

# 野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型

## 運用報告書(全体版)

第60期(決算日2016年12月19日) 第61期(決算日2017年1月17日) 第62期(決算日2017年2月17日)  
 第63期(決算日2017年3月17日) 第64期(決算日2017年4月17日) 第65期(決算日2017年5月17日)

作成対象期間(2016年11月18日～2017年5月17日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
 当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
 今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/株式	
信託期間	2011年11月18日から2021年11月17日(当初、2016年11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・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス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・マザーファンド受益証券を通じて、世界の高配当利回り株式(以下、「高配当株」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス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	野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス受益証券および野村マネー・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・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス	世界の高配当株を主要投資対象とします。加えて、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用します。
主な投資制限	野村マネー・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。
	野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)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。
分配方針	野村マネー・マザーファンド	株式への投資は行いません。
	毎決算時に、原則として、配当等収益等を中心に安定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や安定分配とならない場合があります。なお、毎年5月および11月の決算時には、安定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。「原則として、配当等収益等を中心に安定分配を行う」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。	

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金						
	円		円		%		%		%	百万円
36期(2014年12月17日)	11,158		240		△ 7.6	0.0	—		98.5	226,330
37期(2015年1月19日)	11,440		240		4.7	0.0	—		98.6	267,040
38期(2015年2月17日)	11,719		240		4.5	0.0	—		97.8	319,049
39期(2015年3月17日)	11,147		240		△ 2.8	0.0	—		98.8	344,803
40期(2015年4月17日)	11,332		200		3.5	0.0	—		98.4	380,070
41期(2015年5月18日)	11,180		200		0.4	0.0	—		98.9	392,377
42期(2015年6月17日)	10,822		200		△ 1.4	0.0	—		98.9	399,399
43期(2015年7月17日)	10,924		200		2.8	0.0	—		98.8	414,980
44期(2015年8月17日)	9,988		200		△ 6.7	0.0	—		98.9	385,130
45期(2015年9月17日)	8,552		200		△12.4	0.0	—		98.9	332,014
46期(2015年10月19日)	8,667		200		3.7	0.0	—		98.8	338,966
47期(2015年11月17日)	8,472		200		0.1	0.0	—		98.9	333,021
48期(2015年12月17日)	7,962		200		△ 3.7	0.0	—		98.3	311,483
49期(2016年1月18日)	6,738		200		△12.9	0.0	—		98.8	263,335
50期(2016年2月17日)	6,307		200		△ 3.4	0.0	—		98.9	245,049
51期(2016年3月17日)	6,751		150		9.4	0.0	—		98.1	263,714
52期(2016年4月18日)	6,751		150		2.2	0.0	—		99.1	260,200
53期(2016年5月17日)	6,346		150		△ 3.8	0.0	—		98.9	243,812
54期(2016年6月17日)	5,751		150		△ 7.0	0.0	—		98.8	218,813
55期(2016年7月19日)	6,298		100		11.3	0.0	—		98.1	237,324
56期(2016年8月17日)	6,092		100		△ 1.7	0.0	—		99.2	223,602
57期(2016年9月20日)	5,865		100		△ 2.1	0.0	—		99.0	208,113
58期(2016年10月17日)	6,142		50		5.6	0.0	—		98.4	214,111
59期(2016年11月17日)	6,171		50		1.3	0.0	—		98.7	203,635
60期(2016年12月19日)	6,929		50		13.1	0.0	—		98.6	219,565
61期(2017年1月17日)	6,762		50		△ 1.7	0.0	—		99.2	208,913
62期(2017年2月17日)	7,023		50		4.6	0.0	—		99.0	207,469
63期(2017年3月17日)	7,112		50		2.0	0.0	—		99.0	204,460
64期(2017年4月17日)	6,739		50		△ 4.5	0.0	—		99.1	188,290
65期(2017年5月17日)	7,232		50		8.1	0.0	—		99.0	196,270

