

野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース／Bコース (野村SMA・EW向け)

運用報告書(全体版)

第6期(決算日2021年12月6日)

作成対象期間(2020年12月8日～2021年12月6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。

	Aコース	Bコース
商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	2016年8月25日以降、無期限とします。	
運用方針	野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界(新興国を含みます。)の企業の発行する株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に投資し、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。	
	実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジ(先進国通貨等による代替ヘッジを含みます。)により為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
主な投資対象	野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース/Bコース(野村SMA・EW向け) マザーファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式(DR(預託証券)を含みます。)等に直接投資する場合があります。 日本を除く世界(新興国を含みます。)の企業の発行する株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース/Bコース(野村SMA・EW向け) マザーファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建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、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。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ないません。	

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/>

＜Aコース＞

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			株組入比率	株先物比率	純資産額
		税金	分配	騰落率			
	円		円	%	%	%	百万円
2期(2017年12月6日)	13,058		10	18.5	91.9	—	1,827
3期(2018年12月6日)	11,396		10	△12.7	96.2	—	3,527
4期(2019年12月6日)	12,628		10	10.9	96.5	—	2,772
5期(2020年12月7日)	14,047		10	11.3	95.6	—	2,263
6期(2021年12月6日)	16,193		10	15.3	94.5	—	2,955

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 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。

* 当ファンドは特定の指数等を念頭に置いた運用を行なっていないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		株組入比率	株先物比率
		騰落率	騰落率		
(期首)	円	%	%	%	%
2020年12月7日	14,047	—	95.6	—	—
12月末	14,000	△0.3	95.1	—	—
2021年1月末	14,268	1.6	96.9	—	—
2月末	15,298	8.9	97.6	—	—
3月末	16,024	14.1	97.1	—	—
4月末	16,527	17.7	96.8	—	—
5月末	16,873	20.1	96.4	—	—
6月末	16,718	19.0	93.7	—	—
7月末	16,783	19.5	92.9	—	—
8月末	16,730	19.1	96.3	—	—
9月末	16,582	18.0	96.3	—	—
10月末	17,149	22.1	97.0	—	—
11月末	16,309	16.1	96.3	—	—
(期末)					
2021年12月6日	16,203	15.3	94.5	—	—

* 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。

＜Bコース＞

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			株組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金	騰落	騰落率			
	円	円		%	%	%	百万円
2期(2017年12月6日)	14,886	10		22.9	92.2	—	3,188
3期(2018年12月6日)	12,920	10		△13.1	96.6	—	5,274
4期(2019年12月6日)	13,945	10		8.0	96.3	—	4,094
5期(2020年12月7日)	15,366	10		10.3	95.5	—	3,575
6期(2021年12月6日)	18,683	10		21.7	95.8	—	4,395

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 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。

* 当ファンドは特定の指数等を念頭に置いた運用を行なっていないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		株組入比率	株式先物比率
		騰落	騰落率		
(期首)	円		%	%	%
2020年12月7日	15,366		—	95.5	—
12月末	15,304		△ 0.4	94.7	—
2021年1月末	15,694		2.1	96.3	—
2月末	17,102		11.3	95.7	—
3月末	18,335		19.3	96.8	—
4月末	18,881		22.9	96.2	—
5月末	19,477		26.8	95.6	—
6月末	19,235		25.2	93.4	—
7月末	19,149		24.6	93.8	—
8月末	19,082		24.2	96.8	—
9月末	19,101		24.3	95.5	—
10月末	20,153		31.2	96.2	—
11月末	18,926		23.2	97.2	—
(期末)					
2021年12月6日	18,693		21.7	95.8	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

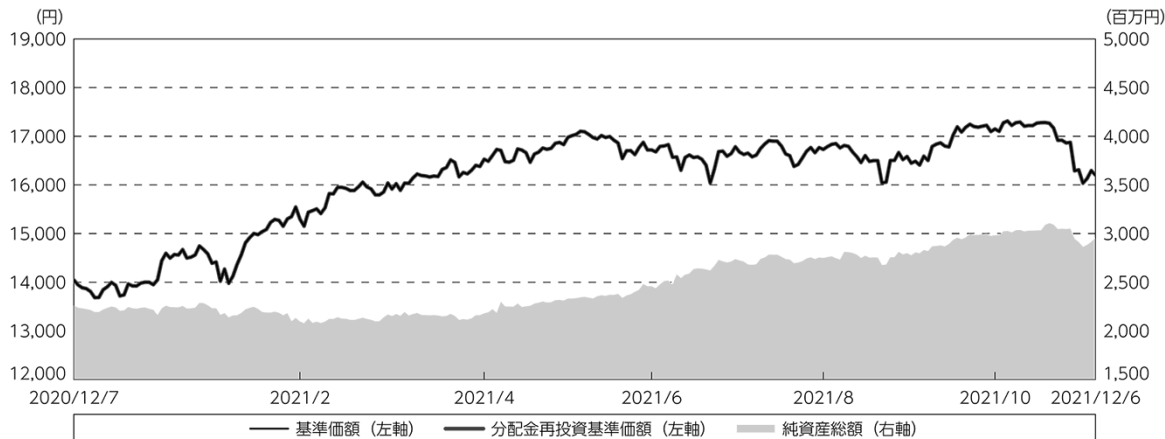
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

<Aコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(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(2020年12月7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) 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14,047円から期末16,193円となりました。

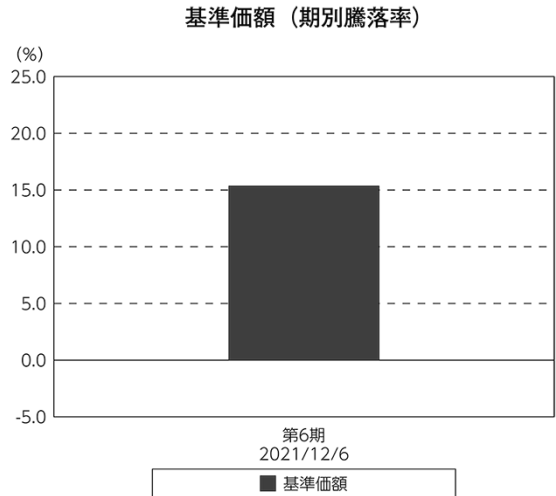
- (上昇) 2021年2月、米国の経済指標や企業決算が市場予想を上回ったこと、新型コロナウイルスの新規感染者数が減少傾向となったことに加え、ワクチン普及による経済正常化への期待が高まったこと、FRB(米連邦準備制度理事会)による金融緩和の長期化観測などが好感されたこと
- (上昇) 3月、1.9兆ドル(約200兆円)規模の「米国救済計画」が成立したこと、米国でワクチン接種が進み米景気の回復基調が強まるとの見方が広がったこと
- (上昇) 10月、新型コロナウイルスの経口治療薬の早期実用化への期待が台頭したことや、米与野党が連邦政府の債務上限問題の先送りでも合意し、当面の懸念が後退したこと、市場予想を上回る欧米企業の7-9月期決算が続いたこと
- (下落) 11月、欧州で新型コロナウイルスの感染が再拡大したこと、新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大が懸念されたこと

<Aコース>

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは特定の指数等を念頭に置いた運用を行っていないため、ベンチマーク等はありません。

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込みです。

◎分配金

基準価額水準などを勘案し、Aコースでは1万口当たり10円の収益分配を行ないました。なお、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6期
	2020年12月8日～ 2021年12月6日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.062%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,192

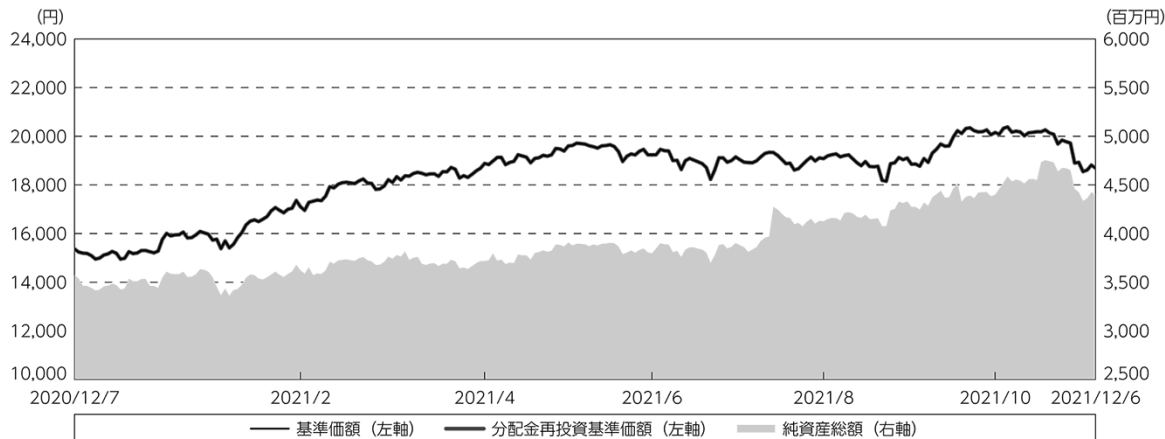
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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。

