

野村北米REIT投信（メキシコペソコース） 毎月分配型

運用報告書(全体版)

第82期（決算日2021年4月15日） 第83期（決算日2021年5月17日） 第84期（決算日2021年6月15日）
第85期（決算日2021年7月15日） 第86期（決算日2021年8月16日） 第87期（決算日2021年9月15日）

作成対象期間（2021年3月16日～2021年9月15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／海外／不動産投信	
信託期間	2014年6月9日から2024年9月17日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・ファンド・シリーズ・ノース・アメリカン・リート・ファンド クラスMXN受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーマーケット マザーファンド受益証券への投資を通じて、米国およびカナダの金融商品取引所に上場されているREIT（不動産投資信託証券）を現実的な主要投資対象とし、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うことを基本とします。各受益証券への投資比率は、通常の状態においては、ノムラ・ファンド・シリーズ・ノース・アメリカン・リート・ファンド クラスMXN受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村北米REIT投信（メキシコペソコース）毎月分配型	ノムラ・ファンド・シリーズ・ノース・アメリカン・リート・ファンド クラスMXN受益証券および野村マネーマーケット マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・ファンド・シリーズ・ノース・アメリカン・リート・ファンド クラスMXN	米国およびカナダの金融商品取引所に上場されているREITを主要投資対象とします。
	野村マネーマーケットマザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村北米REIT投信（メキシコペソコース）毎月分配型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への直接投資は行いません。
	野村マネーマーケットマザーファンド	株式への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として、配当等収益等を中心に分配を行うことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合があります。なお、毎年3月および9月の決算時には、分配相当額に委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。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/>

○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 証 組 入 比	資 信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落 中 率							
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	百万円	
58期(2019年4月15日)	10,025	30	4.9	0.0	—	95.0	83				
59期(2019年5月15日)	9,648	30	△3.5	0.0	—	98.2	158				
60期(2019年6月17日)	9,689	30	0.7	0.0	—	99.0	175				
61期(2019年7月16日)	9,777	30	1.2	0.0	—	99.0	179				
62期(2019年8月15日)	9,159	30	△6.0	0.0	—	99.0	189				
63期(2019年9月17日)	9,739	30	6.7	0.0	—	93.3	227				
64期(2019年10月15日)	10,021	30	3.2	0.0	—	96.1	260				
65期(2019年11月15日)	9,947	30	△0.4	0.0	—	99.0	265				
66期(2019年12月16日)	9,934	30	0.2	0.0	—	99.0	289				
67期(2020年1月15日)	10,407	30	5.1	0.0	—	98.6	308				
68期(2020年2月17日)	11,166	30	7.6	0.0	—	99.0	342				
69期(2020年3月16日)	7,434	30	△33.2	0.0	—	98.9	228				
70期(2020年4月15日)	6,577	30	△11.1	0.0	—	99.0	202				
71期(2020年5月15日)	5,691	30	△13.0	0.0	—	99.0	184				
72期(2020年6月15日)	7,144	30	26.1	0.0	—	97.8	231				
73期(2020年7月15日)	6,833	30	△3.9	0.0	—	99.0	239				
74期(2020年8月17日)	7,284	30	7.0	0.0	—	99.0	255				
75期(2020年9月15日)	7,590	30	4.6	0.0	—	99.0	337				
76期(2020年10月15日)	7,328	30	△3.1	0.0	—	99.0	326				
77期(2020年11月16日)	8,012	30	9.7	0.0	—	99.1	356				
78期(2020年12月15日)	7,879	30	△1.3	0.0	—	99.0	275				
79期(2021年1月15日)	8,174	30	4.1	0.0	—	99.0	285				
80期(2021年2月15日)	8,623	30	5.9	0.0	—	99.0	301				
81期(2021年3月15日)	8,865	30	3.2	0.0	—	97.5	295				
82期(2021年4月15日)	9,349	30	5.8	0.0	—	98.7	304				
83期(2021年5月17日)	9,775	30	4.9	0.0	—	98.8	315				
84期(2021年6月15日)	10,592	30	8.7	0.0	—	95.3	330				
85期(2021年7月15日)	10,692	30	1.2	0.0	—	98.7	308				
86期(2021年8月16日)	10,741	30	0.7	0.0	—	98.7	310				
87期(2021年9月15日)	10,743	30	0.3	0.0	—	98.7	308				

*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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第82期	(期 首) 2021年 3月15日	円 8,865	% —	% 0.0	% —	% 97.5	
	3月末	9,114	2.8	0.0	—	98.8	
	(期 末) 2021年 4月15日	9,379	5.8	0.0	—	98.7	
第83期	(期 首) 2021年 4月15日	9,349	—	0.0	—	98.7	
	4月末	9,736	4.1	0.0	—	98.8	
	(期 末) 2021年 5月17日	9,805	4.9	0.0	—	98.8	
第84期	(期 首) 2021年 5月17日	9,775	—	0.0	—	98.8	
	5月末	9,996	2.3	0.0	—	98.8	
	(期 末) 2021年 6月15日	10,622	8.7	0.0	—	95.3	
第85期	(期 首) 2021年 6月15日	10,592	—	0.0	—	95.3	
	6月末	10,466	△1.2	0.0	—	98.8	
	(期 末) 2021年 7月15日	10,722	1.2	0.0	—	98.7	
第86期	(期 首) 2021年 7月15日	10,692	—	0.0	—	98.7	
	7月末	10,762	0.7	0.0	—	98.7	
	(期 末) 2021年 8月16日	10,771	0.7	0.0	—	98.7	
第87期	(期 首) 2021年 8月16日	10,741	—	0.0	—	98.7	
	8月末	10,783	0.4	0.0	—	98.8	
	(期 末) 2021年 9月15日	10,773	0.3	0.0	—	98.7	

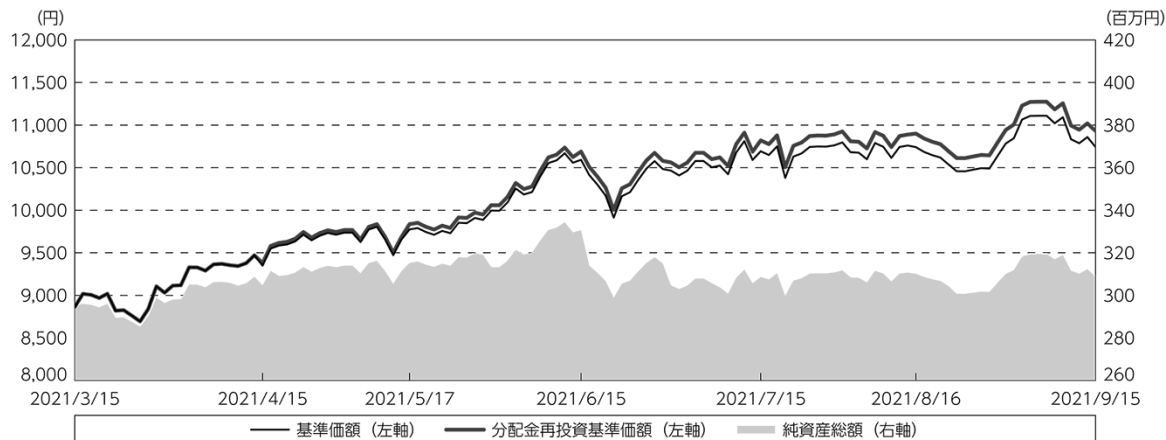
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第82期首：8,865円

第87期末：10,743円 (既払分配金(税込み)：180円)

騰落率：23.3% (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(2021年3月15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。

○基準価額の変動要因

実質的に投資している北米REITからのインカムゲイン(配当収入)

実質的に投資している北米REITからのキャピタルゲイン(またはロス)(価格変動損益)

為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)またはプレミアム(金利差相当分の収益)

円/メキシコペソの為替変動

○投資環境

北米REIT市場は、当作成期間当初は、新型コロナウイルスの感染再拡大で景気減速が懸念される場面もあったものの、米政権が全成人を新型コロナウイルスワクチンの接種対象とするよう州政府に要請すると報道されたことを背景として、景気回復に弾みがつくとの期待が広がり、上昇に転じました。5月は、4月の米CPI(消費者物価指数)が前年同月比+4.2%と発表され、2008年9月以来の大幅な上昇を記録したことから、インフレ加速を警戒するリスク回避姿勢が強まり、売りが優勢となる場面こそあったものの、米新規失業保険申請件数の改善など