\*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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	信 託 券 率
		騰 落 率	騰 落 率				
第60期	(期首) 2016年11月17日	円 6,171	% -	% 0.0	% -	% 98.7	% -
	11月末	6,387	3.5	0.0	-	99.2	-
	(期末) 2016年12月19日	6,979	13.1	0.0	-	98.6	-
第61期	(期首) 2016年12月19日	6,929	-	0.0	-	98.6	-
	12月末	6,878	△ 0.7	0.0	-	99.3	-
	(期末) 2017年1月17日	6,812	△ 1.7	0.0	-	99.2	-
第62期	(期首) 2017年1月17日	6,762	-	0.0	-	99.2	-
	1月末	6,772	0.1	0.0	-	99.0	-
	(期末) 2017年2月17日	7,073	4.6	0.0	-	99.0	-
第63期	(期首) 2017年2月17日	7,023	-	0.0	-	99.0	-
	2月末	6,934	△ 1.3	0.0	-	99.2	-
	(期末) 2017年3月17日	7,162	2.0	0.0	-	99.0	-
第64期	(期首) 2017年3月17日	7,112	-	0.0	-	99.0	-
	3月末	6,996	△ 1.6	0.0	-	99.3	-
	(期末) 2017年4月17日	6,789	△ 4.5	0.0	-	99.1	-
第65期	(期首) 2017年4月17日	6,739	-	0.0	-	99.1	-
	4月末	6,955	3.2	0.0	-	98.9	-
	(期末) 2017年5月17日	7,282	8.1	0.0	-	99.0	-

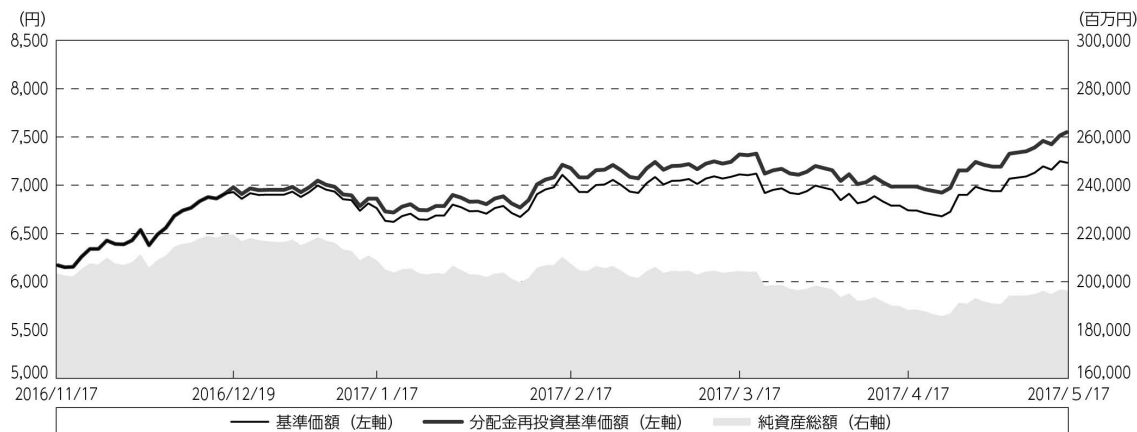
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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60期首：6,171円

第65期末：7,232円（既払分配金（税込み）：300円）

騰落率：22.3%（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（2016年11月17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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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