<Bコース>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：15,366円

期末：18,683円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：21.7%（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（2020年12月7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) 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15,366円から期末18,683円となりました。

(上昇) 2021年2月、米国の経済指標や企業決算が市場予想を上回ったこと、新型コロナウイルスの新規感染者数が減少傾向となったことに加え、ワクチン普及による経済正常化への期待が高まったこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融緩和の長期化観測などが好感されたこと、また、米長期金利が上昇し、日米金利差の拡大が意識される中、ドルが対円で上昇基調となったこと

(上昇) 3月、1.9兆ドル（約200兆円）規模の「米国救済計画」が成立したこと、米国でワクチン接種が進み米景気の回復基調が強まるとの見方が広がったこと、米長期金利が上昇し、日米金利差の拡大が意識されドル高・円安となったこと

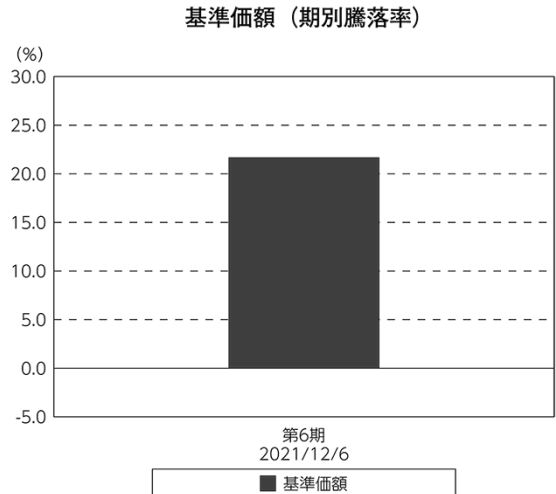
<Bコース>

- (上昇) 10月、新型コロナウイルスの経口治療薬の早期実用化への期待が台頭したことや、米与野党が連邦政府の債務上限問題の先送りで合意し、当面の懸念が後退したこと、市場予想を上回る欧米企業の7-9月期決算が続いたこと、米金融政策の正常化が意識され、米長期金利が上昇基調を強めたことを受けて、ドル高・円安となったこと
- (下落) 11月、欧州で新型コロナウイルスの感染が再拡大したこと、新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大が懸念されたこと

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは特定の指数等を念頭に置いた運用を行っていないため、ベンチマーク等はありません。

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込みです。

<Bコース>

◎分配金

基準価額水準などを勘案し、Bコースでは1万口当たり10円の収益分配を行ないました。なお、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6期
	2020年12月8日～ 2021年12月6日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.053%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,683

（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。

<Aコース/Bコース>

○投資環境

期中の世界株式市場は、新型コロナウイルスの感染等の動向や、各国の経済活動状況などに左右される展開となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース（野村SMA・EW向け）] および [野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Bコース（野村SMA・EW向け）] は、主要投資対象である [野村ハリス外国株式バリューストラテジーマザーファンド] 受益証券を高位に組み入れました。

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーマザーファンド]

・株式組入比率

期を通じて概ね高位を維持しました。

・期中の主な動き

- ・流動性等から選定された投資対象銘柄の中から、企業の収益性や資本の効率性等に関する定量的な評価と財務分析や企業訪問等による徹底的な調査に基づく企業の定性評価をもとに、株価が割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とし、組入候補銘柄から、期待収益率やリスク分散を考慮して銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築してまいりました。
- ・米国の情報管理・電子商取引システムのサービス会社などを新規に買い付けした一方、米国の電子計測機器メーカーなどを全売却しました。

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース（野村SMA・EW向け）]

・株式組入比率

実質株式組入比率は、概ね高位を維持しました。

・為替ヘッジ

当ファンドの運用の基本方針に従い、実質外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図りました。

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Bコース（野村SMA・EW向け）]

・株式組入比率

実質株式組入比率は、概ね高位を維持しました。

・為替ヘッジ

当ファンドの運用の基本方針に従い、為替ヘッジを行ないませんでした。

<Aコース/Bコース>

◎今後の運用方針

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド]

株式への投資にあたっては、流動性等から選定された投資対象銘柄の中から、企業の収益性や資本の効率性等に関する定量的な評価と財務分析や企業訪問等による徹底的な調査に基づく企業の定性評価をもとに、株価が割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とし、組入候補銘柄から、期待収益率やリスク分散を考慮して銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築してまいります。

