野村グローバルSRI 100

愛称:野村世界社会的責任投資

運用報告書(全体版)

第16期(決算日2020年5月27日)

作成対象期間(2019年5月28日~2020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	2004年5月28日以降、無	期限とします。							
運用方針	FTSE4Good Developed 10 果を目指して運用を行い 株式の実質組入比率は高 ます。	野村グローバルSRI 100 マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券を主要投資対象とし、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。 実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。							
主 大机次共存	野村グローバルSRI 100	マザーファンドの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もあります。							
主な投資対象	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。							
ナか机姿 判四	野村グローバルSRI 100	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。							
主な投資制限	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。 外貨建て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、原則として配当等収益等を中心として分配します。 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す。							

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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/

〇最近5期の運用実績

			基	準		価	客	頂	ベンチ	マ	ー ク	株		式	株		式	純	資	産
決	算	期	(分配落)	税分	込 配	み金	落	中率	円換算したFTSE4Good Developed 100 Index		中 落 率	組	入比		先物		率		,,	額
			円			円		%			%			%		(%		百万	.円
12期	(2016年5	月27日)	13, 896			65	$\triangle 16$. 0	118. 75		$\triangle 17.6$		99	9.5		-	-		2, 8	339
13期	(2017年5	月29日)	16, 266			80	17	.6	137. 67		15.9		99	3.3		-	- [3, 2	292
14期	(2018年5	月28日)	17, 609			85	8	8.8	147. 67		7. 3		99	9.4		-	- [2, 5	502
15期	(2019年5	月27日)	18, 259			90	4	. 2	151. 76		2.8		99	9. 2		-	- [2, 5	582
16期	(2020年5	月27日)	19, 676			95	8	. 3	162. 81		7. 3		99	9.5			- [2, 7	'36

^{*} 基準価額の騰落率は分配金込み。

*ベンチマーク (=円換算したFTSE4Good Developed 100 Index) は、FTSE4Good Developed 100 Index (配当を含まないベース) 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。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

	基	準	価		額	ベンチ	マー	ク	+/-			<u> </u>	+#-			<u>+</u> -
年 月 日			騰	落	率	円換算したFTSE4Good Developed 100 Index	騰落	率	株組	入	比	式率	株先	物	比	式率
(期 首)		円			%	-		%				%				%
2019年5月27日		18, 259			_	151. 76		_			99	. 2				-
5月末		17, 988		\triangle	1.5	149. 54	Δ	1.5			99	. 3				_
6月末		18, 586			1.8	154. 52		1.8			99	. 2				_
7月末		19, 293			5. 7	160.39		5. 7			99	. 4				_
8月末		18, 470			1.2	153. 27		1.0			99	. 4				_
9月末		19, 032		4	4. 2	157. 95		4. 1			99	. 5				_
10月末		19, 923		9	9. 1	165.04		8.8			99	. 6				_
11月末		20, 730		1:	3. 5	171.71	1	3. 1			99	. 5				_
12月末		21, 505		1	7.8	178. 14	1	7.4			99	. 5				_
2020年1月末		21, 717		18	8.9	179.85	1	8.5			99	. 5				_
2月末		19, 816			8.5	163.88		8.0			99	. 4				_
3月末		17, 843		Δ:	2. 3	147. 55	\triangle	2.8			99	. 4				_
4月末		19, 252		į	5.4	158. 79		4.6			99	. 4				_
(期 末)																
2020年5月27日		19, 771			8.3	162.81		7.3			99	. 5				_

^{*}期末基準価額は分配金込み、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。

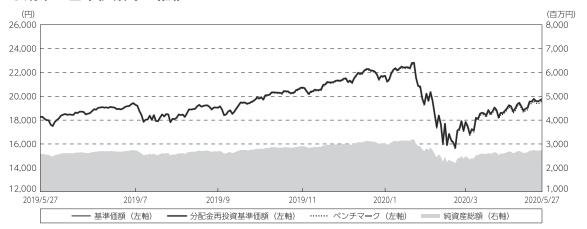
^{*}株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

^{*}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

〇期中の基準価額等の推移



期 首:18,259円

期 末:19,676円(既払分配金(税込み):95円)

騰落率: 8.3% (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(2019年5月27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(2019年5月27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。

〇基準価額の主な変動要因

基準価額は、米中貿易協議の進展への期待などから堅調に推移したのち、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり下落に転じましたが、期を通じては上昇となりました。