経済指標が景気回復傾向を示す中で、若干上昇しました。6月は、早期利上げやテーパリング（量的金融緩和の縮小）に関する議論が開始されたことを受けて先行き不透明感から下落する場面もありましたが、急激な物価上昇は一時的であるとの見方や、堅調な経済指標の発表や経済活動の再開に対する期待感の高まりに支えられ、上昇しました。7月は、インフレ加速懸念を背景とした早期利上げの可能性や、新型コロナウイルス変異株の感染拡大による経済活動への影響に対する懸念などから、下落する場面も見られましたが、経済活動の再開を背景とした好調な企業決算などを受けて株式市場が堅調となる中で、上昇しました。8月は、新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気先行き不透明感や、テーパリングの開始時期に対する警戒感が広がる中で、軟調に推移する場面もあったものの、利上げは急がないとの見方が広がったことや、好調な企業決算や経済指標などを背景に上昇しました。このような環境下、9月に入ってから、テーパリングの開始時期に対する警戒を背景に変動する場面も見られましたが、当作成期間を通じ堅調に推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村北米REIT投信（メキシコペソコース）毎月分配型]

[ノムラ・ファンド・シリーズ・ノー・アメリカン・リート・ファンドー クラスMXN] および [野村マネーマーケット マザーファンド] の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・ファンド・シリーズ・ノー・アメリカン・リート・ファンドー クラスMXN] の受益証券への投資比率を概ね95%以上に維持しました。

[ノムラ・ファンド・シリーズ・ノー・アメリカン・リート・ファンドー クラスMXN]

・当作成期中の主な動き

- (1) REITへの投資にあたっては、価格水準が相対的に割安で、長期的に高い収益成長が期待できる銘柄を選別し投資しました。
- (2) セクター別配分では、2021年8月末時点で、賃貸住宅、物流施設、スペシャリティなどが組入上位となりました。

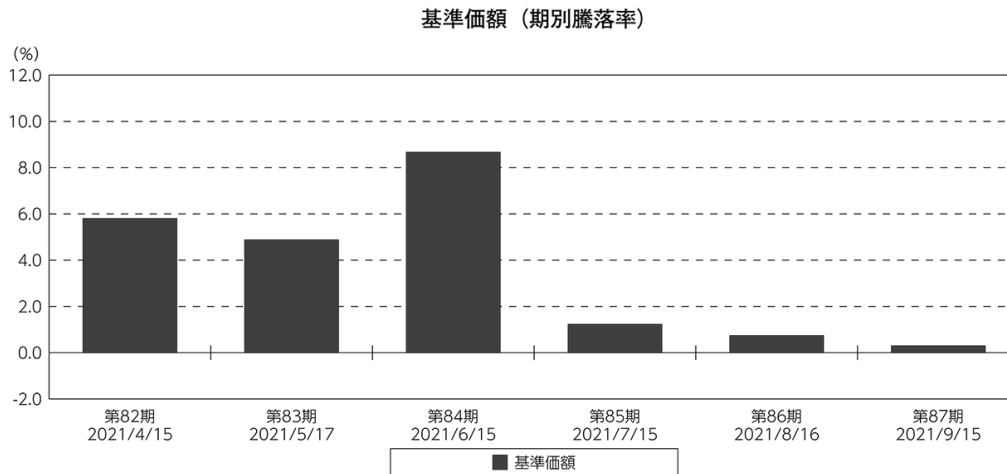
[野村マネーマーケット マザーファンド]

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、作成期間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

収益分配金については、各期毎の利息・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案して決定しました。

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せん。

◎分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第82期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
	2021年3月16日～ 2021年4月15日	2021年4月16日～ 2021年5月17日	2021年5月18日～ 2021年6月15日	2021年6月16日～ 2021年7月15日	2021年7月16日～ 2021年8月16日	2021年8月17日～ 2021年9月15日
当期分配金	30	30	30	30	30	30
(対基準価額比率)	0.320%	0.306%	0.282%	0.280%	0.279%	0.278%
当期の収益	5	9	30	30	30	30
当期の収益以外	24	20	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	4,912	4,892	5,709	5,809	5,858	5,860

(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四捨五入して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

【野村北米REIT投信（メキシコペソコース）毎月分配型】

〔ノムラ・ファンド・シリーズ・ノー・アメリカン・リート・ファンドー クラスMXN〕 受益証券および〔野村マネーマーケット マザーファンド〕 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・ファンド・シリーズ・ノー・アメリカン・リート・ファンドー クラスMXN〕 受益証券への投資比率を概ね95%以上に維持します。

【ノムラ・ファンド・シリーズ・ノー・アメリカン・リート・ファンドー クラスMXN】

米国経済は、2021年第2四半期の米国GDP成長率が年率プラス6.6%（改定値、前期比）となりました。一方で、デルタ株の感染拡大を受けて、雇用市場は2021年8月の非農業部門雇用者数が前月比23万5,000人の増加となり、市場予想を大きく下回りました。米国経済は、変異株の蔓延やワクチン接種率の伸び悩みなどが景気回復に及ぼす影響について留意する必要があるものの、新型コロナウイルスとの共存を見据えた経済活動の再開に伴い、回復に向かっていると考えられます。

不動産市場では、経済活動の再開による恩恵が徐々に表れ始めています。ホテル/リゾート施設や商業施設等では、郊外のリゾート施設の一部や、ショッピング・センター等、運営環境が好転する施設も見られます。オフィスは、在宅勤務の浸透による構造的な影響は依然として

不透明ですが、オフィスの必要性が再認識され、ソーシャル・ディスタンスの確保を背景に労働者一人当たりの必要面積が拡大する可能性も指摘されています。また、賃貸住宅は、居住という人々の生活における重要なニーズを満たす物件タイプであるため、特に郊外の市場ではファンダメンタルズ（基礎的条件）に対する影響は限定的であり、また都市部の物件においても環境は改善しつつあります。物流施設も、インターネット小売業に伴う需要は底堅く、特に消費地に近接した物件は力強さを保つと想定されます。このような環境下、特に、コロナ後の人々の生活嗜好や人口動態などから恩恵を受ける銘柄や、コロナ後を見据えた新たな投資運用戦略を執行できるだけの財務的な体力を有する銘柄は、相対的に高い収益成長を示す可能性があります。

当ファンドでは、今後も引き続き、長期的に高い収益成長の可能性を有しつつも、証券市場で割安に取引されている銘柄を発掘し、投資していく予定です。銘柄選択にあたっては、REITが保有する不動産の不動産市場における評価額を基準に、人口動態や保有物件の地域分析なども考慮しつつ、強い財務基盤を持ち、キャッシュフロー（現金収支）の伸びが期待でき、質の高い経営陣を擁するREITを選別していきます。新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済や不動産市場への影響を十分に注視しつつ、ポートフォリオへのそのような影響を最小限に抑えるよう配慮しながら運用を行なう方針です。

また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、米ドル及びカナダドル建て資産について原則として米ドルを売り、メキシコペソを買う為替取引を行ないます。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

【野村マネーマーケット マザーファンド】

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

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。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響を受け、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年3月16日～2021年9月15日)

項 目	第82期～第87期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 49	% 0.488	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(20)	(0.194)	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 ）	(28)	(0.277)	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 ）	(2)	(0.017)	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) そ の 他 費 用	0	0.002	(b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	49	0.490	
作成期間の平均基準価額は、10,142円です。			

*作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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。

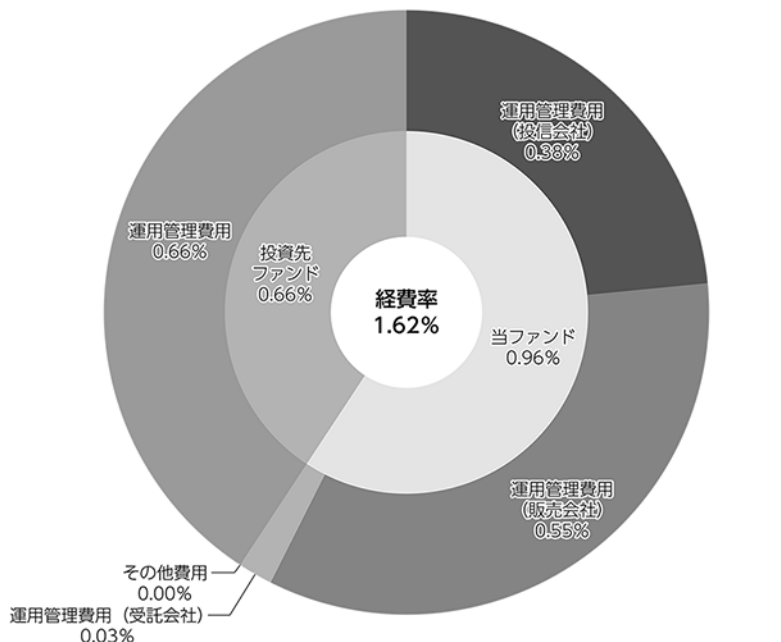
*各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.62%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	1.62
①当ファンドの費用の比率	0.96
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.66

(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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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。

○売買及び取引の状況

(2021年3月16日～2021年9月15日)

