

オーロラⅡ (トルコ投資ファンド)

追加型投信／海外／株式

交付運用報告書

第27期(決算日2023年7月11日)

作成対象期間(2022年7月12日～2023年7月11日)

第27期末(2023年7月11日)	
基準価額	14,755円
純資産総額	1,054百万円
第27期	
騰落率	67.3%
分配金(税込み)合計	240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、野村アセットマネジメント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

⇒「ファンド検索」にファンド名を入力しファンドを選択

⇒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。

当ファンドは、トルコの企業の株式(DR(預託証券))を含みます。)を主要投資対象とし、信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行ないます。

ここに、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。

当ファンドは運用開始以来、「オーロラⅡ」を構成するファンドとして永らくご愛顧いただきましたが、償還事務の都合上、2023年3月31日に信託期間を延長する約款変更が行なわれ、2024年10月1日まで延長した上で信託期間満了を迎えます。

なお、「オーロラⅡ(東欧投資ファンド)」については、2023年3月31日に信託期間を延長する約款変更を行ない、信託期間終了日は2027年7月12日となりましたので、ご留意下さい。

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。

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

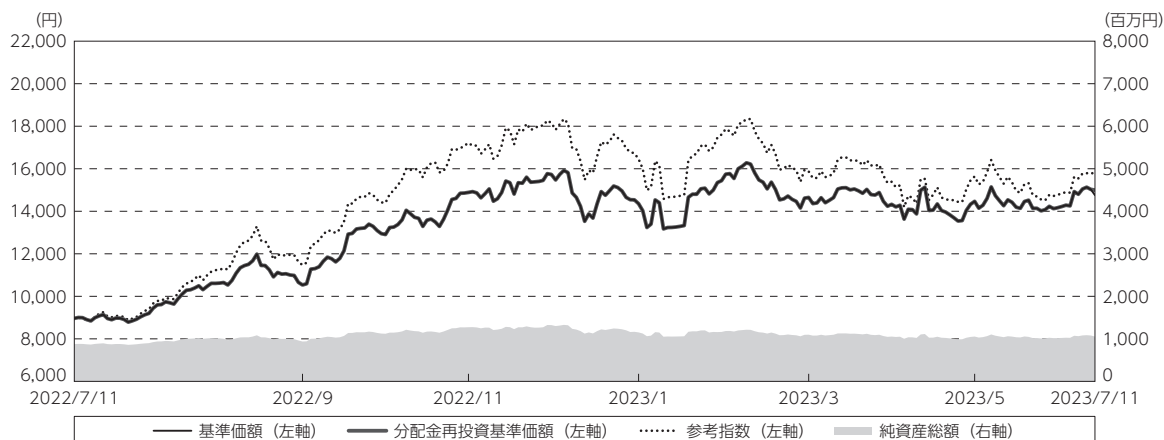


ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2022年7月12日～2023年7月11日)



期 首：8,964円

期 末：14,755円 (既払分配金(税込み):240円)

騰落率：67.3% (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(2022年7月11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) 参考指数は、BIST100指数(円換算ベース)です。詳細は4ページをご参照ください。参考指数は、作成期首(2022年7月11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。

○基準価額の変動要因

- (上 昇) 大手企業が良好な2022年4-6月期決算を発表したこと、中央銀行が政策金利を引き下げたこと、多数の国内個人投資家が株式市場に新規参入したこと
- (下 落) 大統領選挙への不透明感が高まったこと、トルコ南東部で発生した大地震による経済への影響が懸念されたこと
- (上 昇) トルコ政府が株式市場の支援策を導入したこと
- (下 落) 大統領選挙の行方やその後の経済政策への不透明感が嫌気されたこと、トルコ・リラが下落したこと
- (横ばい) 投資家に高く評価されていた元財務大臣が再び財務大臣として入閣し金融政策の正常化が期待されたこと、トルコ・リラ安を背景に外需株が上昇したこと、一方でトルコ・リラが大幅に下落したこと

1万口当たりの費用明細

(2022年7月12日～2023年7月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 298	% 2.222	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(143)	(1.067)	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)	(140)	(1.045)	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)	(15)	(0.110)	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	5	0.038	(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)	(5)	(0.037)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	34	0.256	(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)	(34)	(0.253)	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)	(0.003)	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)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	337	2.516	
期中の平均基準価額は、13,408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。