〇投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測の高まりなどを巡り一進一退となりましたが、2019年10月以降は、堅調な米企業の決算や市場予想を上回る米国の経済指標の発表、米中貿易協議の進展への期待などから上昇しました。2020年2月下旬には、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まる中、下落に転じました。その後も、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に歯止めがかからず、世界景気の先行き懸念が強まったことや、OPEC(石油輸出国機構)とロシアなど非加盟産油国の減産交渉決裂を受けた原油価格の急落などを受けて、一段と下落しました。3月下旬以降は、欧米で新型コロナウイルスの感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方やFRB(米連邦準備制度理事会)の緊急資金供給策の発表、新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどを受けて上昇に転じました。

為替市場は、期首から米中貿易摩擦への警戒感から投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米利下げ観測が高まったことなどを受けて主要通貨は対円で下落(円高)しました。2019年6月以降は、米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測を巡り一進一退となりましたが、8月上旬には、米大統領による対中追加関税の発動表明を受けて下落(円高)しました。9月以降は、米中貿易協議の進展への期待などを受け投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、一進一退を繰り返しながら上昇(円安)しました。2020年2月下旬から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などから一時的に大きく下落(円高)しました。その後、金融市場の動揺を背景にドル需要が強まったことや、米国で大型経済対策が成立したことから上昇(円安)に転じましたが、3月下旬以降は、市場予想を下回る米経済指標の発表や原油価格の急落などを受けて世界景気の先行き不透明感が意識される中、再び下落(円高)しました。

〇当ファンドのポートフォリオ

[野村グローバルSRI 100]

主要投資対象である [野村グローバルSRI 100 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)は行いませんでした。

「野村グローバルSRI 100 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」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い、また期中の資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお為替へッジ(為替の売り予約)は行いませんでした。

〇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+8.3%となり、 ベンチマークである「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index」の+7.3%を1.0ポイント 上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

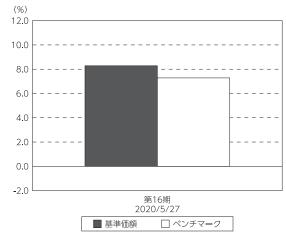
(プラス要因)

ベンチマークは配当収益が含まれていないが、ファンドでは配当収益が含まれていること

(マイナス要因)

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のコスト 負担が発生したこと

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。

(その他、差異を生じた要因)

- ・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)
- ・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)

○分配金

収益分配金は、配当等収益などを勘案して決定さ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います。

〇分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税込み)

_	_	第16期
項	目	2019年5月28日~ 2020年5月27日
当期分配金	95	
(対基準価額比率)	0.481%	
当期の収益		95
当期の収益以外		-
翌期繰越分配対象額	9, 675	

- (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

「野村グローバルSRI 100]

主要投資対象である[野村グローバルSRI 100 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います。

[野村グローバルSRI 100 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。

野村グローバルSRI 100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。

〇1万口当たりの費用明細

(2019年5月28日~2020年5月27日)

項目	当 期 金 額 比 率	項 目 の 概 要
	円 %	
(a) 信 託 報 酬	204 1. 045	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(86) (0.440)	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)	(97) (0. 495)	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)	(21) (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	1 0.005	(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)	(1) (0.005)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1 0.003	(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)	(1) (0.003)	
(d) そ の 他 費 用	12 0.061	(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)	(11) (0.057)	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	218 1.114	
期中の平均基準価額は、1	9,512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。

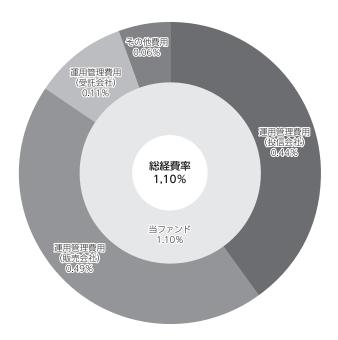
^{*}売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

^{*}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)

〇総経費率

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1.10%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、売買委託手数料及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) 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。

〇売買及び取引の状況

(2019年5月28日~2020年5月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

約	杻		設	定			解	約	
型白	枘	口	数	金	額	П	数	金	額
			千口		千円		千口		千円
野村グローバルSRI 100	マザーファンド		3,064		7,648		39, 025		94, 991