投資信託証券

銘		柄		第82期～第87期							
				買		付		売		付	
				口	数	金	額	口	数	金	額
国内		口	数	金	額	口	数	金	額		
	ノムラ・ファンド・シリーズ・ノース・アメリカン・リート・ファンド・クラスM	—	—	—	—	5,595	—	—	—		

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月16日～2021年9月15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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2021年3月16日～2021年9月15日)

第82期首残高 (元本)	設定元本	解約元本	第87期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2021年9月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘		柄		第81期末		第87期末	
				口	数	口	数
		口	数	口	数	千円	%
	ノムラ・ファンド・シリーズ・ノース・アメリカン・リート・ファンド・クラスM	38,585	—	32,990	—	304,860	98.7
	合 計	38,585	—	32,990	—	304,860	98.7

*比率は、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。

親投資信託残高

銘 柄	第81期末	第87期末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネーマーケット マザーファンド	千口 9	千口 9	千円 9

*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

(2021年9月15日現在)

項 目	第87期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 304,860	% 98.3
野村マネーマーケット マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	5,156	1.7
投資信託財産総額	310,025	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第82期末	第83期末	第84期末	第85期末	第86期末	第87期末
	2021年4月15日現在	2021年5月17日現在	2021年6月15日現在	2021年7月15日現在	2021年8月16日現在	2021年9月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	305,981,763	316,446,743	333,129,810	309,717,707	311,269,079	310,025,356
コール・ローン等	5,074,395	5,104,464	6,657,960	4,989,256	5,076,238	5,154,776
投資信託受益証券(評価額)	300,897,376	311,332,288	315,195,759	304,718,460	306,182,851	304,860,590
野村マネーマーケットマザーファンド(評価額)	9,992	9,991	9,991	9,991	9,990	9,990
未収入金	—	—	11,266,100	—	—	—
(B) 負債	1,224,186	1,232,981	2,495,670	1,112,037	1,129,327	1,109,905
未払収益分配金	977,887	967,437	936,472	865,863	866,242	862,662
未払解約金	—	—	1,311,929	—	—	—
未払信託報酬	245,476	264,647	246,438	245,345	262,195	246,411
未払利息	1	3	3	4	4	3
その他未払費用	822	894	828	825	886	829
(C) 純資産総額(A-B)	304,757,577	315,213,762	330,634,140	308,605,670	310,139,752	308,915,451
元本	325,962,480	322,479,071	312,157,346	288,621,210	288,747,585	287,554,303
次期繰越損益金	△ 21,204,903	△ 7,265,309	18,476,794	19,984,460	21,392,167	21,361,148
(D) 受益権総口数	325,962,480口	322,479,071口	312,157,346口	288,621,210口	288,747,585口	287,554,303口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,349円	9,775円	10,592円	10,692円	10,741円	10,743円

(注) 第82期首元本額は333,217,217円、第82～87期中追加設定元本額は1,072,148円、第82～87期中一部解約元本額は46,735,062円、1口当たり純資産額は、第82期0.9349円、第83期0.9775円、第84期1.0592円、第85期1.0692円、第86期1.0741円、第87期1.0743円です。

○損益の状況

項 目	第82期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
	2021年3月16日～ 2021年4月15日	2021年4月16日～ 2021年5月17日	2021年5月18日～ 2021年6月15日	2021年6月16日～ 2021年7月15日	2021年7月16日～ 2021年8月16日	2021年8月17日～ 2021年9月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	191,443	188,110	181,794	168,489	166,595	165,461
受取配当金	191,505	188,180	181,891	168,655	166,695	165,540
支払利息	△ 62	△ 70	△ 97	△ 166	△ 100	△ 79
(B) 有価証券売買損益	16,817,970	14,749,400	26,485,811	3,773,331	2,361,690	997,737
売買益	16,886,584	14,820,964	26,694,179	3,950,918	2,361,691	1,026,116
売買損	△ 68,614	△ 71,564	△ 208,368	△ 177,587	△ 1	△ 28,379
(C) 信託報酬等	△ 246,298	△ 265,541	△ 247,266	△ 246,170	△ 263,081	△ 247,240
(D) 当期損益金(A+B+C)	16,763,115	14,671,969	26,420,339	3,695,650	2,265,204	915,958
(E) 前期繰越損益金	△ 1,138,660	14,488,868	27,300,370	48,847,269	51,677,056	52,837,695
(F) 追加信託差損益金	△ 35,851,471	△ 35,458,709	△ 34,307,443	△ 31,692,596	△ 31,683,851	△ 31,529,843
(配当等相当額)	(130,952,454)	(129,572,249)	(125,441,294)	(116,011,810)	(116,085,234)	(115,628,569)
(売買損益相当額)	(△166,803,925)	(△165,030,958)	(△159,748,737)	(△147,704,406)	(△147,769,085)	(△147,158,412)
(G) 計(D+E+F)	△ 20,227,016	△ 6,297,872	19,413,266	20,850,323	22,258,409	22,223,810
(H) 収益分配金	△ 977,887	△ 967,437	△ 936,472	△ 865,863	△ 866,242	△ 862,662
次期繰越損益金(G+H)	△ 21,204,903	△ 7,265,309	18,476,794	19,984,460	21,392,167	21,361,148
追加信託差損益金	△ 35,851,471	△ 35,458,709	△ 34,307,443	△ 31,692,596	△ 31,683,851	△ 31,529,843
(配当等相当額)	(130,952,454)	(129,572,249)	(125,441,294)	(116,011,810)	(116,085,234)	(115,628,569)
(売買損益相当額)	(△166,803,925)	(△165,030,958)	(△159,748,737)	(△147,704,406)	(△147,769,085)	(△147,158,412)
分配準備積立金	29,189,039	28,193,400	52,784,237	51,677,056	53,076,018	52,890,991
繰越損益金	△ 14,542,471	-	-	-	-	-

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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(2021年3月16日～2021年9月15日)は以下の通りです。

項 目	第82期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
	2021年3月16日～ 2021年4月15日	2021年4月16日～ 2021年5月17日	2021年5月18日～ 2021年6月15日	2021年6月16日～ 2021年7月15日	2021年7月16日～ 2021年8月16日	2021年8月17日～ 2021年9月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	188,661円	184,766円	180,114円	157,979円	149,260円	130,305円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	0円	109,717円	26,240,225円	3,537,671円	2,115,944円	785,653円
c. 信託約款に定める収益調整金	130,952,454円	129,572,249円	125,441,294円	116,011,810円	116,085,234円	115,628,569円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	29,978,265円	28,866,354円	27,300,370円	48,847,269円	51,677,056円	52,837,695円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	161,119,380円	158,733,086円	179,162,003円	168,554,729円	170,027,494円	169,382,222円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,942円	4,922円	5,739円	5,839円	5,888円	5,890円
g. 分配金	977,887円	967,437円	936,472円	865,863円	866,242円	862,662円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円	30円	30円	30円

○分配金のお知らせ

	第82期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
1万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円	30円	30円	30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。

ノムラ・ファンド・シリーズーノース・アメリカン・リート・ファンド
(クラスJPY/クラスAUD/クラスBRL/クラスZAR/クラスUSD/クラスMXN)

2020年10月31日決算

■当ファンドの仕組み

主 要 投 資 対 象	米国およびカナダの金融商品取引所に上場されているREIT
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
副 投 資 顧 問 会 社	ハイトマン・リアル・エステイト・セキュリティーズ・エルエルシー
管 理 事 務 代 行 会 社	ステート・ストリート・ケイマン・トラスト・カンパニー・リミテッド
保 管 銀 行	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー

*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

貸借対照表

資産	USD
流動資産	
現金及び現金等価物	2,604,208
証券約定による金融資産	40,854,931
証拠金勘定未収分	1,420,000
ブローカー未収分	161,594
未収配当金	30,476
未収発行済ユニット	8,788
資産合計	45,079,997
負債	
流動負債	
証券約定による金融負債	3,195,010
ブローカー未払分	366,608
未払発行済ユニット	92,147
未払事務代行及びカストディー費用	37,470
未払投資顧問料	20,587
未払監査費用	13,147
源泉税	8,974
未払トランスファーエージェント費用	1,079
未払トラスティー費用	775
負債合計	3,735,797
純資産合計	41,344,200
内訳:	
純資産の増減合計	41,344,200
一口あたり純資産価格	
Class JPY (\$13,070,942/199,554 Units)	65.50
Class AUD (\$5,149,986/105,973 Units)	48.60
Class BRL (\$14,757,458/778,353 Units)	18.96
Class ZAR (\$149,953/4,098 Units)	36.59
Class USD (\$4,067,681/41,899 Units)	97.08
Class MXN (\$4,148,180/75,415 Units)	55.00

