

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8期(決算日2023年12月6日)

作成対象期間(2022年12月7日～2023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。
	マザーファンド	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)	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。
	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
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
7期(2022年12月6日)	15,300		10	△ 5.5	93.0	—	3,329
8期(2023年12月6日)	15,624		10	2.2	94.2	—	3,227

* 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) 2022年12月6日	円 15,300	% —	% 93.0	% —	
12月末	14,696	△ 3.9	91.4	—	
2023年1月末	15,973	4.4	94.6	—	
2月末	15,802	3.3	96.9	—	
3月末	15,648	2.3	97.9	—	
4月末	15,792	3.2	95.5	—	
5月末	15,713	2.7	94.2	—	
6月末	16,132	5.4	96.6	—	
7月末	16,945	10.8	95.4	—	
8月末	16,463	7.6	94.9	—	
9月末	15,834	3.5	95.8	—	
10月末	14,611	△ 4.5	95.9	—	
11月末	15,446	1.0	93.1	—	
(期末) 2023年12月6日	円 15,624	2.2	94.2	—	

* 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)	標準価額			株組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金	込配	み騰 期騰 落			
	円		円		%	%	百万円
4期(2019年12月6日)	13,945		10		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
7期(2022年12月6日)	20,743		10		11.1	94.0	6,961
8期(2023年12月6日)	24,082		10		16.1	96.1	10,620

* 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	標準価額		株組入比率	株式先物比率
		騰	落率		
(期首) 2022年12月6日	円 20,743		% —	% 94.0	% —
12月末	19,545	△	5.8	94.2	—
2023年1月末	21,113		1.8	94.9	—
2月末	21,640		4.3	95.5	—
3月末	21,339		2.9	96.5	—
4月末	21,813		5.2	95.3	—
5月末	22,383		7.9	93.2	—
6月末	24,009		15.7	94.5	—
7月末	24,831		19.7	95.0	—
8月末	24,991		20.5	94.3	—
9月末	24,281		17.1	95.2	—
10月末	22,543		8.7	95.9	—
11月末	23,897		15.2	94.9	—
(期末) 2023年12月6日	円 24,092		16.1	96.1	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

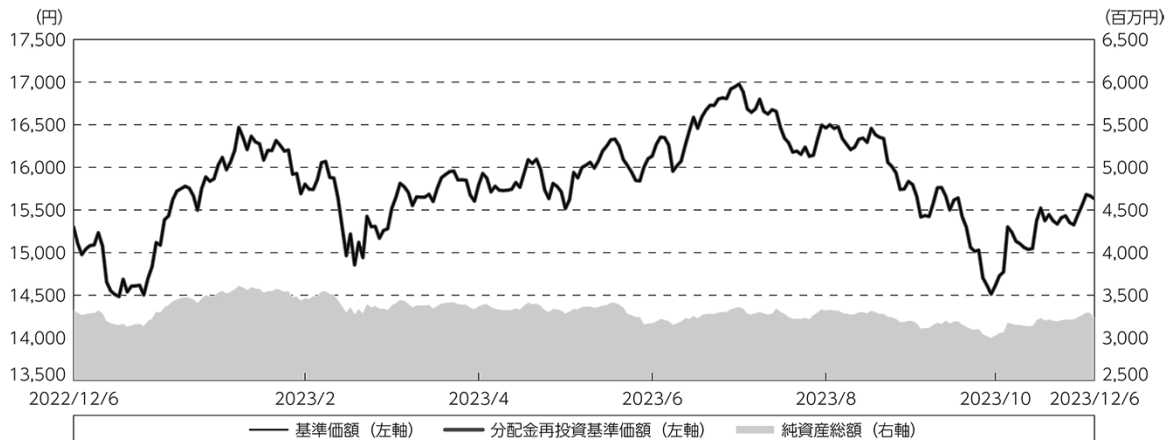
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

* 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



期首：15,300円

期末：15,624円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 2.2%（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。作成期首（2022年12月6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15,300円から期末15,624円となりました。