^{*}単位未満は切り捨て。

〇株式売買比率

(2019年5月28日~2020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
	野村グローバルSRI 100 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	491,073千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,009,419千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

^{*(}b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

〇利害関係人との取引状況等

(2019年5月28日~2020年5月27日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルSRI 100> 該当事項はございません。

<野村グローバルSRI 100 マザーファンド>

区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		259	_	_	231	0.842836	0.4
為替直物取引		87	13	14. 9	147	2	1. 4

平均保有割合 90.6%

※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	I	当	期
売買委託手数料総額 (A)			124千円
うち利害関係人への支払額 (B)			0.247千円
(B) / (A)			0.2%

^{*}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證券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2020年5月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄		期首(i	前期末)	当 期 末				
李白	11/1		数	口	数	評信	五 額	
			千口		千口		千円	
野村グローバルSRI 100	マザーファンド		1, 141, 638		1, 105, 677		2, 736, 331	

^{*}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

(2020年5月27日現在)

項	П		当	其	朝	末	
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	Ħ	評	価	額	比	Σ	率
				千円			%
野村グローバルSRI 100 マザ	ーファンド			2, 736, 331			99.0
コール・ローン等、その他				28, 082			1.0
投資信託財産総額				2, 764, 413			100.0

^{*}金額の単位未満は切り捨て。

^{*}野村グローバルSRI 100 マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(2,993,070千円)の投資信託財産総額(3,068,321 千円)に対する比率は97.5%です。

^{*}外貨建て資産は、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=107.51円、1カナダドル=77.93円、1英ポンド=132.47円、1スイスフラン=111.31円、1ノルウェークローネ=10.86円、1デンマーククローネ=15.81円、1ユーロ=117.90円、1香港ドル=13.87円、1豪ドル=71.39円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月27日現在) ○損益の状況

(2019年5月28日~2020年5月27日)

	項目	当期末
		円
(A)	資産	2, 764, 413, 929
	コール・ローン等	14, 712, 087
	野村グローバルSRI 100 マザーファンド(評価額)	2, 736, 331, 545
	未収入金	13, 370, 297
(B)	負債	27, 808, 959
	未払収益分配金	13, 213, 049
	未払信託報酬	14, 549, 996
	未払利息	22
	その他未払費用	45, 892
(C)	純資産総額(A-B)	2, 736, 604, 970
	元本	1, 390, 847, 337
	次期繰越損益金	1, 345, 757, 633
(D)	受益権総口数	1, 390, 847, 337□
	1万口当たり基準価額(C/D)	19,676円

(注) 期首元本額は1,414,414,269円、期中追加設定元本額は 6,128,452円、期中一部解約元本額は29,695,384円、1口当 たり純資産額は1.9676円です。

	項目		当	期
				円
(A)	配当等収益	Δ		3, 007
	支払利息	Δ		3,007
(B)	有価証券売買損益		237	, 652, 217
	売買益		242	, 881, 774
	売買損	Δ	5	, 229, 557
(C)	信託報酬等	Δ	28	, 542, 824
(D)	当期損益金(A+B+C)		209	, 106, 386
(E)	前期繰越損益金		917	, 483, 195
(F)	追加信託差損益金		232	, 381, 101
	(配当等相当額)	(225	, 717, 935)
	(売買損益相当額)	(6	, 663, 166)
(G)	計(D+E+F)	1	, 358	, 970, 682
(H)	収益分配金	Δ	13	, 213, 049
	次期繰越損益金(G+H)	1	, 345	, 757, 633
	追加信託差損益金		232	, 381, 101
	(配当等相当額)	(225	, 743, 349)
	(売買損益相当額)	(6	, 637, 752)
	分配準備積立金	1	, 113	, 376, 532

- *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(2019年5月28日~2020年5月27日)は以下の通りです。

		当 期
項	目	2019年5月28日~
		2020年5月27日
a. 配当等収益(経費控除後)		52, 726, 848円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後	・繰越欠損金補填後)	156, 379, 538円
c. 信託約款に定める収益調整金		232, 381, 101円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	Ž	917, 483, 195円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)		1, 358, 970, 682円
f. 分配対象収益(1万口当たり)		9,770円
g. 分配金		13, 213, 049円
h. 分配金(1万口当たり)		95円

〇分配金のお知らせ

95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。

〇お知らせ

該当事項はございません。

野村グローバルSRI 100 マザーファンド

運用報告書

第16期(決算日2020年5月27日)