損益計算書

	USD
収益	
配当所得	1,699,449
受取利息	20,503
証券約定による金融資産及び負債に係る実現純損益	(9,042,051)
為替約定実現純損益	(13,283)
有価証券及び負債に係る未実現評価損益	(10,897,653)
外為約定に係る未実現評価利益	7,862
収益合計	(18,225,173)
費用	
投資顧問料	289,979
事務代行及びカストディー費用	256,647
証券取引費用	151,467
監査費用	44,789
トラスティー費用	10,647
トランスファーエージェント費用	5,999
費用合計	759,528
投資純損益	(18,984,701)
財務費用	
分配金額	4,389,707
分配金控除後税引前損益	(23,374,408)
源泉税	(420,140)
分配金控除後税引後損益	(23,794,548)
運用の結果による純資産の増減額	(23,794,548)

純資産額変動計算書

	USD
期首純資産	73,512,079
追加信託設定額	6,593,316
解約金額	(14,966,647)
運用の結果による純資産の増減額	(23,794,548)
期末純資産	41,344,200

キャッシュフロー計算書

	USD
営業活動によるキャッシュフロー	
金融資産及び負債の購入並びに金融負債の決済	(101,847,847)
売買目的金融資産の購入	116,504,617
外国為替取引料	(5,193,633)
受取配当金	1,680,706
受入利息	20,503
証拠金勘定未収分	(1,420,000)
証拠金勘定未払分	(1,810,000)
支払済営業費用	(775,739)
支払済源泉税	(414,465)
営業活動による純現金収入(ネット・キャッシュ)	<u>6,744,142</u>
財務活動によるキャッシュフロー	
ユニット発行による収益	6,747,368
ユニット解約の支払	(15,137,130)
ユニットホルダーへの分配金	(4,389,707)
財務活動による純現金収入(ネット・キャッシュ)	<u>(12,779,469)</u>
現金または現金同等(相当)物の純増減	(6,035,327)
期首における現金または現金同等(相当)物	<u>8,639,535</u>
期末における現金または現金同等(相当)物	<u><u>2,604,208</u></u>

組入資産の明細

銘柄	株数	取得原価 (\$)	公正価値 (\$)	純資産合計に 占める割合 (%)
証券約定による金融資産				
株式				
Agree Realty Corp	16,765	1,137,806	1,040,604	2.52
Alexandria Real Estate Equities Inc	3,476	528,992	526,684	1.27
American Assets Trust Inc	22,622	843,233	473,478	1.15
Apple Hospitality REIT Inc	67,438	716,891	667,636	1.61
Boston Properties Inc	13,584	1,387,234	983,617	2.38
CyrusOne Inc	17,183	1,337,263	1,220,852	2.95
DiamondRock Hospitality Co	140,359	785,101	693,373	1.68
Digital Realty Trust Inc	90	13,861	12,987	0.03
Dream Office Real Estate Investment Trust	20,833	345,972	273,494	0.66
Duke Realty Corp	61,568	2,140,328	2,338,968	5.66
Equinix Inc	4,332	3,212,601	3,167,732	7.66
Equity Residential	30,590	1,694,472	1,437,118	3.48
Essential Properties Realty Trust Inc	25,428	393,189	420,071	1.02
Extra Space Storage Inc	5,844	629,557	677,612	1.64
First Industrial Realty Trust Inc	29,392	1,182,921	1,170,096	2.83
Gaming and Leisure Properties Inc	7,213	261,471	261,471	0.63
Healthpeak Properties Inc	71,784	2,090,409	1,936,014	4.68
Highwoods Properties Inc	35,735	1,410,687	1,063,831	2.57
Invitation Homes Inc	62,383	1,592,000	1,700,561	4.11
Life Storage Inc	14,480	1,394,542	1,652,892	4.00
Mid-America Apartment Communities Inc	12,594	1,464,506	1,468,838	3.55
Minto Apartment Real Estate Investment Trust	19,070	325,263	233,478	0.57
New Senior Investment Group Inc	35,924	236,022	140,463	0.34
Physicians Realty Trust	62,278	1,092,691	1,050,007	2.54
Piedmont Office Realty Trust Inc	75,868	1,217,845	866,412	2.10
Prologis Inc	26,949	2,420,044	2,673,341	6.47
QTS Realty Trust Inc	20,317	1,316,672	1,249,699	3.02
Realty Income Corp	28,741	1,551,161	1,662,954	4.02
Rexford Industrial Realty Inc	14,234	655,466	661,312	1.60
Site Centers Corp	89,856	655,090	611,919	1.48
Summit Industrial Income REIT	45,504	354,018	459,543	1.11
Sun Communities Inc	10,070	1,429,607	1,385,934	3.35
UDR Inc	56,588	2,242,660	1,767,809	4.28
Vici Properties Inc	48,830	1,084,783	1,120,649	2.71
Weingarten Realty Investors	35,586	810,350	564,394	1.37
Welltower Inc	33,928	1,719,709	1,824,309	4.41
為替予約取引に係る未実現評価益			1,394,779	3.37
証券約定による金融資産合計		41,674,417	40,854,931	98.82

	取得原価 (\$)	公正価値 (\$)	純資産合計に 占める割合 (%)
証券約定による金融負債			
為替予約取引に係る未実現評価損		(3,195,010)	(7.73)
証券約定による金融負債合計		(3,195,010)	(7.73)
ポートフォリオ価額合計	41,674,417	37,659,921	91.09
その他の資産(負債控除後)		3,684,279	8.91
純資産合計		41,344,200	100.00

為替予約取引

(2020年10月31日現在)

Class JPY:

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)
2020年12月2日	JPY 1,425,433,673	13,625,365	USD 13,489,138	13,489,138	136,227
2020年12月2日	JPY 36,795,706	356,340	CAD 459,100	348,857	7,483
2020年11月4日	JPY 75,829,394	724,596	USD 720,421	720,421	4,175
2020年11月4日	JPY 36,114,614	348,405	CAD 456,607	345,644	2,761
2020年12月2日	USD 707,965	707,965	JPY 73,830,215	705,724	2,241
2020年11月4日	JPY 19,266,782	184,107	USD 182,667	182,667	1,440
2020年11月4日	JPY 2,925,000	27,950	USD 27,603	27,603	347
2020年12月2日	CAD 23,076	17,403	JPY 1,797,940	17,286	117
2020年11月4日	JPY 494,020	4,798	CAD 6,144	4,684	114
2020年12月2日	USD 19,557	19,557	JPY 2,041,358	19,513	44
2020年11月4日	JPY 497,706	4,805	CAD 6,287	4,763	42
2020年12月2日	USD 23,265	23,265	JPY 2,430,188	23,229	36
2020年12月2日	USD 11,185	11,185	JPY 1,166,490	11,150	35
2020年11月4日	JPY 292,500	2,795	USD 2,776	2,776	19
2020年11月4日	JPY 292,500	2,795	USD 2,778	2,778	17
2020年11月4日	JPY 195,000	1,863	USD 1,847	1,847	16
2020年11月4日	JPY 75,000	724	CAD 934	708	16
2020年11月4日	JPY 7,500	72	CAD 95	71	1
2020年11月4日	JPY 7,500	71	CAD 95	71	-
2020年11月4日	JPY 5,000	47	CAD 63	47	-
2020年11月4日	CAD 32	24	JPY 2,492	24	-
2020年12月2日	CAD 382	287	JPY 29,910	287	-
2020年12月2日	CAD 604	452	JPY 47,357	452	-
					155,131

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)
2020年11月4日	CAD	126	JPY	9,969	94 (1)
2020年11月4日	CAD	94	JPY	7,477	71 (1)
2020年11月4日	CAD	63	JPY	4,985	47 (1)
2020年11月4日	CAD	94	JPY	7,477	71 (1)
2020年11月4日	CAD	62	JPY	4,985	47 (1)
2020年11月4日	CAD	312	JPY	24,925	235 (4)
2020年12月2日	CAD	659	JPY	52,342	501 (6)
2020年11月4日	CAD	2,309	JPY	181,952	1,724 (7)
2020年11月4日	USD	921	JPY	97,208	928 (7)
2020年12月2日	CAD	783	JPY	62,312	596 (9)
2020年12月2日	USD	17,645	JPY	1,846,943	17,654 (9)
2020年11月4日	USD	1,840	JPY	194,415	1,858 (18)
2020年11月4日	USD	1,840	JPY	194,415	1,858 (18)
2020年11月4日	CAD	1,889	JPY	150,345	1,423 (20)
2020年11月4日	USD	2,765	JPY	291,623	2,787 (22)
2020年11月4日	USD	2,761	JPY	291,623	2,787 (26)
2020年11月4日	USD	3,681	JPY	388,831	3,716 (35)
2020年11月4日	USD	9,175	JPY	972,075	9,289 (114)
2020年12月2日	CAD	6,145	JPY	494,020	4,685 (115)
2020年11月4日	JPY	19,410,539	USD	185,849	185,849 (368)
2020年11月4日	USD	55,481	JPY	5,863,485	56,030 (549)
2020年11月4日	USD	67,230	JPY	7,096,148	67,808 (578)
2020年12月2日	USD	182,720	JPY	19,266,782	184,167 (1,447)
2020年11月4日	CAD	459,100	JPY	36,802,016	350,017 (7,460)
2020年11月4日	USD	1,216,888	JPY	128,246,954	1,225,485 (8,597)
2020年11月4日	JPY	1,451,214,178	USD	13,910,445	13,910,445 (43,134)
2020年11月4日	USD	13,489,138	JPY	1,425,793,833	13,624,403 (135,265)
					(197,813)