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース（野村SMA・EW向け）]

主要投資対象である[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド]受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建資産については為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを目指します。

[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Bコース（野村SMA・EW向け）]

主要投資対象である[野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド]受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建資産については為替ヘッジを行いません。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

<Aコース>

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月8日～2021年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 177	% 1.097	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(159)	(0.987)	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 ）	(9)	(0.055)	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 ）	(9)	(0.055)	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	4	0.024	(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 ）	(4)	(0.024)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.018	(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 ）	(3)	(0.018)	
(d) そ の 他 費 用	11	0.071	(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)	(0.066)	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)	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	195	1.210	
期中の平均基準価額は、16,105円です。			

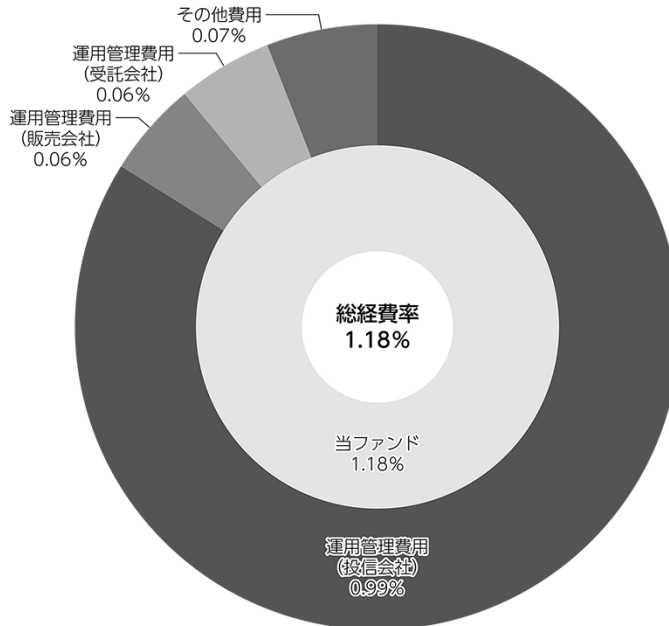
- * 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<Aコース>

(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1.18%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。

<Aコース>

○売買及び取引の状況

(2020年12月8日～2021年12月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	千口 763,198	千円 1,538,371	千口 700,847	千円 1,319,941

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年12月8日～2021年12月6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	
	野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	5,927,625千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,130,954千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.96	

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年12月8日～2021年12月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2021年12月6日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	千口 1,384,069	千口 1,446,420	千円 2,889,948

*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。

<Aコース>

○投資信託財産の構成

(2021年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	2,889,948	97.1
コール・ローン等、その他	86,892	2.9
投資信託財産総額	2,976,840	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(7,104,132千円)の投資信託財産総額(7,336,244千円)に対する比率は96.8%です。

*外貨建資産は、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=113.08円、1英ポンド=149.66円、1スイスフラン=122.94円、1ユーロ=127.70円、1香港ドル=14.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,732,281,084
コール・ローン等	29,770,801
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド(評価額)	2,889,948,306
未収入金	2,812,561,977
(B) 負債	2,776,673,725
未払金	2,755,520,955
未払収益分配金	1,825,284
未払解約金	4,178,284
未払信託報酬	15,103,935
未払利息	19
その他未払費用	45,248
(C) 純資産総額(A-B)	2,955,607,359
元本	1,825,284,469
次期繰越損益金	1,130,322,890
(D) 受益権総口数	1,825,284,469口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,193円

(注) 期首元本額は1,611,432,282円、期中追加設定元本額は963,822,195円、期中一部解約元本額は749,970,008円、1口当たり純資産額は1.6193円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額37,942,048円。(野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド)

○損益の状況 (2020年12月8日~2021年12月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,434
支払利息	△ 6,434
(B) 有価証券売買損益	203,783,878
売買益	525,820,792
売買損	△ 322,036,914
(C) 信託報酬等	△ 27,251,194
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	176,526,250
(E) 前期繰越損益金	184,288,046
(F) 追加信託差損益金	771,333,878
(配当等相当額)	(413,122,086)
(売買損益相当額)	(358,211,792)
(G) 計(D+E+F)	1,132,148,174
(H) 収益分配金	△ 1,825,284
次期繰越損益金(G+H)	1,130,322,890
追加信託差損益金	771,333,878
(配当等相当額)	(414,711,242)
(売買損益相当額)	(356,622,636)
分配準備積立金	358,989,012