作成対象期間(2019年5月28日~2020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います。 株式の組入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。 外貨建て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

東京都中央区日本橋 1-12-1

http://www.nomura-am.co.jp/

〇最近5期の運用実績

決	算	期	基	準	畑 期 騰		þ		マ期騰	落	ク中率	株組	入	比	式率	株先	物	比	式率	純総	資	産額
				円		O,	%				%				%				%		百	万円
12期	月(2016年5	月27日)		16, 469		$\triangle 15.$	2	118. 75		\triangle	17.6			99	9.5				_		2	, 987
13期	月(2017年5	月29日)		19, 574		18.	9	137. 67			15. 9			99	9.3				_		3	, 478
14期	月(2018年5	月28日)		21, 488		9.	8	147. 67			7.3			99	9.4				_		2	, 720
15期	月(2019年5	月27日)		22,619		5.	3	151. 76			2.8			99	9.3				_		2	, 835
16期	月(2020年5	月27日)		24, 748		9.	4	162. 81			7.3			99	5.5				_		3	, 054

^{*}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) は、FTSE4Good Developed 100 Index (配当を含まないベース) 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。

〇当期中の基準価額と市況等の推移

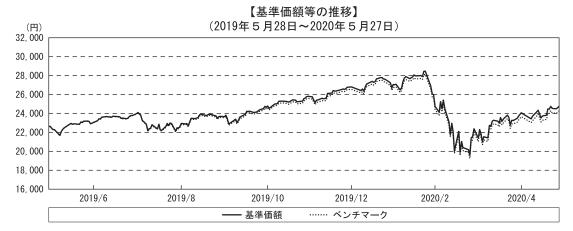
			基	準	価		額	ベ	ンラ	F	マ	_	ク	株			±	株			式
年	月	日			騰	落	率		たFTSE4Go d 100 Inc		騰	落	率	組	入	比	式率	先	物	比	卒
	(期 首)			円			%						%				%				%
2019	9年5月27日			22,619			_		151.	76			_			9	9.3				_
	5月末			22, 286		Δ	1.5		149.	54		Δ	1.5			9	9.3				_
	6月末			23, 045			1.9		154.	52			1.8			9	9.2				_
	7月末			23, 944			5.9		160.3	39			5. 7			9	9.4				_
	8月末			22, 942			1.4		153.2	27			1.0			9	9.4				_
	9月末			23, 661			4.6		157. 9	95			4. 1			9	9.5				_
	10月末			24, 790			9.6		165. ()4			8.8			9	9.6				_
	11月末			25, 815			14. 1		171.	71			13. 1			9	9.5				_
	12月末			26, 805			18.5		178.	14			17.4			9	9. 5				_
202	20年1月末			27, 093			19.8		179.8	35			18.5			9	9. 5				_
	2月末			24, 742			9.4		163.8	38			8.0			9	9.4				_
	3月末			22, 298		Δ	1.4		147.	55		Δ	2.8			9	9.4				_
	4月末			24, 080			6.5		158.	79			4.6			9	9.4				_
	(期 末)			·																	
2020	0年5月27日			24, 748			9.4		162.8	31			7.3			9	9.5				_

^{*}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

〇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。

〇基準価額の主な変動要因

基準価額は、米中貿易協議の進展への期待などから堅調に推移したのち、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり下落に転じましたが、期を通じては上昇となりました。

〇投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測の高まりなどを巡り一進一退となりましたが、2019年10月以降は、堅調な米企業の決算や市場予想を上回る米国の経済指標の発表、米中貿易協議の進展への期待などから上昇しました。2020年2月下旬には、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まる中、下落に転じました。その後も、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に歯止めがかからず、世界景気の先行き懸念が強まったことや、OPEC(石油輸出国機構)とロシアなど非加盟産油国の減産交渉決裂を受けた原油価格の急落などを受けて、一段と下落しました。3月下旬以降は、欧米で新型コロナウイルスの感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方やFRB(米連邦準備制度理事会)の緊急資金供給策の発表、新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどを受けて上昇に転じました。