Class AUD: 決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)
2020年11月4日	JPY	613,788,686	AUD	8,254,868	71,028
2020年12月2日	JPY	585,835,929	USD	5,543,872	55,988
2020年11月4日	JPY	38,279,452	AUD	506,936	9,965
2020年12月2日	JPY	15,504,712	CAD	193,452	3,153
2020年12月2日	JPY	22,580,281	AUD	304,111	2,351
2020年11月4日	JPY	31,100,847	USD	295,475	1,714
2020年11月4日	JPY	22,015,774	USD	208,730	1,646
2020年11月4日	JPY	14,782,246	CAD	186,896	1,130
2020年12月2日	USD	289,328	JPY	30,172,635	916
2020年11月4日	JPY	2,144,360	AUD	28,254	659
2020年12月2日	JPY	3,389,800	AUD	45,347	568
2020年11月4日	JPY	1,994,000	AUD	26,371	544
2020年11月4日	JPY	697,900	AUD	9,142	252
2020年11月4日	JPY	598,200	AUD	7,882	184
2020年12月2日	JPY	1,096,700	AUD	14,711	156
2020年11月4日	JPY	1,097,906	CAD	13,796	148
2020年11月4日	JPY	564,507	CAD	7,020	131
2020年11月4日	JPY	1,072,500	USD	10,121	127
2020年12月2日	JPY	997,000	AUD	13,425	105
2020年11月4日	JPY	390,000	USD	3,695	32
2020年11月4日	JPY	99,700	AUD	1,317	28
2020年11月4日	JPY	99,700	AUD	1,319	27
2020年11月4日	JPY	262,524	CAD	3,316	22
2020年11月4日	JPY	99,700	AUD	1,326	22
2020年12月2日	JPY	292,500	USD	2,774	22
2020年12月2日	CAD	11,863	JPY	928,702	18
2020年11月4日	JPY	97,500	USD	926	6
2020年11月4日	JPY	97,500	USD	925	6
2020年11月4日	JPY	27,500	CAD	343	6
2020年12月2日	JPY	7,500	CAD	93	2
2020年11月4日	JPY	2,500	CAD	32	-
2020年11月4日	JPY	2,500	CAD	32	-
2020年11月4日	JPY	10,000	CAD	127	-
2020年11月4日	CAD	32	JPY	2,492	-
2020年11月4日	CAD	31	JPY	2,492	-
2020年11月4日	CAD	31	JPY	2,492	-
2020年12月2日	JPY	2,500	CAD	32	-
2020年12月2日	JPY	97,500	USD	932	-
					150,956

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)
2020年11月4日	CAD	188	JPY	14,955	(2)
2020年12月2日	AUD	1,358	JPY	100,000	(2)
2020年11月4日	CAD	217	JPY	17,447	(4)
2020年12月2日	CAD	312	JPY	24,925	(4)
2020年12月2日	CAD	344	JPY	27,417	(4)
2020年12月2日	USD	10,215	JPY	1,069,283	(6)
2020年11月4日	AUD	1,351	JPY	100,000	(7)
2020年11月4日	USD	922	JPY	97,208	(7)
2020年11月4日	CAD	626	JPY	49,850	(7)
2020年11月4日	CAD	674	JPY	53,609	(7)
2020年11月4日	USD	920	JPY	97,208	(9)
2020年12月2日	CAD	1,068	JPY	84,745	(9)
2020年11月4日	USD	917	JPY	97,208	(11)
2020年11月4日	AUD	1,340	JPY	100,000	(15)
2020年12月2日	USD	9,275	JPY	972,075	(17)
2020年11月4日	CAD	9,289	JPY	731,758	(28)
2020年12月2日	AUD	4,040	JPY	300,000	(31)
2020年11月4日	AUD	5,399	JPY	400,000	(33)
2020年11月4日	USD	5,519	JPY	583,245	(54)
2020年11月4日	USD	6,441	JPY	680,453	(61)
2020年12月2日	USD	31,527	JPY	3,305,055	(65)
2020年12月2日	CAD	7,022	JPY	564,507	(131)
2020年11月4日	USD	18,408	JPY	1,944,150	(170)
2020年11月4日	JPY	10,238,464	USD	98,029	(194)
2020年11月4日	USD	19,783	JPY	2,090,771	(196)
2020年11月4日	AUD	14,514	JPY	1,100,000	(324)
2020年12月2日	JPY	28,637,972	AUD	391,519	(1,106)
2020年12月2日	USD	208,790	JPY	22,015,774	(1,653)
2020年11月4日	CAD	193,452	JPY	15,507,371	(3,143)
2020年11月4日	USD	498,724	JPY	52,560,213	(3,523)
2020年11月4日	AUD	137,909	JPY	10,500,988	(3,545)
2020年11月4日	AUD	508,428	JPY	38,815,151	(14,036)
2020年11月4日	JPY	593,229,656	USD	5,686,334	(17,632)
2020年11月4日	USD	5,543,872	JPY	585,983,950	(55,592)
2020年12月2日	AUD	7,950,867	JPY	591,135,408	(68,954)
2020年11月4日	AUD	8,168,474	JPY	621,260,611	(203,068)
					(373,650)

Class BRL:

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)
2020年11月4日	JPY	1,733,138,344	BRL	91,579,740	631,186
2020年12月2日	JPY	1,780,011,555	USD	16,844,573	170,113
2020年11月4日	BRL	91,579,740	JPY	1,658,710,574	80,020
2020年12月2日	JPY	105,995,842	BRL	5,616,953	37,404
2020年12月2日	JPY	45,546,828	CAD	568,288	9,262
2020年11月4日	JPY	103,345,946	USD	979,815	7,724
2020年11月4日	JPY	90,791,372	USD	862,568	5,004
2020年11月4日	JPY	15,858,060	BRL	845,380	4,482
2020年11月4日	JPY	42,767,909	CAD	540,726	3,270
2020年12月2日	USD	893,739	JPY	93,203,625	2,828
2020年12月2日	JPY	12,063,700	BRL	647,625	2,808
2020年11月4日	JPY	4,586,200	BRL	242,512	1,640
2020年11月4日	JPY	2,193,400	BRL	111,219	1,613
2020年12月2日	JPY	5,383,800	BRL	288,800	1,292
2020年11月4日	JPY	9,360,000	USD	88,331	1,110
2020年11月4日	JPY	3,290,100	BRL	174,539	1,078
2020年11月4日	JPY	3,788,300	BRL	201,951	1,071
2020年11月4日	JPY	2,293,100	BRL	121,161	836
2020年11月4日	JPY	2,691,900	BRL	143,192	815
2020年11月4日	BRL	845,380	JPY	15,311,691	739
2020年11月4日	JPY	2,649,896	CAD	32,955	614
2020年11月4日	JPY	2,093,700	BRL	111,999	525
2020年11月4日	JPY	1,595,200	BRL	85,260	412
2020年11月4日	JPY	697,900	BRL	36,588	304
2020年11月4日	JPY	598,200	BRL	31,340	265
2020年11月4日	JPY	2,910,019	CAD	36,760	246
2020年11月4日	BRL	242,512	JPY	4,392,433	212
2020年11月4日	BRL	201,951	JPY	3,657,779	176
2020年11月4日	BRL	174,539	JPY	3,161,291	153
2020年11月4日	BRL	143,192	JPY	2,593,527	125
2020年11月4日	BRL	121,161	JPY	2,194,498	106
2020年11月4日	BRL	111,999	JPY	2,028,540	98
2020年11月4日	BRL	111,219	JPY	2,014,416	97
2020年11月4日	JPY	1,170,000	USD	11,085	95
2020年11月4日	JPY	398,800	BRL	21,393	90
2020年11月4日	BRL	85,260	JPY	1,544,241	75
2020年11月4日	JPY	199,400	BRL	10,541	72
2020年11月4日	JPY	197,900	BRL	10,507	63
2020年11月4日	JPY	240,000	CAD	2,990	52
2020年11月4日	USD	20,479	JPY	2,138,566	43
2020年11月4日	BRL	36,588	JPY	662,692	32
2020年11月4日	JPY	487,500	USD	4,627	31
2020年11月4日	BRL	31,340	JPY	567,632	27
2020年11月4日	BRL	21,393	JPY	387,471	19
2020年11月4日	JPY	292,500	USD	2,778	17
2020年11月4日	JPY	97,500	USD	923	9
2020年11月4日	BRL	10,507	JPY	190,313	9
2020年11月4日	BRL	10,541	JPY	190,912	9
2020年11月4日	JPY	97,500	USD	925	7
2020年12月2日	USD	932	JPY	97,208	3