- (上昇) 2023年1月、2022年12月の米雇用統計において賃金上昇率が前月から減速したこと、12月のISM非製造業景況感指数が市場予想に反して低下したことなどから、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締め長期化への警戒が和らいだこと
- (上昇) 7月、6月の米CPI（消費者物価指数）上昇率が市場予想を下回ったことでFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利が据え置かれるとの期待感が高まったことや、米大手金融機関などの4-6月期決算が市場予想を上回ったこと
- (下落) 9月、FOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたものの、年内に追加利上げを行わない、高い金利水準の維持が示唆されたこと

<Aコース>

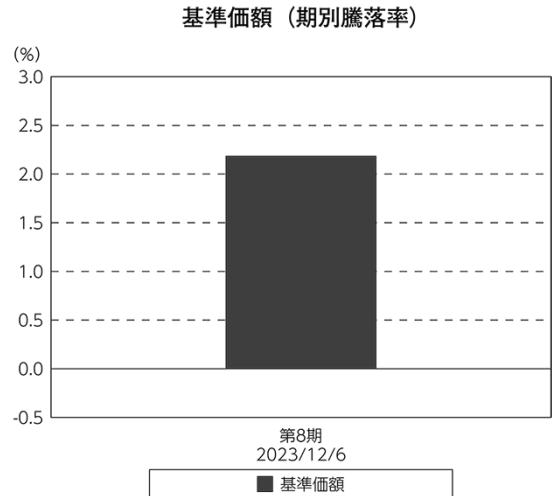
（下落）10月、米下院議長選挙での選出遅れによる混乱や、大手IT企業の決算において先行き不透明感が強まったこと

（上昇）11月、7-9月期の米企業決算において市場予想を上回る決算が相次いだことや、10月の米CPI上昇率が市場予想を下回ったことなどが好感されたこと

○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。

<Aコース>

◎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8期
	2022年12月7日～ 2023年12月6日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.064%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,623

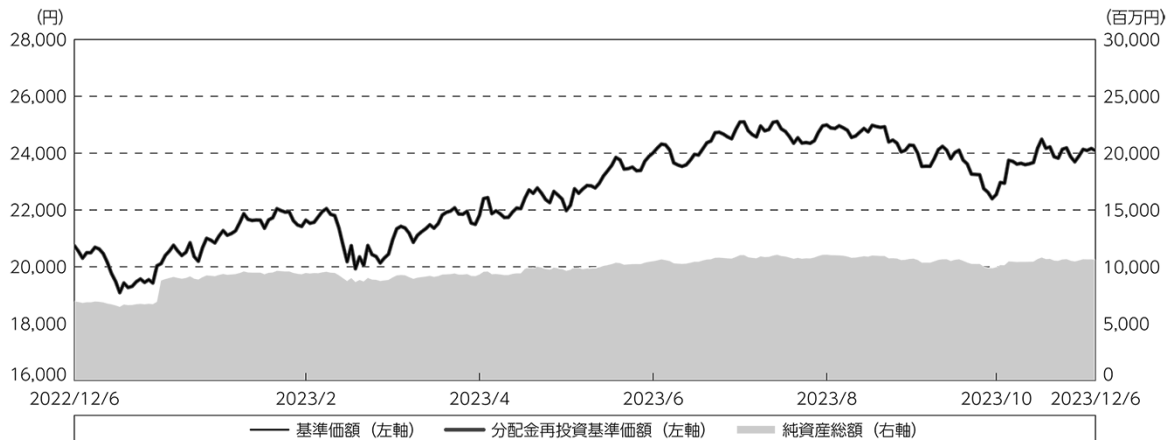
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（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：20,743円

期末：24,082円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：16.1%（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12月6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20,743円から期末24,082円となりました。

- (上昇) 2023年1月、2022年12月の米雇用統計において賃金上昇率が前月から減速したこと、12月のISM非製造業景況感指数が市場予想に反して低下したことなどから、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締め長期化への警戒が和らいだこと
- (上昇) 6月、FRBの金融引き締め継続と日銀の大規模な金融緩和策の維持が示されたことなどから日米金利差の拡大期待が強まり、月末のドル・円レートは円安・ドル高となったこと
- (上昇) 7月、6月の米CPI（消費者物価指数）上昇率が市場予想を下回ったことでFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利が据え置かれるとの期待感が高まったことや、米大手金融機関などの4-6月期決算が市場予想を上回ったこと