為替市場は、期首から米中貿易摩擦への警戒感から投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米利下げ観測が高まったことなどを受けて主要通貨は対円で下落(円高)しました。2019年6月以降は、米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測を巡り一進一退となりましたが、8月上旬には、米大統領による対中追加関税の発動表明を受けて下落(円高)しました。9月以降は、米中貿易協議の進展への期待などを受け投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、一進一退を繰り返しながら上昇(円安)しました。2020年2月下旬から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などから一時的に大きく下落(円高)しました。その後、金融市場の動揺を背景にドル需要が強まったことや、米国で大型経済対策が成立したことから上昇(円安)に転じましたが、3月下旬以降は、市場予想を下回る米経済指標の発表や原油価格の急落などを受けて世界景気の先行き不透明感が意識される中、再び下落(円高)しました。

〇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」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い、また期中の資金流出入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)は行いませんでした。

〇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+9.4%となり、 ベンチマークである「円換算したFTSE4Good Developed 100 Index」の+7.3%を2.1ポイント 上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

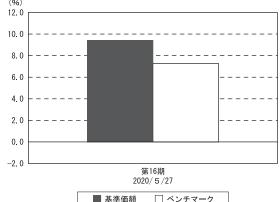
(プラス要因)

ベンチマークは配当収益が含まれていないが、ファンドでは配当収益が含まれていること

(マイナス要因)

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

基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)



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

(その他、差異を生じた要因)

- ・ 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)
- ・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。

野村グローバルSRI 100 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

(2019年5月28日~2020年5月27日)

	項	î					当	期		項目の概要
	华	Į.		Ħ		金	額	比	率	切り 似 安
							円		%	
(a) 3	売	買委	託	手 数	料		1	0.0	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
	(株		式)		(1)	(0.0	005)	
(b)	有	価 証	券	取引	税		1	0. (003	(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
	(株		式)		(1)	(0.0	003)	
(c) ·	そ	0)	他	費	用		14	0.0	058	(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	F 1	費用)		(14)	(0.0	057)	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
	(そ	Ø	他)		(0)	(0.0	000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
	合			計			16	0. (066	
	期中の平均基準価額は、24,291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。

〇売買及び取引の状況

(2019年5月28日~2020年5月27日)

株式

		買	付	売	付
		株 数	金 額	株 数	金額
玉		千株	千円	千株	千円
	上場	5	19, 809	3	3, 453
内		(1)	(-)		
		百株	千米ドル	百株	千米ドル
	アメリカ	151	1,642	192	1, 567
		(55)	(204)	(56)	(268)
			千カナダドル		千カナダドル
	カナダ	4	31	2	13
			千英ポンド		千英ポンド
外	イギリス	41	59	539	109
			千スイスフラン		千スイスフラン
	スイス	4	56	5	57
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	8	44	4	26
	イタリア	153	96	_	_
	フランス	7	53	6	40
玉	オランダ	0.85	8	2	12
	スペイン	22	13	1	3
	ベルギー	0.39	2	ĺ	_
			千香港ドル		千香港ドル
	香港	18	132	8	58
			千豪ドル		千豪ドル
	オーストラリア	16	215	124	325

^{*}金額は受け渡し代金。

〇株式売買比率

(2019年5月28日~2020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	491,073千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,009,419千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 16

^{*(}b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

^{*}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。

〇利害関係人との取引状況等

(2019年5月28日~2020年5月27日)

利害関係人との取引状況

		四八烷炒			主从婚处		
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{\mathrm{B}}{\mathrm{A}}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式		259	_	_	231	0.842836	0.4
為替直物取引		87	13	14. 9	147	2	1.4

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)				137千円
うち利害関係人への支払額	(B)			0.274千円
(B) / (A)				0.2%

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2020年5月27日現在)

国内株式

銘	柄	期首(前	前期末)	当	其	月	末	
少 白	מיוז	株	数	株	数	評	価	額
			千株		千株			千円
電気機器 (22.5%)								
ソニー			_		2. 4			16, 200
輸送用機器 (44.9%)								
トヨタ自動車			4.8		4.8			32, 352
情報・通信業(17.7%)								
日本電信電話			1.2		2. 4			5, 889
NTTドコモ			2.2		2.3			6,856
銀行業 (14.9%)								
三菱UFJフィナンシャル	ン・ グループ		23. 9		24. 1			10, 712
合 計 株 数	· 金額		32		36			72,010
銘 柄	数 < 比 率 >		4		5		<:	2.4%>