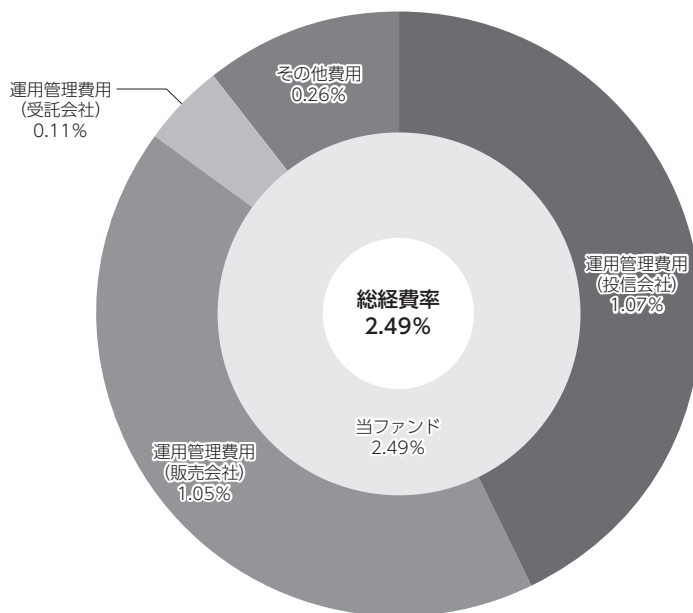
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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2.49%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。

最近5年間の基準価額等の推移

(2018年7月11日～2023年7月11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。2018年7月11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。

	2018年7月11日 決算日	2019年7月11日 決算日	2020年7月13日 決算日	2021年7月12日 決算日	2022年7月11日 決算日	2023年7月11日 決算日
基準価額 (円)	9,504	8,268	7,624	8,336	8,964	14,755
期間分配金合計(税込み) (円)	—	0	0	0	0	240
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 13.0	△ 7.8	9.3	7.5	67.3
参考指数騰落率 (%)	—	△ 17.3	△ 4.7	△ 1.8	9.7	76.6
純資産総額 (百万円)	2,713	2,162	1,400	970	877	1,054

(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。

*参考指数はBIST100指数(円換算ベース)です。

*参考指数(=BIST100指数(円換算ベース))は、BIST100指数(現地通貨ベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。

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トルコリラ為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。

投資環境

(2022年7月12日～2023年7月11日)

トルコ株式市場は、期初、大手企業が良好な2022年4－6月期決算を発表し、高いインフレ率を背景としつつも通期で大幅な増益となる観測が強まったことなどから上昇して始まりました。また、経済成長の維持を重視した中央銀行による政策金利の引き下げは株価上昇を後押ししました。その後も、高いインフレ率にもかかわらず中央銀行が利下げを継続したことや大手企業の業績が高いインフレ率に連動するとの見方、多数の国内個人投資家が株式市場に新規参入したことなどを背景に12月にかけて大幅に上昇しました。

2023年に入ると、5月の大統領選挙への不透明感や選挙後に現状の過度な金融緩和策が変更される可能性が嫌気され、下落に転じました。また、2月にトルコ南東部で発生した大地震による経済への影響が懸念され、一段安となりました。しかしその後、政府は株式の取引を一時停止する一方、年金基金のトルコ株への資産配分の引き上げや企業の自社株買いの一時的な免税など株式市場の支援策を導入したことから、取引再開後に株式市場は大幅に反発しました。反発後には大統領選挙の行方やその後の経済政策への不透明感が再び嫌気され、下落しました。

大統領選挙の直前には野党候補者の勝利が一部の世論調査で報じられたことを受けて経済政策の正常化が期待され上昇に転じましたが、選挙の結果、決戦投票に持ち越しとなり、世論調査に反し現職のエルドアン大統領が優勢となったことを受けて反落しました。エルドアン大統領が決選投票で勝利した後は、政策の恩恵を受けるとみられる企業を中心に再び株価は反発しました。また、投資家に手腕が高く評価されていた元財務大臣が再び財務大臣として入閣したことや米金融機関幹部の経験を持つ女性が中央銀行の総裁に任命されたことを受けて金融政策の正常化が期待され、上昇基調で推移しました。その後も、トルコ・リラ安の進行を受けて、外需株を中心に続伸し、当期においてトルコ株式市場は、現地通貨ベースで大幅上昇となりました。

為替市場では、2023年5月の大統領選挙までトルコ・リラは対米ドルで緩やかな下落傾向をたどりました。高いインフレ率や中央銀行の利下げが下押し圧力をかけた一方、一部のメディアで報じられた国営銀行による為替介入や外貨購入・預金への規制強化などの政府の通貨安定化措置が下支えとなりました。しかし、選挙後は中央銀行の外貨準備高の減少懸念に加え、国営銀行による為替市場への介入停止が観察されたことなどからトルコ・リラ安が加速しました。また、6月に中央銀行の新総裁就任後に政策金利が大幅に引き上げられたものの、インフレ率の水準を大きく下回り、市場予想に届かなかったことも下落加速の要因となりました。期末にかけては、国営銀行による為替介入の再開が報じられ安定的に推移しましたが、当期においてトルコ・リラは対米ドルや対円で大幅に下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2022年7月12日～2023年7月11日)