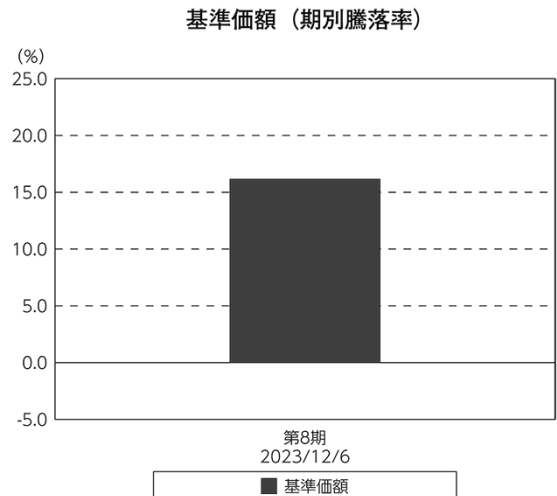
<Bコース>

- （下落） 9月、FOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたものの、年内に追加利上げを行ない、高い金利水準の維持が示唆されたこと
- （下落） 10月、米下院議長選挙での選出遅れによる混乱や、大手IT企業の決算において先行き不透明感が強まったこと
- （上昇） 11月、7-9月期の米企業決算において市場予想を上回る決算が相次いだことや、10月の米CPI上昇率が市場予想を下回ったことなどが好感されたこと

○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8期
	2022年12月7日～ 2023年12月6日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.042%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	14,081

（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、各国の金融政策や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。
- ・米国の持株会社などを全売却した一方、米国のヘルスケア関連テクノロジー会社などを新規に買い付けました。

[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マザーファンド]

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マザーファンド]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マザーファンド]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、よろしくお願いいたします。

<Aコース>

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年12月7日～2023年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 173	% 1.100	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(156)	(0.990)	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	0.026	(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)	(0.026)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	4	0.024	(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 ）	(4)	(0.024)	
(d) そ の 他 費 用	9	0.056	(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 ）	(8)	(0.052)	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	190	1.206	
期中の平均基準価額は、15,754円です。			

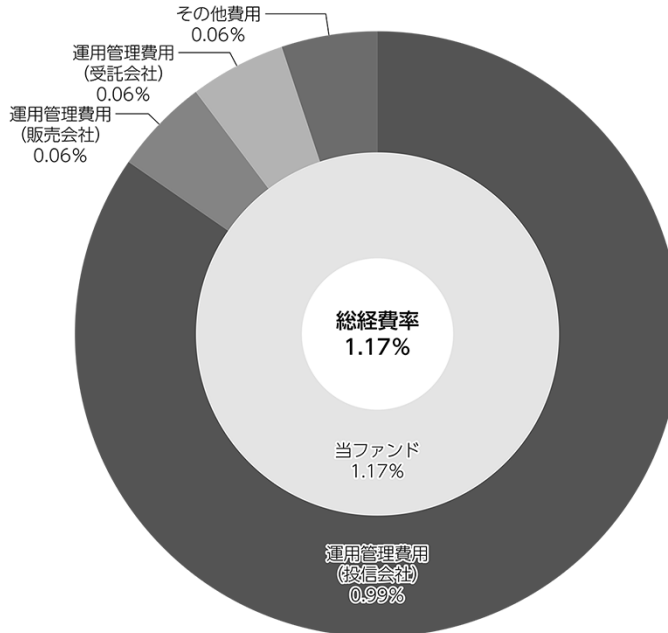
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<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1.17%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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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。

<Aコース>

○売買及び取引の状況

(2022年12月7日～2023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 452,329	千円 1,107,000	千口 718,842	千円 1,788,600

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年12月7日～2023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	12,469,493千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,435,098千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00	

* (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

(2022年12月7日～2023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

(2023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	評 価 額	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 1,452,297	千円 3,133,555	千口 1,185,785	千円 3,133,555

*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

(2023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	3,133,555	94.8
コール・ローン等、その他	172,225	5.2
投資信託財産総額	3,305,780	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(13,647,626千円)の投資信託財産総額(13,859,922千円)に対する比率は98.5%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=147.26円、1英ポンド=185.53円、1スイスフラン=168.34円、1デンマーククローネ=21.32円、1ユーロ=158.97円、1香港ドル=18.83円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年12月6日現在)