^{*}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

	期首(前	前期末)		当	当期末		
銘 柄	株	数	株	数		哲 額	業 種 等
(アメリカ)		百株		百株	 千米ドル	邦貨換算金額 千円	
AT & T INC		138		143	443	47, 670	各種電気通信サービス
ABBVIE INC		28		34	314	33, 762	バイオテクノロジー
ADOBE INC		9		9	353	38, 021	ソフトウェア
ALPHABET INC-CL C		5		5	830	89, 273	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL A		5 5		5 5	832	89, 547	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AMERICAN EXPRESS CO		12		13	124	13, 354	消費者金融
AMGEN INC		12		11	258	27, 783	付負有金融
ANTHEM INC		5		5	143	15, 387	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APPLE INC		90		80	2, 556	274, 898	コンピュータ・周辺機器
AUTOMATIC DATA PROCESS		8		8	118	12, 709	情報技術サービス
BANK OF AMERICA CORP		171		156	379	40, 851	銀行
BECTON, DICKINSON		5		5	121	13, 083	ヘルスケア機器・用品
BIOGEN INC		3		_	- 121	10,000	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC		2		2	151	16, 325	資本市場
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		31		46	278	29, 986	医薬品
CIGNA CORP		_		7	140	15, 102	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CVS HEALTH CORP		24		25	164	17, 728	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CISCO SYSTEMS		87		84	379	40, 749	通信機器
CITIGROUP		45		41	198	21, 362	銀行
COCA COLA CO		72		74	344	37, 064	飲料
COMCAST CORP-CL A		86		88	351	37, 759	メディア
DISNEY (WALT) CO		33		34	412	44, 328	娯楽
DOWDUPONT INC		43		_	_		化学
FEDEX CORPORATION		4		_	_	_	航空貨物・物流サービス
GOLDMAN SACHS GROUP		6		6	123	13, 258	資本市場
INTEL CORP		86		83	521	56, 056	半導体・半導体製造装置
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES		17		17	211	22, 685	情報技術サービス
INTUIT INC		_		4	139	14, 987	ソフトウェア
JOHNSON & JOHNSON		51		51	750	80, 738	医薬品
ELI LILLY & CO.		16		16	245	26, 358	医薬品
LOWES COS INC		15		15	186	20,010	専門小売り
MASTERCARD INC		17		17	525	56, 482	情報技術サービス
MERCK & CO INC		49		49	384	41, 298	医薬品
MICROSOFT CORP		144		148	2,689	289, 158	ソフトウェア
NIKE INC-B		23		23	222	23, 943	繊維・アパレル・贅沢品
NVIDIA CORP		11		11	397	42, 700	半導体・半導体製造装置
ORACLE CORPORATION		45		39	206	22, 232	ソフトウェア
PNC FINANCIAL		8		8	94	10, 153	銀行
PAYPAL HOLDINGS INC		22		22	337	36, 238	情報技術サービス
PROCTER & GAMBLE CO		47		47	535	57, 547	家庭用品
QUALCOMM INC		23		22	173	18, 696	半導体・半導体製造装置
SALESFORCE. COM INC		13		16	296	31, 901	ソフトウェア
SCHLUMBERGER LTD		26		_	_	_	エネルギー設備・サービス
STARBUCKS CORP		23		23	181	19, 562	ホテル・レストラン・レジャー
TJX COS INC		_		23	131	14, 126	専門小売り
T-MOBILE US INC		_		7	69	7, 490	無線通信サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC		18		18	212	22, 806	半導体・半導体製造装置
3M CORP		10		11	168	18, 164	コングロマリット
US BANCORP		28		26	96	10, 385	銀行
UNION PAC CORP		13		13	230	24, 823	陸運・鉄道
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		13		13	132	14, 245	航空貨物・物流サービス