*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。

<Aコース>

(注) 分配金の計算過程（2020年12月8日～2021年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年12月8日～ 2021年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	22,506,830円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	154,019,420円
c. 信託約款に定める収益調整金	771,333,878円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	184,288,046円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,132,148,174円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,202円
g. 分配金	1,825,284円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	10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。

○お知らせ

該当事項はございません。

<Bコース>

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月8日～2021年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	202	1.097	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(181)	(0.987)	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 ）	(10)	(0.055)	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 ）	(10)	(0.055)	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	4	0.024	(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 ）	(4)	(0.024)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.017	(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 ）	(3)	(0.017)	
(d) そ の 他 費 用	13	0.072	(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 ）	(12)	(0.066)	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)	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	222	1.210	
期中の平均基準価額は、18,369円です。			

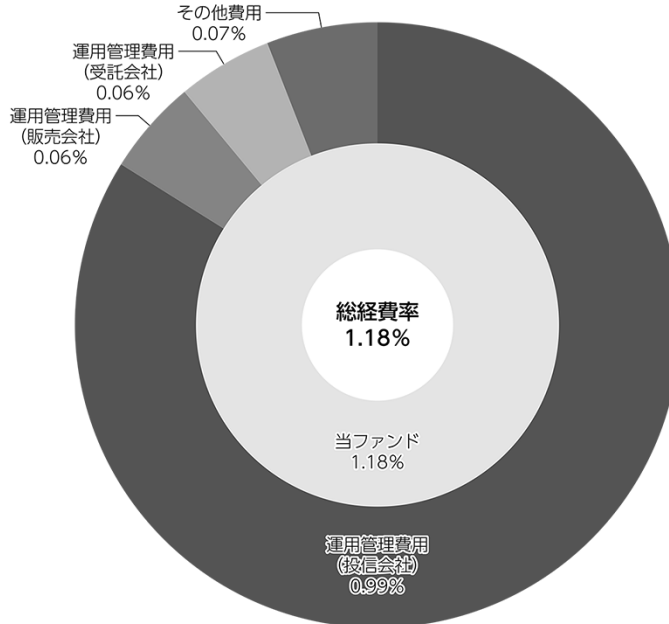
- * 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<Bコース>

(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1.18%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。

<Bコース>

○売買及び取引の状況

(2020年12月8日～2021年12月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	1,037,411	2,083,056	1,040,691	1,977,392

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年12月8日～2021年12月6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	
	野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	5,927,625千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,130,954千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.96	

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年12月8日～2021年12月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2021年12月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	2,183,573	2,180,292	4,356,224

*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。

<Bコース>

○投資信託財産の構成

(2021年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド	4,356,224	98.4
コール・ローン等、その他	72,204	1.6
投資信託財産総額	4,428,428	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(7,104,132千円)の投資信託財産総額(7,336,244千円)に対する比率は96.8%です。

*外貨建資産は、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=113.08円、1英ポンド=149.66円、1スイスフラン=122.94円、1ユーロ=127.70円、1香港ドル=14.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,428,428,898
コール・ローン等	44,304,094
野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド(評価額)	4,356,224,804
未収入金	27,900,000
(B) 負債	32,579,799
未払収益分配金	2,352,839
未払解約金	7,315,173
未払信託報酬	22,843,290
未払利息	29
その他未払費用	68,468
(C) 純資産総額(A-B)	4,395,849,099
元本	2,352,839,037
次期繰越損益金	2,043,010,062
(D) 受益権総口数	2,352,839,037口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,683円

(注) 期首元本額は2,326,641,551円、期中追加設定元本額は1,120,874,011円、期中一部解約元本額は1,094,676,525円、1口当たり純資産額は1,8683円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額37,942,048円。(野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド)

○損益の状況

(2020年12月8日~2021年12月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 8,479
支払利息	△ 8,479
(B) 有価証券売買損益	472,980,517
売買益	688,573,215
売買損	△ 215,592,698
(C) 信託報酬等	△ 42,936,207
(D) 当期損益金(A+B+C)	430,035,831
(E) 前期繰越損益金	233,066,956
(F) 追加信託差損益金	1,382,260,114
(配当等相当額)	(626,361,185)
(売買損益相当額)	(755,898,929)
(G) 計(D+E+F)	2,045,362,901
(H) 収益分配金	△ 2,352,839
次期繰越損益金(G+H)	2,043,010,062
追加信託差損益金	1,382,260,114
(配当等相当額)	(628,071,684)
(売買損益相当額)	(754,188,430)
分配準備積立金	660,749,948