項目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,340,911,859
コール・ローン等	18,534,807
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)	3,133,555,832
未収入金	3,188,821,220
(B) 負債	3,113,598,479
未払金	3,035,327,571
未払収益分配金	2,065,678
未払解約金	58,316,537
未払信託報酬	17,835,238
未払利息	9
その他未払費用	53,446
(C) 純資産総額(A-B)	3,227,313,380
元本	2,065,678,766
次期繰越損益金	1,161,634,614
(D) 受益権総口数	2,065,678,766口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,624円

(注) 期首元本額は2,176,079,489円、期中追加設定元本額は547,974,363円、期中一部解約元本額は658,375,086円、1口当たり純資産額は1,5624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77,689,866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

(2022年12月7日～2023年12月6日)

項目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 12,063
受取利息	3
支払利息	△ 12,066
(B) 有価証券売買損益	79,778,110
売買益	818,230,128
売買損	△ 738,452,018
(C) 信託報酬等	△ 36,968,325
(D) 当期損益金(A+B+C)	42,797,722
(E) 前期繰越損益金	114,308,042
(F) 追加信託差損益金	1,006,594,528
(配当等相当額)	(662,826,334)
(売買損益相当額)	(343,768,194)
(G) 計(D+E+F)	1,163,700,292
(H) 収益分配金	△ 2,065,678
次期繰越損益金(G+H)	1,161,634,614
追加信託差損益金	1,006,594,528
(配当等相当額)	(663,913,302)
(売買損益相当額)	(342,681,226)
分配準備積立金	256,710,472
繰越損益金	△ 101,670,386

*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（2022年12月7日～2023年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年12月7日～ 2023年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	33,569,314円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	904,924,142円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	225,206,836円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,163,700,292円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	5,633円
g. 分配金	2,065,678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。

<Bコース>

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年12月7日～2023年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 250	% 1.100	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(225)	(0.990)	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 ）	(12)	(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 ）	(12)	(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	6	0.026	(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 ）	(6)	(0.026)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	5	0.024	(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 ）	(5)	(0.024)	
(d) そ の 他 費 用	10	0.042	(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 ）	(9)	(0.039)	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	271	1.192	
期中の平均基準価額は、22,698円です。			

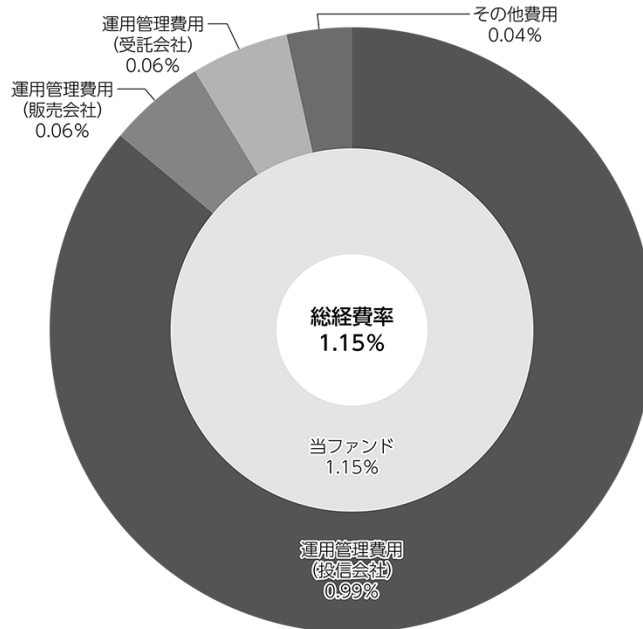
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<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1.15%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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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。

<Bコース>

○売買及び取引の状況

(2022年12月7日～2023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	1,648,084 千口	3,811,100 千円	734,679 千口	1,807,900 千円

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年12月7日～2023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	12,469,493千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,435,098千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00	

* (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

(2022年12月7日～2023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

(2023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	3,069,852 千口	3,983,257 千口	10,526,156 千円