・株式組入比率

原則として高位を維持するという運用方針に基づいて運用を行ない、組入比率はおおむね高位を維持しました。

・期中の主な動き

- 業種配分では、期初においては、生活必需品、一般消費財・サービスなどをオーバーウェイト（参考指数に比べ高めの投資比率）とし、素材、資本財・サービスなどをアンダーウェイト（参考指数に比べ低めの投資比率）としました。期末においては、一般消費財・サービス、生活必需品などをオーバーウェイトとし、素材、コミュニケーション・サービスなどをアンダーウェイトとしました。
- 個別銘柄では、トルコ航空（旅客航空輸送）、フォード・オートモーティブ・サナイ（自動車）、コカコーラ・アイスセック（飲料）などを上位に組み入れました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年7月12日～2023年7月11日)

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（BIST100指数（円換算ベース））が76.6%の上昇となったのに対して、基準価額は67.3%の上昇となりました。

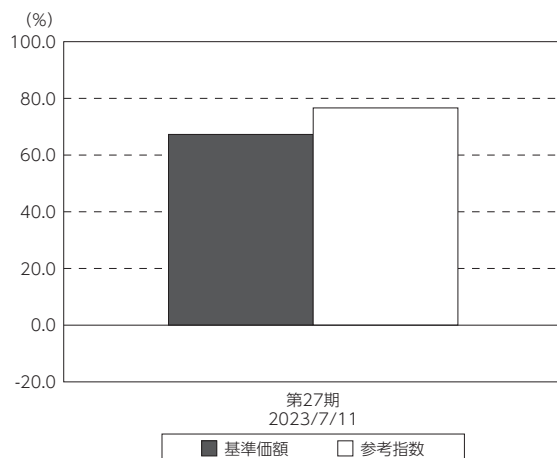
(主なプラス要因)

- 業種配分で、株価騰落率が参考指数を下回った素材をアンダーウェイトとしたこと
- 個別銘柄で、株価騰落率が参考指数を上回った自動車株や建設資材株をオーバーウェイトとしたこと

(主なマイナス要因)

- 業種配分で、株価騰落率が参考指数を下回った生活必需品をオーバーウェイトとしたこと
- 個別銘柄で、株価騰落率が参考指数を下回った飲料株や生活必需品流通・小売り株をオーバーウェイトとしたこと

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、BIST100指数（円換算ベース）です。

分配金

(2022年7月12日～2023年7月11日)

今期の収益分配金については、基準価額水準等を勘案し、1万口当たり240円とさせていただきます。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27期	
	2022年7月12日～2023年7月11日	
当期分配金	240	
(対基準価額比率)	1.601%	
当期の収益	240	
当期の収益以外	-	
翌期繰越分配対象額	10,738	

(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

・投資環境

- (1) トルコ経済については、中央銀行が金融政策を正常化できるかどうかを注視していきます。長引いた過度な金融緩和政策による歪みを是正するには、景気の急激な悪化や金融システムへの打撃などの経済的影響に配慮しながら、政策の段階的な正常化が必要であるとの中央銀行の説明は合理的と考えられます。一方、以前に中央銀行が金融引き締め策を早期段階で停止し、金融緩和に転じ、インフレ率のさらなる上昇やトルコ・リラ安の加速を招いた経緯があるため、今回、インフレ率が抑制されるまで金融引き締めを継続できるか、投資家の信頼を取り戻せるかに注視が必要です。
- (2) トルコ株式市場については、インフレ率を抑制できる水準まで金利の大幅な引き上げが継続すれば、それに伴う景気減速や株式市場における流動性の低下で一時的に株価は下落する可能性があります。しかし、中長期的な投資観点からみるとこうした金融政策の正常化が持続的な株価上昇に必要であると考えています。一方、金利の引き上げが遅れた場合や不十分な場合、トルコ・リラ安回避のため国内投資家による外需株への資金流入が下支えとなり、短期的に株価は上昇する可能性があるかとみています。

・投資方針

業種配分では、中長期的なトルコの経済成長の恩恵を受けるとみられる一般消費財・サービスや安定した業績の改善が見込まれる生活必需品を引き続きオーバーウェイトとする方針です。