*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。

<Bコース>

(注) 分配金の計算過程（2020年12月8日～2021年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年12月8日～ 2021年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	38,326,494円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	391,709,337円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,382,260,114円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	233,066,956円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,045,362,901円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	8,693円
g. 分配金	2,352,839円
h. 分配金(1万円当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	10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。

○お知らせ

該当事項はございません。

野村ハリス外国株式バリュートラッキング戦略 マザーファンド

運用報告書

第6期（決算日2021年12月6日）

作成対象期間（2020年12月8日～2021年12月6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	日本を除く世界（新興国を含みます。）の企業の発行する株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行なうことを基本とします。株式への投資にあたっては、流動性等から選定された投資対象銘柄の中から、企業の収益性や資本の効率性等に関する定量的な評価と財務分析や企業訪問等による徹底的な調査に基づく企業の定性評価をもとに、株価が割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とします。組入候補銘柄から、期待収益率やリスク分散を考慮して銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	日本を除く世界（新興国を含みます。）の企業の発行する株式（DR（預託証券）を含みます。）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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		株組入比率	株式先物比率	純資産額
		期騰	中率			
2期(2017年12月6日)	円 15,180		% 24.2	% 92.3	% —	百万円 5,003
3期(2018年12月6日)	13,306		△12.3	97.1	—	8,745
4期(2019年12月6日)	14,537		9.3	96.8	—	6,836
5期(2020年12月7日)	16,212		11.5	96.5	—	5,783
6期(2021年12月6日)	19,980		23.2	96.6	—	7,246

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドは特定の指数等を念頭に置いた運用を行っていないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		株組入比率	株式先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年12月7日	円 16,212		% —	% 96.5	% —
12月末	16,159		△0.3	95.6	—
2021年1月末	16,591		2.3	97.2	—
2月末	18,109		11.7	96.5	—
3月末	19,444		19.9	97.4	—
4月末	20,049		23.7	96.8	—
5月末	20,710		27.7	96.0	—
6月末	20,467		26.2	94.2	—
7月末	20,393		25.8	94.5	—
8月末	20,342		25.5	97.6	—
9月末	20,374		25.7	96.2	—
10月末	21,523		32.8	96.8	—
11月末	20,224		24.7	97.6	—
(期末) 2021年12月6日	19,980		23.2	96.6	—

*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

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首16,212円から期末19,980円となりました。

- (上昇) 2021年2月、米国の経済指標や企業決算が市場予想を上回ったこと、新型コロナウイルスの新規感染者数が減少傾向となったことに加え、ワクチン普及による経済正常化への期待が高まったこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融緩和の長期化観測などが好感されたこと、また、米長期金利が上昇し、日米金利差の拡大が意識される中、ドルが対円で上昇基調となったこと
- (上昇) 3月、1.9兆ドル（約200兆円）規模の「米国救済計画」が成立したこと、米国でワクチン接種が進み米景気の回復基調が強まるとの見方が広がったこと、米長期金利が上昇し、日米金利差の拡大が意識されドル高・円安となったこと
- (上昇) 10月、新型コロナウイルスの経口治療薬の早期実用化への期待が台頭したことや、米与野党が連邦政府の債務上限問題の先送りで合意し、当面の懸念が後退したこと、市場予想を上回る欧米企業の7-9月期決算が続いたこと、米金融政策の正常化が意識され、米長期金利が上昇基調を強めたことを受けて、ドル高・円安となったこと
- (下落) 11月、欧州で新型コロナウイルスの感染が再拡大したこと、新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大が懸念されたこと

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

期を通じて概ね高位を維持しました。

・期中の主な動き

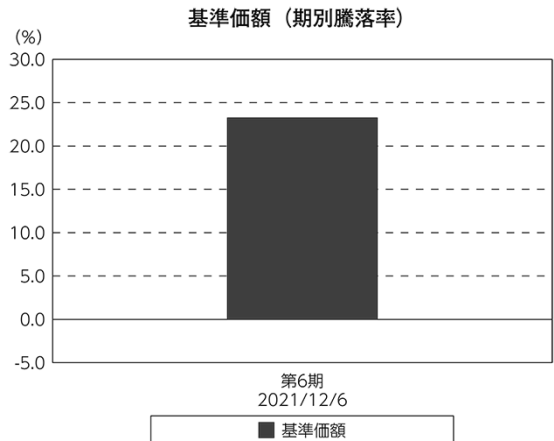
・流動性等から選定された投資対象銘柄の中から、企業の収益性や資本の効率性等に関する定量的な評価と財務分析や企業訪問等による徹底的な調査に基づく企業の定性評価をもとに、株価が割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とし、組入候補銘柄から、期待収益率やリスク分散を考慮して銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築してまいりました。