	期首(前期末)	当	期末		
銘	株 数	株 数		五 額	業 種 等
	711	71. //	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	
UNITEDHEALTH GROUP INC	18	18	544	58, 556	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	78	80	439	47, 198	各種電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	33	33	650	69, 901	情報技術サービス
WELLS FARGO CO	79	72	190	20, 521	銀行
ACCENTURE PLC-CL A	12	12	244	26, 288	情報技術サービス
LINDE PLC	10	10	202	21, 807	化学
MEDTRONIC PLC	26	26	254	27, 312	ヘルスケア機器・用品
CHUBB LTD	8	8	104	11, 283	保険
小計株数・金額	1, 932	1,890	20, 795	2, 235, 676	
第 納 数 < 比 率 >	55	55	_	<73.2%>	
(カナダ)			千カナダドル		
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	23	23	133	10, 374	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	14	14	164	12,850	陸運・鉄道
ENBRIDGE INC	38	38	169	13, 229	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL BANK OF CANADA	27	28	249	19, 428	銀行
TORONTO DOMINION BANK	35	36	215	16, 812	銀行
小計株数・金額	138	140	932	72, 694	
□ 一	5	5	_	<2.4%>	
(イギリス)			千英ポンド		
DIAGEO PLC	45	44	128	16, 969	飲料
HSBC HOLDINGS PLC	385	393	152	20, 225	銀行
RIO TINTO PLC-REG	21	21	90	11, 986	金属・鉱業
GLAXOSMITHKLINE PLC	92	95	157	20, 930	医薬品
ASTRAZENECA PLC	25	25	225	29, 810	医薬品
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	85	79	104	13, 832	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	71	73	92	12, 274	石油・ガス・消耗燃料
UNILEVER PLC	20	21	88	11, 674	パーソナル用品
VODAFONE GROUP PLC	508	_	_	,	無線通信サービス
, *** * * * * * * * * * * * * * * * * *	1, 255	757	1,039	137, 704	
小 計 <u> </u>	9	8	_	<4.5%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NOVARTIS AG-REG	41	41	345	38, 438	医薬品
ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	0.51	0.51	17	1,940	医薬品
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	13	13	467	52, 036	医薬品
NESTLE SA-REG	57	56	579	64, 524	食品
, a 株 数 · 金 額	112	112	1, 409	156, 939	
小 計 銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	_	<5.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
EQUINOR ASA	18	18	277	3, 009	石油・ガス・消耗燃料
小計株数・金額	18	18	277	3, 009	
	1	1		< 0.1% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	32	32	1, 406	22, 239	医薬品
小計株数・金額	32	32	1, 406	22, 239	
野	1	1	_	< 0.7% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
SAP SE	18	19	212	25, 069	ソフトウェア
BAYER AG-REG	18	19	117	13, 827	医薬品
BASF SE	17	17	84	9, 914	化学
ALLIANZ SE-REG	8	8	131	15, 519	保険
SIEMENS AG	14	14	145	17, 193	コングロマリット
DEUTSCHE TELEKOM-REG	61	63	87	10, 326	各種電気通信サービス
小 計 株 数 ・ 金 額	138	142	779	91, 851	
M	6	6	_	<3.0%>	

	期首(前	前期末)		当	期	末			
銘	株	数	株	数	評 信 外貨建金額	断 額 類	業	種	等
(ユーロ…イタリア)		百株		百株	チューロ	千円			
ENEL SPA				153	. 99	11, 787	電力		
世 粉 . 今 妬		_		153	99	11, 787			
小 計 				1	_	<0.4%>			
(ユーロ…フランス)									
LOREAL-ORD		4		4	118	14,004	パーソナル	レ用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		4		4	176	20, 851	繊維・アク		贅沢品
HERMES INTERNATIONAL		0.6		0.6	42	5, 022	繊維・アク	ペレル・	贅沢品
KERING SA		1		1	65	7, 669	繊維・アク	ペレル・	贅沢品
SANOFI		20		21	183	21, 597	医薬品		
AXA		37		38	61	7, 211			
BNP PARIBAS		20		21	65	7, 748	銀行		
TOTAL SA		47		46	154	18, 250	石油・ガン	ス・消耗	燃料
姓 粉 · 夕 好		137		139	868	102, 354			
小 計 然 数 以 並 額		8		8	_	<3.4%>			
(ユーロ…オランダ)						, 0 -			
UNILEVER NV-CVA		29		_	_	_	パーソナル	レ用品	
UNILEVER NV		_		27	120	14, 196	パーソナ	レ用品	
ASML HOLDING NV		7		7	229	27, 087	半導体・		造装置
株 粉 · 仝 類		36		34	350	41, 284	1 1411	1 1111 200	,C34,E
小 計 		2		2	_	<1.4%>			
(ユーロ…スペイン)						, ,			
BANCO SANTANDER SA		304		324	66	7,852	銀行		
INDITEX SA		20		20	49	5, 863	専門小売り)	
」 株 数 · 金 額		324		345	116	13, 715			
3 銘 柄 数 < 比 率 >		2		2	=	< 0.4% >			
(ユーロ…ベルギー)									
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		14		14	60	7, 105	飲料		
小 計 株 数 ・ 金 額	1	14		14	60	7, 105			
路 忛 奴 < 比 平 >		1		1	_	< 0.2% >			
ユーロ計 株 数 · 金 額		650		830	2, 273	268, 098			
		19		20	_	<8.8%>			
(香港)					千香港ドル				
AIA GROUP LTD		230		240	1,554	21, 553	保険		
小計株数・金額	ļ	230		240	1,554	21, 553			
		1		1	_	< 0.7% >			
(オーストラリア)					千豪ドル				
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		55		_	-	_	銀行		
WESTPAC BANKING CORP		64		-	_	_	銀行		
BHP GROUP LIMITED		56		58	208	14, 869	金属・鉱業		
CSL LIMITED		_		8	272		バイオテク	ケノロジ	_
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1	33		34	211	15, 104	銀行		
小計株数・金額	_	210		102	692	49, 453			
		4		3	_	<1.6%>			
合 計 株 数 · 金 額		4, 581	4	1, 124	_	2, 967, 370			
ロ		99		98	_	< 97.1% >			