*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

(2023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	10,526,156	98.3
コール・ローン等、その他	186,118	1.7
投資信託財産総額	10,712,274	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(13,647,626千円)の投資信託財産総額(13,859,922千円)に対する比率は98.5%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=147.26円、1英ポンド=185.53円、1スイスフラン=168.34円、1デンマーククローネ=21.32円、1ユーロ=158.97円、1香港ドル=18.83円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年12月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,712,274,716
コール・ローン等	106,617,921
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)	10,526,156,795
未収入金	79,500,000
(B) 負債	91,836,085
未払収益分配金	4,410,154
未払解約金	29,010,696
未払信託報酬	58,240,524
未払利息	52
その他未払費用	174,659
(C) 純資産総額(A-B)	10,620,438,631
元本	4,410,154,968
次期繰越損益金	6,210,283,663
(D) 受益権総口数	4,410,154,968口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,082円

(注) 期首元本額は3,356,099,641円、期中追加設定元本額は1,856,421,595円、期中一部解約元本額は802,366,268円、1口当たり純資産額は2,4082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77,689,866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

(2022年12月7日～2023年12月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 35,038
受取利息	10
支払利息	△ 35,048
(B) 有価証券売買損益	1,481,557,674
売買益	1,640,722,693
売買損	△ 159,165,019
(C) 信託報酬等	△ 107,244,619
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,374,278,017
(E) 前期繰越損益金	890,057,326
(F) 追加信託差損益金	3,950,358,474
(配当等相当額)	(2,221,378,031)
(売買損益相当額)	(1,728,980,443)
(G) 計(D+E+F)	6,214,693,817
(H) 収益分配金	△ 4,410,154
次期繰越損益金(G+H)	6,210,283,663
追加信託差損益金	3,950,358,474
(配当等相当額)	(2,226,978,908)
(売買損益相当額)	(1,723,379,566)
分配準備積立金	2,259,925,189

*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（2022年12月7日～2023年12月6日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年12月7日～ 2023年12月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	174,361,693円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,199,916,324円
c. 信託約款に定める収益調整金	3,950,358,474円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	890,057,326円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	6,214,693,817円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	14,091円
g. 分配金	4,410,154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。

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8期（決算日2023年12月6日）

作成対象期間（2022年12月7日～2023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	株先物比率	純資産額
		期騰	落中率			
4期(2019年12月6日)	円 14,537		% 9.3	% 96.8	% —	百万円 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
7期(2022年12月6日)	22,443		12.3	95.0	—	10,149
8期(2023年12月6日)	26,426		17.7	97.0	—	13,659

*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	株先物比率
		騰	落率		
(期首) 2022年12月6日	円 22,443		% —	% 95.0	% —
12月末	21,149		△ 5.8	94.5	—
2023年1月末	22,908		2.1	95.7	—
2月末	23,505		4.7	96.1	—
3月末	23,198		3.4	97.2	—
4月末	23,737		5.8	95.9	—
5月末	24,395		8.7	93.8	—
6月末	26,211		16.8	95.4	—
7月末	27,142		20.9	95.8	—
8月末	27,346		21.8	95.0	—
9月末	26,585		18.5	95.8	—
10月末	24,691		10.0	96.5	—
11月末	26,206		16.8	95.4	—
(期末) 2023年12月6日	26,426		17.7	97.0	—

*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22,443円から期末26,426円となりました。

- (上昇) 2023年1月、2022年12月の米雇用統計において賃金上昇率が前月から減速したこと、12月のISM非製造業景況感指数が市場予想に反して低下したことなどから、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締め長期化への警戒が和らいだこと
- (上昇) 6月、FRBの金融引き締め継続と日銀の大規模な金融緩和策の維持が示されたことなどから日米金利差の拡大期待が強まり、月末のドル・円レートは円安・ドル高となったこと
- (上昇) 7月、6月の米CPI（消費者物価指数）上昇率が市場予想を下回ったことでFOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利が据え置かれるとの期待感が高まったことや、米大手金融機関などの4-6月期決算が市場予想を上回ったこと
- (下落) 9月、FOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたものの、年内に追加利上げを行ない、高い金利水準の維持が示唆されたこと
- (下落) 10月、米下院議長選挙での選出遅れによる混乱や、大手IT企業の決算において先行き不透明感が強まったこと
- (上昇) 11月、7-9月期の米企業決算において市場予想を上回る決算が相次いだことや、10月の米CPI上昇率が市場予想を下回ったことなどが好感されたこと