・米国の情報管理・電子商取引システムのサービス会社などを新規に買い付けした一方、米国の電子計測機器メーカーなどを全売却しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは特定の指数等を念頭に置いた運用を行っていないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

株式への投資にあたっては、流動性等から選定された投資対象銘柄の中から、企業の収益性や資本の効率性等に関する定量的な評価と財務分析や企業訪問等による徹底的な調査に基づく企業の定性評価をもとに、株価が割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とし、組入候補銘柄から、期待収益率やリスク分散を考慮して銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月8日～2021年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 5 (5)	% 0.024 (0.024)	(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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	3 (3)	0.017 (0.017)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	13 (13) (0)	0.069 (0.066) (0.002)	(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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	21	0.110	
期中の平均基準価額は、19,532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。

○売買及び取引の状況

(2020年12月8日～2021年12月6日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 1,463	千米ドル 14,365	百株 1,466 (52)	千米ドル 13,050 (1,070)
	イギリス	508 (-)	千英ポンド 299 (△ 54)	6,772	千英ポンド 2,583
	スイス	993 (2,084)	千スイスフラン 2,435 (14)	711 (1,999)	千スイスフラン 2,217 (-)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
国	ドイツ	920	6,002	374	2,842
	イタリア	90	131	1,127	1,330
	フランス	412	2,117	263	1,321
	オランダ	53 (-)	381 (△0.5649)	-	-
	香港	395 (420)	千香港ドル 7,337 (8,343)	27	千香港ドル 679

*金額は受け渡し代金。

*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。

新株予約権付社債（転換社債）

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外 国	スイス	千スイスフラン -	千スイスフラン -	千スイスフラン - (73)	千スイスフラン - (-)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は予約権行使・償還等による増減分です。

○株式売買比率

(2020年12月8日～2021年12月6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	5,927,625千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,130,954千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.96

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年12月8日～2021年12月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2021年12月6日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				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	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	90	—	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	10	—	—	—	—	インターネット販売・通信販売
ALPHABET INC-CL A	16	15	4,399	497,462	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AMERICAN INTL GROUP	271	272	1,454	164,452	—	保険
AUTOMATIC DATA PROCESS	32	—	—	—	—	情報技術サービス
BANK OF AMERICA CORP	363	364	1,596	180,573	—	銀行
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	93	87	2,430	274,816	—	各種金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	7	5	1,207	136,526	—	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	26	—	—	—	—	機械
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	12	21	1,433	162,080	—	メディア
CITIGROUP	159	159	1,001	113,231	—	銀行
COMCAST CORP-CL A	110	110	572	64,700	—	メディア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	25	25	572	64,711	—	飲料
FISERV INC	—	272	2,735	309,342	—	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	—	47	938	106,153	—	航空宇宙・防衛
GENERAL MOTORS CO	246	211	1,265	143,108	—	自動車
GRUPO TELEVISIA SA-SPONS ADR	726	696	669	75,732	—	メディア
HCA HEALTHCARE INC	95	81	1,865	210,955	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HALLIBURTON CO	395	396	871	98,515	—	エネルギー設備・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	148	84	1,173	132,648	—	ホテル・レストラン・レジャー
HUMANA INC	—	46	1,965	222,215	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	541	580	1,999	226,076	—	飲料
MOODYS CORP	28	—	—	—	—	資本市場
NASPERS LTD-N SHS SPON ADR	390	458	1,391	157,304	—	インターネット販売・通信販売
VISA INC-CLASS A SHARES	—	37	730	82,583	—	情報技術サービス
WORKDAY INC-CLASS A	37	—	—	—	—	ソフトウェア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	624	443	1,209	136,813	—	各種電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	19	—	—	—	—	各種電気通信サービス
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額		
	銘柄 数 < 比率 >	銘柄 数 < 比率 >				
			4,473	4,418	31,482	3,560,004
			24	21	—	<49.1%>
(イギリス)				千英ポンド		
GLENCORE PLC	9,936	4,383	1,542	230,849	—	金属・鉱業
WPP PLC	1,094	477	508	76,094	—	メディア
COMPASS GROUP PLC	410	316	477	71,482	—	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額		
	銘柄 数 < 比率 >	銘柄 数 < 比率 >				
			11,440	5,176	2,528	378,426
			3	3	—	<5.2%>
(スイス)				千スイスフラン		
NOVARTIS AG-REG	74	150	1,105	135,851	—	医薬品
HOLCIM LTD	130	269	1,193	146,729	—	建設資材