^{*}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。

^{*}邦貨換算金額欄のく >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。

○投資信託財産の構成

(2020年5月27日現在)

佰	П		当	其	朔 未	₹
項	目	評	価	額	比	率
				千円		%
株式				3, 039, 380		99. 1
コール・ローン等、その他				28, 941		0. 9
投資信託財産総額				3, 068, 321		100.0

- *金額の単位未満は切り捨て。
- *当期末における外貨建て純資産(2,993,070千円)の投資信託財産総額(3,068,321千円)に対する比率は97.5%です。
- *外貨建て資産は、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=107.51円、1カナダドル=77.93円、1英ポンド=132.47円、1スイスフラン=111.31円、1ノルウェークローネ=10.86円、1デンマーククローネ=15.81円、1ユーロ=117.90円、1香港ドル=13.87円、1豪ドル=71.39円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月27日現在)

〇損益の状況

(2019年5月28日~2020年5月27日)

	項目	当期末
		円
(A)	資産	3, 083, 018, 547
	コール・ローン等	9, 923, 545
	株式(評価額)	3, 039, 380, 406
	未収入金	28, 462, 385
	未収配当金	5, 252, 211
(B)	負債	28, 207, 778
	未払金	14, 705, 180
	未払解約金	13, 458, 596
	未払利息	2
	その他未払費用	44,000
(C)	純資産総額(A-B)	3, 054, 810, 769
	元本	1, 234, 385, 198
	次期繰越損益金	1, 820, 425, 571
(D)	受益権総口数	1, 234, 385, 198□
	1万口当たり基準価額(C/D)	24, 748円

- (注)期首元本額は1,253,739,100円、期中追加設定元本額は37,832,025円、期中一部解約元本額は57,185,927円、1口当たり純資産額は2,4748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 ・野村グローバルSRI 100 1,105,677,851円
 - 野村世界SRI (社会的責任投資) インデックスファンド (確定拠出年金向け)
 128,707,347円

		_
	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	61, 963, 460
	受取配当金	61, 695, 249
	受取利息	8, 500
	その他収益金	261, 347
	支払利息	△ 1,636
(B)	有価証券売買損益	204, 051, 946
	売買益	462, 952, 376
	売買損	△ 258, 900, 430
(C)	保管費用等	△ 1, 744, 874
(D)	当期損益金(A+B+C)	264, 270, 532
(E)	前期繰越損益金	1, 582, 143, 065
(F)	追加信託差損益金	55, 132, 855
(G)	解約差損益金	Δ 81, 120, 881
(H)	計(D+E+F+G)	1, 820, 425, 571
	次期繰越損益金(H)	1, 820, 425, 571

- *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(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。
- *損益の状況の中で(G)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。

〇お知らせ

該当事項はございません。

くお申し込み時の留意点>

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日(以下「申込不可日」といいます。)があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

(2020年5月27日現在)

年 月	
2020年5月	_
6月	_
7月	2.3
8月	_
9月	4.7
10月	_
11月	25、26
12月	24、25

^{※2020}年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご留意下さい。また、諸事情等による申込不可 日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (http://www.nomura-am.co.jp/) にも掲載いたしております。