○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。

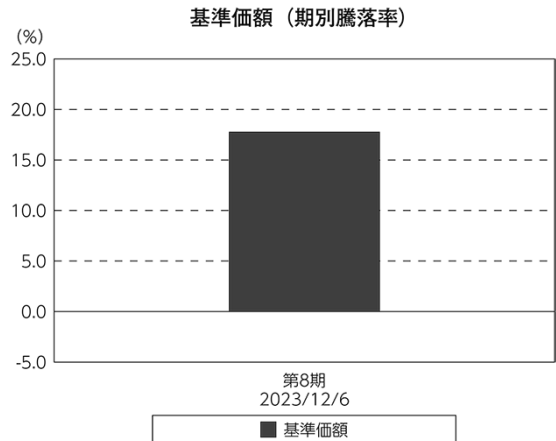
・期中の主な動き

- ・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。
- ・米国の持株会社などを全売却した一方、米国のヘルスケア関連テクノロジー会社などを新規に買い付けしました。

○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、よろしく願いいたします。

○1万口当たりの費用明細

(2022年12月7日～2023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)	6 (6)	0.026 (0.026)	(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)	6 (6)	0.024 (0.024)	(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)	10 (10) (0)	0.039 (0.039) (0.000)	(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	22	0.089	
期中の平均基準価額は、24,756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

(2022年12月7日～2023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 3,588 (25)	千米ドル 29,844 (-)	百株 2,087	千米ドル 25,095
	イギリス	1,947 (-)	千英ポンド 1,215 (△ 126)	314	千英ポンド 157
	スイス	254 (27)	千スイスフラン 2,151 (△ 67)	3,561	千スイスフラン 2,990
	デンマーク	73	千デンマーククローネ 7,869	42	千デンマーククローネ 5,777
国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,210	5,508	778	5,291
	イタリア	1,955	2,366	-	-
	フランス	814	5,984	206	1,304
	オランダ	65 (399)	339 (△ 5)	54	378
	香港	695	千香港ドル 6,439	910	千香港ドル 8,082

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 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。

○株式売買比率

(2022年12月7日～2023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	12,469,493千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,435,098千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00

*(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

(2022年12月7日～2023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

(2023年12月6日現在)

外国株式

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			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	—	123	1,578	232,382	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ALPHABET INC-CL A	429	263	3,450	508,087	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
AMAZON.COM INC	264	125	1,847	271,991	大規模小売り	
AMERICAN INTL GROUP	293	365	2,409	354,842	保険	
BANK OF AMERICA CORP	435	1,169	3,574	526,425	銀行	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	60	—	—	—	金融サービス	
BLACKROCK INC	27	41	3,137	462,085	資本市場	
BOOKING HOLDINGS INC	7	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16	351	4,052	596,833	消費者金融	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	60	89	3,277	482,685	メディア	
CISCO SYSTEMS	—	366	1,754	258,329	通信機器	
CITIGROUP	164	—	—	—	銀行	
CONOCOPHILLIPS	—	185	2,101	309,394	石油・ガス・消耗燃料	
DANAHER CORP	—	76	1,686	248,338	ライフサイエンス・ツール/サービス	
FISERV INC	271	269	3,514	517,615	金融サービス	
GENERAL MOTORS CO	405	479	1,568	230,973	自動車	
HCA HEALTHCARE INC	91	40	1,022	150,597	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	72	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	122	217	2,481	365,471	資本市場	
IQVIA HOLDINGS INC	—	151	3,239	477,018	ライフサイエンス・ツール/サービス	
KROGER CO	—	431	1,918	282,500	生活必需品流通・小売り	
PARKER HANNIFIN CORP	29	21	921	135,750	機械	
PHILLIPS 66	—	75	964	142,072	石油・ガス・消耗燃料	
SALESFORCE INC	186	68	1,718	253,026	ソフトウェア	
VISA INC-CLASS A SHARES	39	—	—	—	金融サービス	
WARNER BROS DISCOVERY INC	488	586	636	93,801	娯楽	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	504	—	—	—	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額	3,972	5,499	46,857	6,900,225	
	銘柄数<比率>	20	21	—	<50.5%>	
(イギリス)				千英ポンド		
GLENCORE PLC	2,166	2,917	1,278	237,284	金属・鉱業	
WPP PLC	1,234	2,116	1,520	282,165	メディア	
小計	株数・金額	3,400	5,033	2,799	519,449	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<3.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NOVARTIS AG-REG	96	98	835	140,612	医薬品	
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	—	35	892	150,180	医薬品	
HOLCIM LTD	285	157	1,016	171,052	建設資材	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,222	—	—	—	資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	351	385	1,751	294,929	資本市場	
小計	株数・金額	3,956	676	4,495	756,775	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<5.5%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
DSV A/S	42	73	7,973	169,991	航空貨物・物流サービス	
小計	株数・金額	42	73	7,973	169,991	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<1.2%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
FRESENIUS SE & CO KGAA	656	910	2,613	415,539	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	