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
			株数	株数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百円			千スイスフラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,263		2,538		2,244	275,924	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	299		259		1,501	184,619	資本市場
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	83		—		—	—	繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株数・金額	2,851	3,217	6,044	743,124		
	銘柄数<比率>	5	4	—	<10.3%>		
(ユーロ…ドイツ)					千ユーロ		
FRESENIUS SE & CO KGAA	—		257		860	109,843	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SAP SE	—		83		957	122,311	ソフトウェア
HENKEL AG & CO KGAA	35		88		586	74,857	家庭用品
BAYER AG-REG	418		552		2,443	311,983	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24		10		73	9,354	家庭用品
FRESENIUS MEDICAL CARE	112		242		1,309	167,216	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	86		109		2,163	276,257	保険
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	360		259		2,223	283,958	自動車
BAYER MOTOREN WERK	112		92		811	103,636	自動車
小 計	株数・金額	1,150	1,695	11,428	1,459,420		
	銘柄数<比率>	7	9	—	<20.1%>		
(ユーロ…イタリア)							
CNH INDUSTRIAL NV	2,051		1,014		1,511	193,068	機械
小 計	株数・金額	2,051	1,014	1,511	193,068		
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.7%>		
(ユーロ…フランス)							
BNP PARIBAS	547		395		2,221	283,652	銀行
DANONE	—		104		550	70,309	食品
WORLDLINE SA	—		197		905	115,621	情報技術サービス
小 計	株数・金額	547	696	3,677	469,583		
	銘柄数<比率>	1	3	—	<6.5%>		
(ユーロ…オランダ)							
PROSUS NV	—		53		372	47,597	インターネット販売・通信販売
小 計	株数・金額	—	53	372	47,597		
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.7%>		
ユ ー ロ 計	株数・金額	3,748	3,459	16,990	2,169,669		
	銘柄数<比率>	9	14	—	<29.9%>		
(香港)					千香港ドル		
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	86		874		10,440	151,384	インターネット販売・通信販売
小 計	株数・金額	86	874	10,440	151,384		
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.1%>		
合 計	株数・金額	22,601	17,146	—	7,002,610		
	銘柄数<比率>	42	43	—	<96.6%>		

* 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〈 〉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。

* 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

(2021年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 7,002,610	% 95.5
コール・ローン等、その他	333,634	4.5
投資信託財産総額	7,336,244	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建純資産(7,104,132千円)の投資信託財産総額(7,336,244千円)に対する比率は96.8%です。

*外貨建資産は、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=113.08円、1英ポンド=149.66円、1スイスフラン=122.94円、1ユーロ=127.70円、1香港ドル=14.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月6日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,401,112,803 円
コール・ローン等	292,140,735
株式(評価額)	7,002,610,081
未収入金	105,230,018
未収配当金	1,131,969
(B) 負債	154,764,218
未払金	106,564,093
未払解約金	48,200,000
未払利息	125
(C) 純資産総額(A-B)	7,246,348,585
元本	3,626,713,269
次期繰越損益金	3,619,635,316
(D) 受益権総口数	3,626,713,269口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,980円

(注) 期首元本額は3,567,643,047円、期中追加設定元本額は1,800,609,519円、期中一部解約元本額は1,741,539,297円、1口当たり純資産額は1,9980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
・野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Bコース(野村SMA・EW向け) 2,180,292,695円
・野村ハリス外国株式バリューストラテジーファンド Aコース(野村SMA・EW向け) 1,446,420,574円

○損益の状況 (2020年12月8日~2021年12月6日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	67,352,998 円
受取配当金	67,094,107
受取利息	252,156
その他収益金	52,915
支払利息	△ 46,180
(B) 有価証券売買損益	1,075,306,913
売買益	1,499,510,355
売買損	△ 424,203,442
(C) 保管費用等	△ 4,373,394
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,138,286,517
(E) 前期繰越損益金	2,216,325,211
(F) 追加信託差損益金	1,820,817,831
(G) 解約差損益金	△1,555,794,243
(H) 計(D+E+F+G)	3,619,635,316
次期繰越損益金(H)	3,619,635,316

*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。

○お知らせ

該当事項はございません。