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)	
2020年11月4日	JPY	12,500	CAD	158	119	1
2020年11月4日	JPY	30,000	CAD	381	284	1
2020年11月4日	JPY	7,500	CAD	95	71	-
2020年11月4日	CAD	63	JPY	4,985	47	-
2020年11月4日	JPY	2,500	CAD	31	24	-
2020年11月4日	JPY	2,500	CAD	31	24	-
2020年12月2日	CAD	32	JPY	2,492	24	-
2020年12月2日	CAD	795	JPY	62,312	595	-
2020年12月2日	CAD	1,239	JPY	97,207	929	-
2020年12月2日	JPY	2,500	CAD	32	24	-
2020年12月2日	JPY	97,500	USD	932	932	-
					968,283	

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)	
2020年11月4日	CAD	221	JPY	17,447	166	(1)
2020年11月4日	CAD	126	JPY	9,970	94	(1)
2020年12月2日	USD	36,237	JPY	3,791,093	36,238	(1)
2020年11月4日	CAD	188	JPY	14,954	142	(2)
2020年12月2日	JPY	99,700	BRL	5,500	955	(2)
2020年11月4日	CAD	503	JPY	39,880	378	(4)
2020年11月4日	CAD	217	JPY	17,447	165	(4)
2020年11月4日	CAD	693	JPY	54,834	525	(5)
2020年11月4日	JPY	96,650	BRL	5,336	923	(5)
2020年11月4日	CAD	655	JPY	52,342	497	(9)
2020年11月4日	CAD	717	JPY	57,327	545	(10)
2020年12月2日	USD	23,218	JPY	2,430,188	23,230	(12)
2020年11月4日	CAD	1,221	JPY	97,207	920	(13)
2020年11月4日	CAD	840	JPY	67,297	638	(13)
2020年11月4日	JPY	285,937	BRL	15,787	2,731	(14)
2020年11月4日	USD	1,843	JPY	194,415	1,858	(15)
2020年11月4日	CAD	1,024	JPY	82,252	780	(18)
2020年11月4日	CAD	1,435	JPY	114,655	1,082	(19)
2020年12月2日	CAD	1,687	JPY	134,595	1,284	(22)
2020年11月4日	BRL	5,336	JPY	100,000	954	(27)
2020年12月2日	CAD	3,801	JPY	301,592	2,877	(33)
2020年11月4日	USD	3,681	JPY	388,830	3,716	(35)
2020年11月4日	USD	6,458	JPY	680,453	6,502	(44)
2020年11月4日	USD	5,522	JPY	583,246	5,573	(51)
2020年11月4日	CAD	4,981	JPY	396,471	3,751	(54)
2020年11月4日	JPY	1,146,990	BRL	63,327	10,955	(55)
2020年11月4日	USD	6,441	JPY	680,453	6,502	(61)
2020年12月2日	USD	50,085	JPY	5,249,205	50,175	(90)
2020年11月4日	USD	21,270	JPY	2,235,773	21,364	(94)
2020年11月4日	USD	14,746	JPY	1,555,320	14,862	(116)
2020年11月4日	BRL	15,787	JPY	300,000	2,885	(121)
2020年11月4日	USD	19,370	JPY	2,041,358	19,507	(137)
2020年11月4日	USD	24,890	JPY	2,624,603	25,079	(189)
2020年12月2日	JPY	2,492,500	BRL	138,427	23,892	(222)

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)
2020年12月2日	USD	112,200	JPY	112,200	(231)
2020年11月4日	USD	30,404	JPY	3,207,848	(249)
2020年11月4日	USD	35,872	JPY	3,791,093	(354)
2020年12月2日	JPY	3,788,300	BRL	210,615	(377)
2020年11月4日	JPY	9,266,380	BRL	511,610	(447)
2020年11月4日	BRL	63,327	JPY	1,200,000	(451)
2020年11月4日	USD	42,204	JPY	4,471,545	(524)
2020年12月2日	CAD	32,962	JPY	2,649,896	(614)
2020年11月4日	USD	146,305	JPY	15,462,369	(1,448)
2020年11月4日	JPY	113,490,752	USD	1,086,632	(2,152)
2020年11月4日	BRL	511,610	JPY	9,600,000	(2,741)
2020年11月4日	JPY	106,902,317	BRL	5,902,227	(5,157)
2020年12月2日	USD	980,098	JPY	103,345,946	(7,760)
2020年11月4日	CAD	568,288	JPY	45,554,639	(9,234)
2020年12月2日	JPY	106,532,752	BRL	5,916,547	(9,510)
2020年11月4日	USD	1,443,504	JPY	152,129,895	(10,198)
2020年11月4日	JPY	1,732,814,844	USD	16,609,696	(51,504)
2020年11月4日	JPY	1,579,909,731	BRL	87,229,035	(76,219)
2020年11月4日	BRL	5,902,227	JPY	116,400,771	(85,607)
2020年11月4日	USD	16,844,573	JPY	1,780,461,305	(168,913)
2020年12月2日	BRL	95,975,964	JPY	1,814,480,303	(671,106)
2020年11月4日	BRL	87,229,035	JPY	1,727,361,692	(1,332,782)
					<u>(2,439,077)</u>

Class ZAR:

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)
2020年12月2日	JPY	16,277,010	USD	154,032	1,556
2020年12月2日	ZAR	2,641,002	JPY	16,813,962	1,004
2020年11月4日	ZAR	2,461,472	JPY	15,813,236	120
2020年11月4日	ZAR	136,972	JPY	868,294	118
2020年12月2日	JPY	412,861	CAD	5,151	84
2020年11月4日	ZAR	163,721	JPY	1,046,456	59
2020年11月4日	JPY	397,532	CAD	5,026	30
2020年11月4日	JPY	325,142	USD	3,083	24
2020年12月2日	USD	7,499	JPY	781,995	24
2020年11月4日	ZAR	3,260	JPY	20,000	9
2020年11月4日	ZAR	3,263	JPY	20,000	9
2020年11月4日	JPY	68,250	USD	644	8
2020年11月4日	ZAR	11,022	JPY	70,000	8
2020年11月4日	ZAR	1,628	JPY	10,000	4
2020年11月4日	JPY	28,105	CAD	353	4
2020年11月4日	ZAR	4,726	JPY	30,000	4
2020年11月4日	JPY	26,161	CAD	330	2
2020年11月4日	JPY	19,500	USD	185	2
2020年11月4日	JPY	29,250	USD	278	2
2020年11月4日	JPY	8,336	CAD	104	2
2020年12月2日	USD	652	JPY	68,046	2
2020年11月4日	JPY	9,750	USD	93	1
2020年11月4日	JPY	19,500	USD	185	1
2020年11月4日	JPY	250	CAD	3	-
2020年11月4日	JPY	500	CAD	6	-
2020年11月4日	JPY	500	CAD	6	-
2020年11月4日	CAD	3	JPY	249	-
2020年11月4日	CAD	3	JPY	249	-
2020年11月4日	CAD	6	JPY	498	-
2020年11月4日	CAD	39	JPY	3,075	-
2020年11月4日	JPY	1,750	CAD	22	-
2020年11月4日	CAD	12	JPY	997	-
2020年11月4日	JPY	750	CAD	9	-
2020年12月2日	CAD	22	JPY	1,744	-
2020年12月2日	ZAR	3,125	JPY	20,000	-
2020年12月2日	JPY	500	CAD	6	-
2020年12月2日	JPY	19,500	USD	186	-
					3,077