個別銘柄については、競争力のあるビジネスモデルや独自の成長要因を有し、中長期的に比較的安定した収益の成長が見込まれる銘柄に選別的に投資する考えです。

今後も基準価額の向上に努めて参りますので、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

信託期間終了日を2024年10月1日とする所要の約款変更を行ないました。

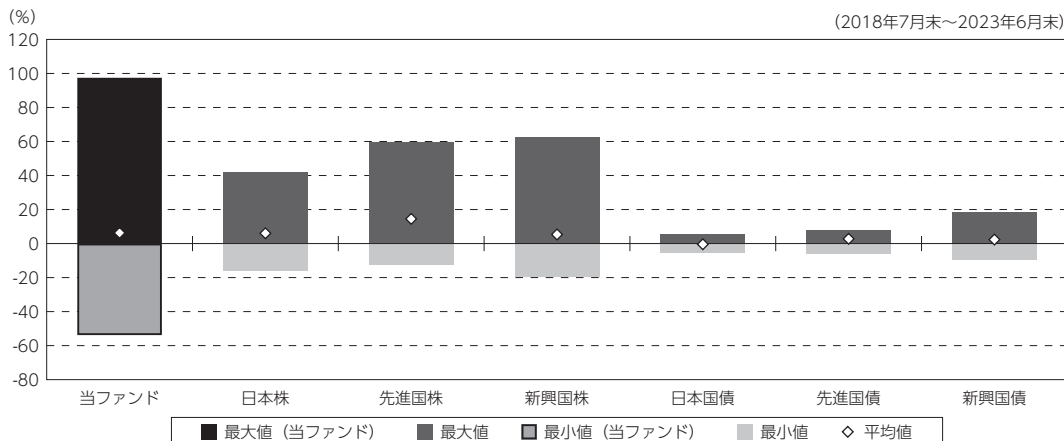
<変更適用日：2023年3月31日>

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／株式
信託期間	1996年9月12日から2024年10月1日までです。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行ないます。
主要投資対象	トルコの企業の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。
運用方法	トルコの企業の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行ないます。
分配方針	毎決算時に、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から基準価額の水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行ないます。

(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	97.5	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.5
最小値	△ 53.8	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値	6.3	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	2.3

(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7月から2023年6月の5年間の各月末における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) 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。

《代表的な資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数 (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・ディバーシファイド(円ベース)

※各指数についての説明は、後述の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

(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。

当ファンドのデータ

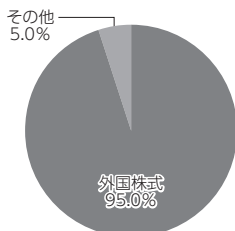
組入資産の内容

(2023年7月11日現在)

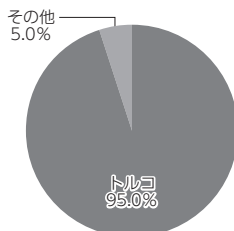
○組入上位10銘柄

	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
					%
1	TURK HAVA YOLLARI AO	旅客航空輸送	トルコリラ	トルコ	13.4
2	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	自動車	トルコリラ	トルコ	8.4
3	COCA-COLA ICECEK AS	飲料	トルコリラ	トルコ	8.0
4	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	石油・ガス・消耗燃料	トルコリラ	トルコ	6.6
5	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	生活必需品流通・小売り	トルコリラ	トルコ	6.4
6	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	コングロマリット	トルコリラ	トルコ	6.0
7	KOC HLDGS	コングロマリット	トルコリラ	トルコ	4.8
8	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	金属・鉱業	トルコリラ	トルコ	3.4
9	HACI OMER SABANCI HOLDING	銀行	トルコリラ	トルコ	3.3
10	MAVI GIYIM SANAYI VE TICA-B	繊維・アパレル・贅沢品	トルコリラ	トルコ	3.1
	組入銘柄数		28銘柄		

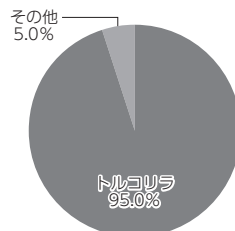
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



- (注) 比率は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) 組入銘柄に関する詳細な情報等は、運用報告書(全体版)に記載しております。
(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27期末
	2023年7月11日
純資産総額	1,054,348,025円
受益権総口数	714,548,137口
1万円当たり基準価額	14,755円

(注) 期中における追加設定元本額は158,809,897円、同解約元本額は423,596,941円です。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

○東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に係る標章又は商標は、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 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

○MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)

○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)

MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)、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) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

○NOMURA-BPI 国債

NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、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、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行なわれる野村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、ヘッジなし・円ベース)

FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、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債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。

○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」) は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。

JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行なう際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他)