
分配方針	第1計算期は収益分配を行ないません。第2計算期以降、毎決算時、基準価額水準などを勘案して、原則として安定した分配を継続的行なうことをめざします。

## （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	22.6	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	△11.3	△11.4	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8
平均値	6.0	10.7	17.9	8.4	△0.8	4.3	5.9

(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) 2019年4月から2024年3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。

(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：東証株価指数（TOPIX、配当込）

先進国株：MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、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、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、円ベース）

新興国債：JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、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、円換算しております。

### 指数について

●東証株価指数（TOPIX、配当込）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、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-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。●NOMURA-BPI国債は、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が公表している指数で、その知的財産権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。なお、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は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数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GBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、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

(2024年4月12日現在)

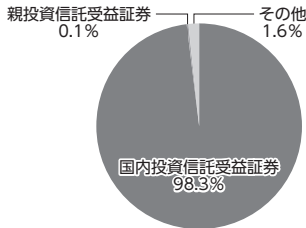
## ○組入上位ファンド

銘柄名	第202期末
	%
ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA	98.3
マネー・オープン・マザーファンド	0.1
組入銘柄数	2銘柄

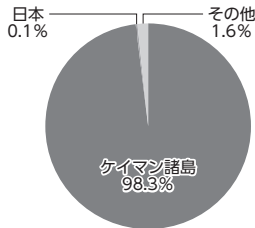
(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

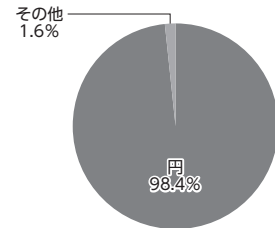
## ○資産別配分



## ○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) 国内投資信託受益証券には外国籍（邦貨建）の受益証券を含めております。

(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197期末	第198期末	第199期末	第200期末	第201期末	第202期末
	2023年11月13日	2023年12月12日	2024年1月12日	2024年2月13日	2024年3月12日	2024年4月12日
純資産総額	10,050,744,728円	9,759,281,501円	9,761,709,915円	9,780,303,459円	9,563,903,212円	9,833,186,448円
受益権総口数	38,009,291,915口	37,631,286,118口	37,119,471,210口	36,653,189,370口	36,063,664,425口	35,810,976,678口
1万口当たり基準価額	2,644円	2,593円	2,630円	2,668円	2,652円	2,746円

(注) 当作成期間（第197期～第202期）中における追加設定元本額は542,707,579円、同解約元本額は3,134,410,207円です。

組入上位ファンドの概要

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA

【基準価額の推移】

(2022年3月1日～2023年2月28日)



(注) 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3月1日～2023年2月28日)

当該期間の1万口当たりの費用明細については開示されていないため、掲載しておりません。

【組入上位10銘柄】

(2023年2月28日現在)

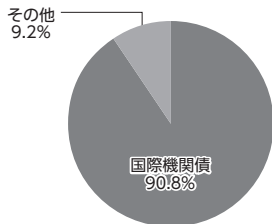
	銘柄名	業種／種別等	通貨	国(地域)	比率
					%
1	IBRD 0% 10-Jul-24	国際機関債	メキシコペソ	国際機関	8.0
2	IBRD 2.9% 22-Dec-23	国際機関債	コロンビアペソ	国際機関	6.5
3	IBRD 0% 30-Apr-24	国際機関債	メキシコペソ	国際機関	6.4
4	IBRD 6% 16-Jan-25	国際機関債	インドルピー	国際機関	6.0
5	IBRD 5.7% 07-Feb-25	国際機関債	チリペソ	国際機関	5.8
6	IBRD 0.33% 25-Jun-25	国際機関債	ポーランドズロチ	国際機関	5.3
7	IBRD 4.3% 13-Sep-23	国際機関債	インドネシアルピア	国際機関	5.0
8	IBRD 0.05% 27-Jul-23	国際機関債	ポーランドズロチ	国際機関	4.3
9	IBRD 0% 30-Jun-25	国際機関債	ブラジルレアル	国際機関	4.3
10	IBRD 0% 20-Jun-24	国際機関債	南アフリカランド	国際機関	4.1
組入銘柄数			30銘柄		

(注) 比率は、純資産総額に対する割合です。

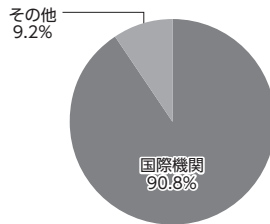
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

(注) 国（地域）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。

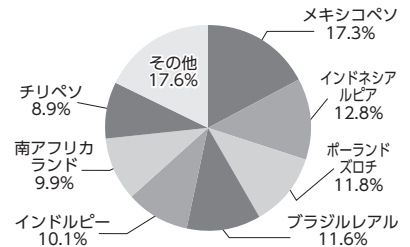
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



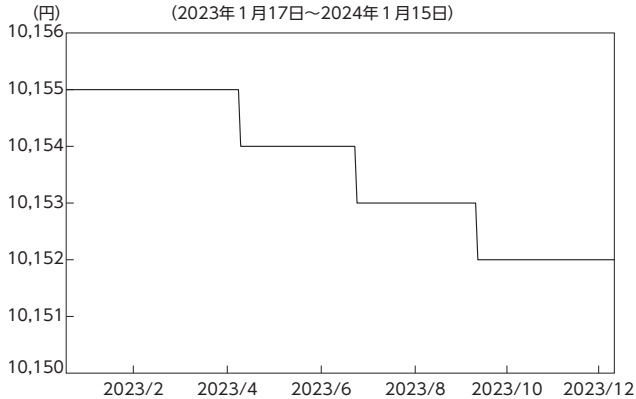
(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(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。

## マネー・オープン・マザーファンド

## 【基準価額の推移】

(2023年1月17日～2024年1月15日)



## 【1万口当たりの費用明細】

(2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 の 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)
合 計	0	0.000

期中の平均基準価額は、10,153円です。

(注) 上記項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

(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。

## 組入資産の内容

(2024年1月15日現在)

2024年1月15日現在、有価証券等の組入れはございません。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書（全体版）をご参照ください。

## 寄付についてのご報告

「世界銀行債券ファンド（毎月分配型）＜愛称 ワールドサポーター＞」は、2024年4月12日に第202期の決算を迎えました。

目論見書記載の通り、当ファンドでご負担いただいた当期間の信託報酬のうち、日々の純資産総額に年率0.05%を乗じた金額、総額2,452,543円を、国際開発協会（International Development Association、通称IDA：アイダ）に寄付させていただきます。ワールドサポーターを通じたこれまでの寄付金の総額は累計で、553,541,535円となっています。

IDAは、世界銀行の名で知られる国際復興開発銀行（IBRD）の姉妹機関として1960年に設立されました。途上国の中でも特に貧しい国々を支援するため、経済成長の促進、不平等の是正、生活水準向上等を実現すべく超長期で無利子の融資や贈与を行なっています。

日興アセットマネジメントは、今後もワールドサポーターを通じて、世界の子どもたちに笑顔をもたらす新興国支援の取組みを応援してまいります。

引き続きワールドサポーターをみなさまの資産形成のツールとして未長くご愛顧いただきますよう、よろしくお願い申し上げます。