決済日	受取通貨		時価 (\$)	引渡通貨		時価 (\$)	未実現評価損 (\$)
2020年11月4日	CAD	282	211	JPY	22,228	212	(1)
2020年11月4日	USD	92	92	JPY	9,721	93	(1)
2020年11月4日	JPY	9,970	93	ZAR	1,561	94	(1)
2020年11月4日	USD	92	92	JPY	9,721	93	(1)
2020年11月4日	USD	184	184	JPY	19,442	186	(2)
2020年11月4日	JPY	19,940	187	ZAR	3,139	189	(2)
2020年12月2日	CAD	104	77	JPY	8,336	79	(2)
2020年11月4日	USD	369	369	JPY	38,883	372	(3)
2020年11月4日	JPY	9,970	90	ZAR	1,614	94	(4)
2020年11月4日	JPY	39,880	374	ZAR	6,265	378	(4)
2020年11月4日	JPY	123,030	1,157	ZAR	19,257	1,164	(7)
2020年12月2日	JPY	69,790	661	ZAR	11,024	669	(8)
2020年11月4日	USD	1,135	1,135	JPY	119,955	1,146	(11)
2020年11月4日	JPY	1,020,295	9,750	USD	9,769	9,769	(19)
2020年12月2日	JPY	333,478	3,140	ZAR	52,409	3,162	(22)
2020年12月2日	USD	3,084	3,084	JPY	325,142	3,108	(24)
2020年11月4日	CAD	5,411	4,037	JPY	433,728	4,125	(88)
2020年12月2日	JPY	1,131,345	10,650	ZAR	179,141	10,806	(156)
2020年11月4日	JPY	861,234	7,777	ZAR	140,360	8,171	(394)
2020年11月4日	JPY	15,101,215	144,302	USD	144,751	144,751	(449)
2020年11月4日	JPY	16,697,044	157,266	ZAR	2,613,868	158,303	(1,037)
2020年11月4日	USD	154,032	154,032	JPY	16,281,122	155,577	(1,545)
							(3,781)

Class USD:

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)
2020年11月4日	JPY	29,916,086	USD	283,030	2,838
2020年12月2日	JPY	7,942,857	CAD	99,103	1,615
2020年11月4日	JPY	12,263,100	USD	115,744	1,438
2020年11月4日	USD	286,087	JPY	29,846,192	887
2020年11月4日	JPY	8,159,162	CAD	103,158	624
2020年11月4日	JPY	1,285,170	USD	12,160	120
2020年11月4日	JPY	780,000	USD	7,361	93
2020年12月2日	USD	11,507	JPY	1,200,000	36
2020年12月2日	JPY	277,717	USD	2,634	21
2020年11月4日	JPY	195,000	USD	1,847	16
2020年11月4日	JPY	199,400	USD	1,890	15
2020年11月4日	JPY	195,000	USD	1,852	12
2020年11月4日	JPY	99,700	USD	944	9
2020年11月4日	USD	2,829	JPY	295,427	6
2020年12月2日	USD	3,722	JPY	388,830	6
2020年11月4日	JPY	20,000	CAD	249	4
2020年12月2日	JPY	7,120	CAD	89	2
2020年12月2日	JPY	292,500	USD	2,795	1
2020年11月4日	JPY	5,000	CAD	63	-
2020年11月4日	JPY	5,000	CAD	63	-
2020年11月4日	CAD	63	JPY	4,984	-
2020年11月4日	CAD	31	JPY	2,492	-
2020年12月2日	JPY	30,000	CAD	383	-
2020年12月2日	JPY	7,500	CAD	96	-
					7,743

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)
2020年11月4日	CAD	96	JPY	7,575	(1)
2020年12月2日	CAD	125	JPY	9,970	(1)
2020年12月2日	USD	2,866	JPY	300,000	(1)
2020年11月4日	CAD	89	JPY	7,120	(2)
2020年11月4日	CAD	404	JPY	32,129	(4)
2020年11月4日	JPY	303,002	USD	2,901	(6)
2020年12月2日	JPY	398,800	USD	3,818	(6)
2020年11月4日	USD	920	JPY	97,208	(9)
2020年11月4日	USD	1,899	JPY	200,000	(12)
2020年11月4日	USD	1,843	JPY	194,416	(15)
2020年11月4日	USD	1,895	JPY	200,000	(16)
2020年12月2日	USD	2,701	JPY	284,837	(21)
2020年11月4日	USD	2,633	JPY	277,717	(21)
2020年12月2日	JPY	1,170,000	USD	11,219	(35)
2020年11月4日	CAD	3,838	JPY	306,577	(52)
2020年11月4日	USD	7,550	JPY	800,000	(95)
2020年11月4日	USD	11,856	JPY	1,253,041	(117)
2020年11月4日	USD	112,850	JPY	11,956,523	(1,402)
2020年11月4日	CAD	99,103	JPY	7,944,219	(1,610)
2020年12月2日	USD	283,030	JPY	29,908,529	(2,858)
					(6,284)

Class MXN: 決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)
2020年11月4日	JPY	489,008,354	MXN	98,096,045	58,685
2020年12月2日	JPY	456,042,822	USD	4,315,616	43,583
2020年12月2日	JPY	11,774,228	CAD	146,907	2,394
2020年11月4日	JPY	22,944,511	USD	217,985	1,265
2020年11月4日	JPY	10,909,764	CAD	137,935	834
2020年12月2日	USD	232,112	JPY	24,205,811	735
2020年12月2日	JPY	5,718,061	MXN	1,151,280	672
2020年11月4日	JPY	5,575,110	USD	52,857	417
2020年11月4日	JPY	2,340,000	USD	22,083	278
2020年11月4日	MXN	85,177	JPY	400,000	184
2020年11月4日	MXN	42,942	JPY	200,000	109
2020年11月4日	JPY	733,020	CAD	9,260	62
2020年12月2日	JPY	398,800	MXN	80,114	55
2020年11月4日	MXN	21,200	JPY	100,000	42
2020年12月2日	CAD	7,592	JPY	591,545	38
2020年12月2日	MXN	82,264	JPY	400,000	34
2020年11月4日	JPY	142,951	CAD	1,778	33
2020年11月4日	JPY	390,000	USD	3,695	32
2020年11月4日	JPY	3,005,120	MXN	610,102	19
2020年11月4日	JPY	195,000	USD	1,851	13
2020年11月4日	JPY	60,000	CAD	747	13
2020年11月4日	MXN	487,835	JPY	2,400,000	13
2020年11月4日	JPY	97,500	USD	923	9
2020年11月4日	JPY	299,100	MXN	60,724	2
2020年11月4日	JPY	99,700	MXN	20,221	2
2020年12月2日	JPY	390,000	USD	3,726	2
2020年11月4日	JPY	5,000	CAD	63	-
2020年11月4日	JPY	10,000	CAD	127	-
2020年11月4日	JPY	2,500	CAD	32	-
2020年11月4日	CAD	31	JPY	2,492	-
2020年11月4日	CAD	31	JPY	2,492	-
2020年11月4日	CAD	31	JPY	2,492	-
2020年12月2日	JPY	10,000	CAD	128	-
					109,525

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)
2020年11月4日	CAD	94	JPY	7,477	71 (1)
2020年11月4日	JPY	99,700	MXN	20,269	941 (1)
2020年11月4日	CAD	125	JPY	9,970	95 (1)
2020年12月2日	CAD	126	JPY	9,970	95 (1)
2020年11月4日	USD	922	JPY	97,208	929 (7)
2020年12月2日	USD	3,709	JPY	388,830	3,717 (8)
2020年11月4日	USD	920	JPY	97,208	929 (9)
2020年11月4日	CAD	944	JPY	75,129	711 (10)
2020年11月4日	USD	917	JPY	97,208	928 (11)
2020年11月4日	JPY	398,800	MXN	81,389	3,781 (17)
2020年11月4日	USD	2,759	JPY	291,623	2,786 (27)
2020年11月4日	USD	3,687	JPY	388,830	3,715 (28)
2020年11月4日	JPY	99,700	MXN	20,945	945 (32)
2020年12月2日	CAD	1,778	JPY	142,951	1,356 (33)
2020年11月4日	USD	27,724	JPY	2,930,031	27,998 (274)
2020年12月2日	USD	52,872	JPY	5,575,110	53,291 (419)
2020年11月4日	JPY	28,587,810	USD	273,718	273,718 (542)
2020年12月2日	JPY	22,567,076	MXN	4,641,139	215,540 (1,917)
2020年11月4日	MXN	5,909,551	JPY	29,320,830	280,486 (2,214)
2020年11月4日	CAD	146,907	JPY	11,776,247	112,002 (2,387)
2020年11月4日	USD	356,003	JPY	37,518,879	358,518 (2,515)
2020年11月4日	MXN	5,936,921	JPY	29,489,873	280,739 (2,542)
2020年11月4日	JPY	26,627,500	MXN	5,503,369	254,116 (4,417)
2020年11月4日	JPY	436,945,959	USD	4,188,295	4,188,295 (12,987)
2020年11月4日	USD	4,315,616	JPY	456,158,049	4,358,892 (43,276)
2020年11月4日	MXN	91,929,438	JPY	457,211,061	4,363,256 (44,898)
2020年12月2日	MXN	92,492,250	JPY	459,564,669	4,389,552 (55,768)
					<u>(174,342)</u>

Class Composite:

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価益 (\$)	
2020年11月2日	USD	11,468	JPY	1,196,400	11,432	36
2020年11月5日	JPY	2,430,188	USD	23,211	23,211	11
2020年11月4日	JPY	1,846,943	USD	17,640	17,640	8
2020年11月4日	USD	956	JPY	99,700	953	3
2020年11月2日	USD	669	JPY	69,790	667	2
2020年11月2日	JPY	400,000	USD	3,820	3,820	2
2020年11月2日	JPY	300,000	USD	2,865	2,865	1
2020年11月6日	JPY	3,791,093	USD	36,226	36,226	1
2020年11月4日	JPY	2,492	CAD	32	24	-
2020年11月2日	JPY	1,744	CAD	22	17	-
2020年11月2日	JPY	29,910	CAD	382	287	-
2020年11月2日	CAD	96	JPY	7,500	72	-
2020年11月2日	CAD	128	JPY	10,000	96	-
2020年11月5日	JPY	62,312	CAD	794	595	-
2020年11月4日	JPY	47,357	CAD	604	452	-
2020年11月4日	CAD	32	JPY	2,500	24	-
2020年11月5日	CAD	32	JPY	2,500	24	-
2020年11月4日	CAD	6	JPY	500	5	-
2020年11月6日	JPY	97,207	CAD	1,239	929	-
2020年11月4日	JPY	100,000	USD	956	956	-
2020年11月5日	JPY	100,000	USD	956	956	-
2020年11月4日	JPY	20,000	USD	191	191	-
2020年11月5日	USD	932	JPY	97,500	932	-
2020年11月4日	USD	932	JPY	97,500	932	-
2020年11月4日	USD	186	JPY	19,500	186	-
2020年11月6日	USD	37,155	JPY	3,888,300	37,155	-
						64

決済日	受取通貨	時価 (\$)	引渡通貨	時価 (\$)	未実現評価損 (\$)	
2020年11月2日	USD	2,794	JPY	292,500	2,795	(1)
2020年11月2日	JPY	68,046	USD	652	652	(2)
2020年11月2日	USD	3,725	JPY	390,000	3,727	(2)
2020年11月4日	JPY	97,208	USD	932	932	(3)
2020年11月4日	USD	18,093	JPY	1,894,300	18,102	(9)
2020年11月5日	USD	23,806	JPY	2,492,500	23,817	(11)
2020年11月2日	JPY	1,166,490	USD	11,181	11,181	(35)
						(63)

野村マネーマーケット マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日2021年9月15日）

作成対象期間（2020年9月16日～2021年9月15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	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とし、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。 外貨建て資産への投資は行いません。

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

<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		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	中率			
8期(2017年9月15日)	円 10,053		% △0.0	% 69.2	% —	百万円 266
9期(2018年9月18日)	10,049		△0.0	53.8	—	74
10期(2019年9月17日)	10,044		△0.0	14.9	—	67
11期(2020年9月15日)	10,041		△0.0	81.5	—	46
12期(2021年9月15日)	10,036		△0.0	53.8	—	46

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、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

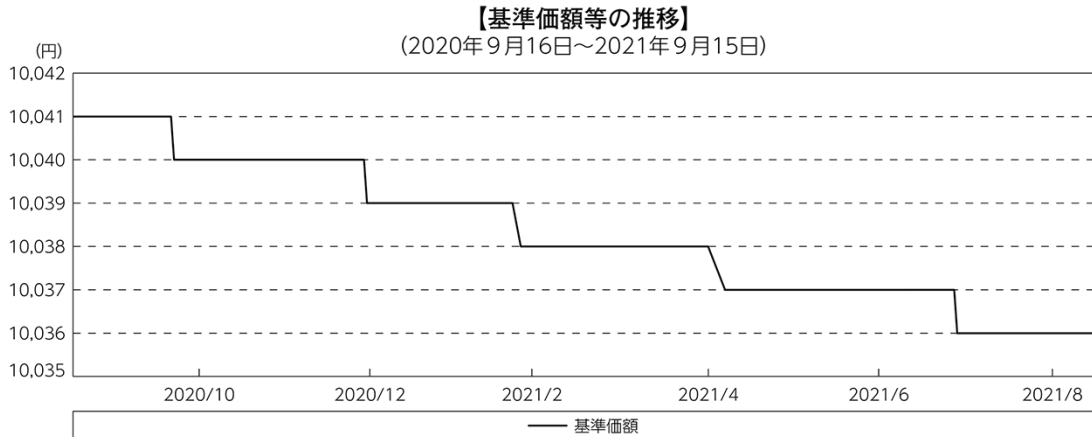
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2020年9月15日	円 10,041		% —	% 81.5	% —
9月末	10,041		0.0	60.1	—
10月末	10,040		△0.0	60.1	—
11月末	10,040		△0.0	60.1	—
12月末	10,039		△0.0	60.0	—
2021年1月末	10,039		△0.0	60.2	—
2月末	10,038		△0.0	60.2	—
3月末	10,038		△0.0	53.9	—
4月末	10,038		△0.0	53.8	—
5月末	10,037		△0.0	53.8	—
6月末	10,037		△0.0	53.8	—
7月末	10,036		△0.0	53.8	—
8月末	10,036		△0.0	53.7	—
(期末) 2021年9月15日	10,036		△0.0	53.8	—

*騰落率は期首比です。

*債券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

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.06%程度で推移しました。

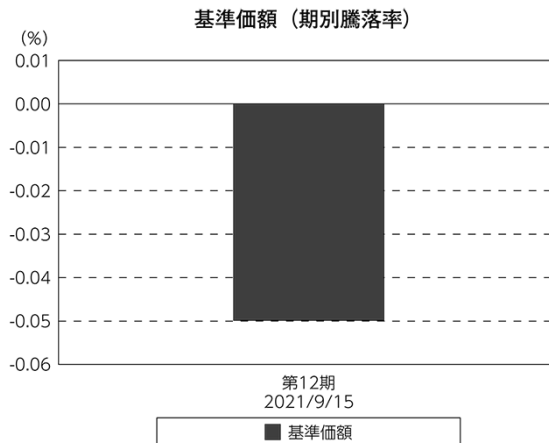
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、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

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

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。

○1万口当たりの費用明細

(2020年9月16日～2021年9月15日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年9月16日～2021年9月15日)

公社債

		買付額	売付額
国	国債証券	千円 28,006	千円 —
			(46,000)
内	特殊債券	25,193	—
			(20,000)

*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。

* () 内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年9月16日～2021年9月15日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
公社債	53	18	34.0	—	—	—

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証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年9月15日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特殊債券 (除く金融債)	25,000 (25,000)	25,089 (25,089)	53.8 (53.8)	— (—)	— (—)	— (—)	53.8 (53.8)
合 計	25,000 (25,000)	25,089 (25,089)	53.8 (53.8)	— (—)	— (—)	— (—)	53.8 (53.8)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	5,000	5,040	2022/8/15	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第2回	0.502	10,000	10,015	2021/12/24	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第152回	1.1	10,000	10,033	2021/12/28	
合 計		25,000	25,089		

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年9月15日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公社債	千円 25,089	% 53.8	千円 25,089	% 53.8
コール・ローン等、その他	21,548	46.2	21,548	46.2
投資信託財産総額	46,637	100.0	46,637	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年9月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	46,637,778
コール・ローン等	21,489,500
公社債(評価額)	25,089,434
未収利息	41,618
前払費用	17,226
(B) 負債	15
未払利息	15
(C) 純資産総額(A-B)	46,637,763
元本	46,471,378
次期繰越損益金	166,385
(D) 受益権総口数	46,471,378口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,036円

(注) 期首元本額は46,471,378円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は0円、1口当たり純資産額は1.0036円です。

○損益の状況 (2020年9月16日～2021年9月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	125,352
受取利息	130,599
支払利息	△ 5,247
(B) 有価証券売買損益	△150,762
売買損	△150,762
(C) 当期損益金(A+B)	△ 25,410
(D) 前期繰越損益金	191,795
(E) 計(C+D)	166,385
次期繰越損益金(E)	166,385

* 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。

○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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村北米REIT投信(ブラジルリアルコース) 毎月分配型	26,076,177
野村北米REIT投信(豪ドルコース) 毎月分配型	7,304,915
野村北米REIT投信(円コース) 毎月分配型	6,330,625
野村北米REIT投信(ブラジルリアルコース) 年2回決算型	1,594,426
野村北米REIT投信(円コース) 年2回決算型	1,401,832
USバンクローンファンド・為替ヘッジあり(毎月分配型)	995,521
USバンクローンファンド・為替ヘッジなし(毎月分配型)	995,521
USバンクローンファンド・為替ヘッジなし(年2回決算型)	995,521
野村北米REIT投信(豪ドルコース) 年2回決算型	507,609
野村北米REIT投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型	116,655
USバンクローンファンド・為替ヘッジあり(年2回決算型)	99,553
野村北米REIT投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	13,203
野村北米REIT投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,955
野村北米REIT投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,955
野村北米REIT投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,955
野村北米REIT投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,955

○お知らせ

該当事項はございません。