銘柄	株数	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	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SAP SE	149	73	1,083	172,273		ソフトウェア
HENKEL AG & CO KGAA	125	—	—	—		家庭用品
BAYER AG-REG	373	706	2,241	356,307		医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	10	—	—	—		家庭用品
ALLIANZ SE-REG	105	83	1,987	315,967		保険
MERCEDES-BENZ GROUP AG	447	524	3,223	512,495		自動車
BAYER MOTOREN WERK	64	64	633	100,679		自動車
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	589	591	1,854	294,757		機械
小 計	株数・金額	2,522	2,955	13,637	2,168,021	
	銘柄数<比率>	9	7	—	<15.9%>	
(ユーロ…イタリア)						
CNH INDUSTRIAL NV	1,415	3,370	3,395	539,802		機械
小 計	株数・金額	1,415	3,370	3,395	539,802	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<4.0%>	
(ユーロ…フランス)						
CAPGEMINI SA	—	99	1,872	297,677		情報技術サービス
KERING SA	26	58	2,331	370,687		繊維・アパレル・贅沢品
BNP PARIBAS	563	606	3,626	576,557		銀行
DANONE	167	205	1,202	191,129		食品
WORLDLINE SA	466	862	1,303	207,192		金融サービス
小 計	株数・金額	1,223	1,831	10,336	1,643,245	
	銘柄数<比率>	4	5	—	<12.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
PROSUS NV	358	768	2,301	365,875		大規模小売り
小 計	株数・金額	358	768	2,301	365,875	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.7%>	
ユ ー ロ 計	株数・金額	5,519	8,925	29,671	4,716,944	
	銘柄数<比率>	15	14	—	<34.5%>	
(香港)				千香港ドル		
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,592	1,377	9,710	182,851		大規模小売り
小 計	株数・金額	1,592	1,377	9,710	182,851	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<1.3%>	
合 計	株数・金額	18,482	21,586	—	13,246,238	
	銘柄数<比率>	43	43	—	<97.0%>	

*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

(2023年12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 13,246,238	% 95.6
コール・ローン等、その他	613,684	4.4
投資信託財産総額	13,859,922	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(13,647,626千円)の投資信託財産総額(13,859,922千円)に対する比率は98.5%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=147.26円、1英ポンド=185.53円、1スイスフラン=168.34円、1デンマーククローネ=21.32円、1ユーロ=158.97円、1香港ドル=18.83円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年12月6日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	13,933,473,094 円
コール・ローン等	591,416,726
株式(評価額)	13,246,238,246
未収入金	90,962,972
未収配当金	4,855,150
(B) 負債	273,872,612
未払金	116,172,529
未払解約金	157,700,000
未払利息	83
(C) 純資産総額(A-B)	13,659,600,482
元本	5,169,042,847
次期繰越損益金	8,490,557,635
(D) 受益権総口数	5,169,042,847口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,426円

(注) 期首元本額は4,522,150,617円、期中追加設定元本額は2,100,414,135円、期中一部解約元本額は1,453,521,905円、1口当たり純資産額は2,6426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) 3,983,257,699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) 1,185,785,148円

○損益の状況 (2022年12月7日~2023年12月6日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	262,037,333 円
受取配当金	245,193,979
受取利息	16,894,439
その他収益金	32,350
支払利息	△ 83,435
(B) 有価証券売買損益	1,931,976,341
売買益	3,150,569,542
売買損	△1,218,593,201
(C) 保管費用等	△ 5,100,615
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,188,913,059
(E) 前期繰越損益金	5,626,936,806
(F) 追加信託差損益金	2,817,685,865
(G) 解約差損益金	△2,142,978,095
(H) 計(D+E+F+G)	8,490,557,635
次期繰越損益金(H)	8,490,557,635

*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。