基準価額は、当作成期首6,171円から当作成期末には7,232円となりました。

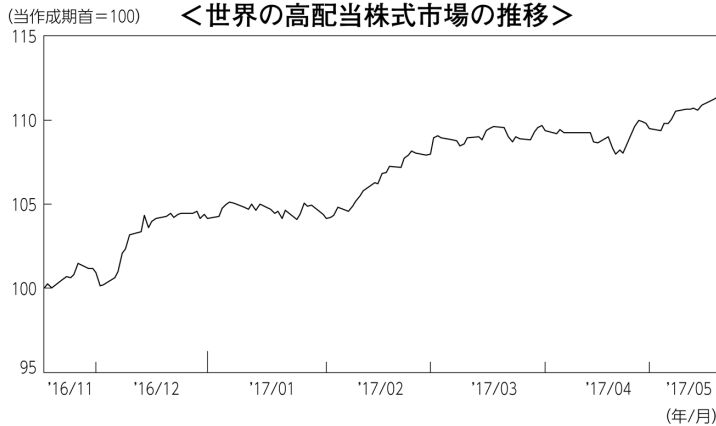
- ・ 実質的に投資している世界の高配当利回り株式（以下、「高配当株」といいます。）からのインカムゲイン（配当等収益）
- ・ 実質的に投資している世界の高配当株からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 実質的に保有する高配当株式の銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す『株式プレミアム戦略』による、オプションのプレミアム収入（またはオプションにおける支払い）
- ・ 円／選定通貨※の為替変動

※選定通貨は、投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した通貨を指します。

## ○投資環境

### <世界の高配当株式市場>

世界の高配当株式市場の騰落は以下ようになりました。



(注) 市場指数の騰落は、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。また、市場指数は、MSCIワールド・ハイ・ディビデンド・イールド・インデックスの現地通貨建て指数を用いています。  
(出所：ブルームバーグ)

世界の高配当株式市場は、ECB（欧州中央銀行）による資産購入プログラムが延長されたことに加え、米トランプ政権による税制改革案への期待が高まったことや、フランス大統領選挙の結果を受けて、欧州の政治リスクが後退したことなどから上昇し、当作成期間で値上がりとなりました。

●MSCIワールド・ハイ・ディビデンド・イールド・インデックスはMSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。また、MSCIは同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

## <為替レート>

2016年11月に行われた米大統領選挙において、保護主義や財政支出拡大などを掲げたトランプ候補が当選し、2017年1月に就任しました。また、米経済の緩やかな回復を受け、3月に開催されたFOMC（米連邦公開市場委員会）において、政策金利であるフェデラルファンド金利の誘導目標が0.25%引き上げられました。

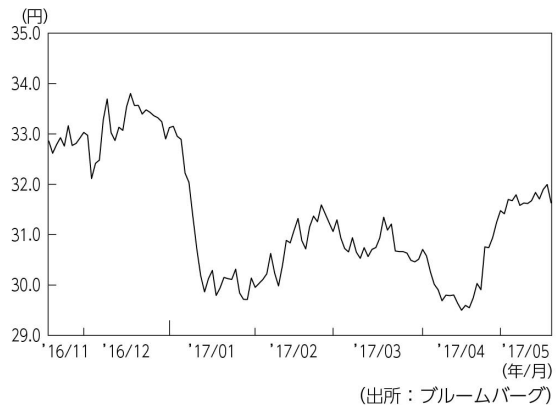
ブラジルでは、2016年8月に上院で行われた罷免投票によりルセフ大統領が失職して以降、テメル新政権が財政再建と経済改革に意欲的な姿勢を示したことが好感され、政府支出の伸び率が前年のインフレ率以下に抑える歳出上限法案が議会で可決されるなど、政策遂行能力に期待が集まりました。貿易黒字が定着し、経常赤字が減少傾向であるなど、一部の経済指標が改善を示しつつある点や他通貨に比べ相対的に高い金利水準であることなども、通貨を下支えしました。一方、トルコでは移民問題やEU（欧州連合）加盟交渉、対ロシア関係などでEUとの対立が続いた一方、国内ではテロ事件が多数発生し経済活動の妨げとなりました。同年7月に起きたクーデター未遂事件後の大規模な粛清やメディア統制、非常事態宣言の延長などが嫌気され、通貨は軟調に推移しました。2017年4月に実施された国民投票においては、大統領権限を強化する憲法改正案に対する賛成票が過半数となり、長引く政治停滞が解消されるとの期待が高まる一方、エルドアン大統領の強権的な政策運営に拍車がかかることが懸念されています。

当作成期に通貨セレクトコースにおいて選定した通貨の円に対する為替レートは以下のように推移いたしました。

<円/ブラジルレアル レートの推移>



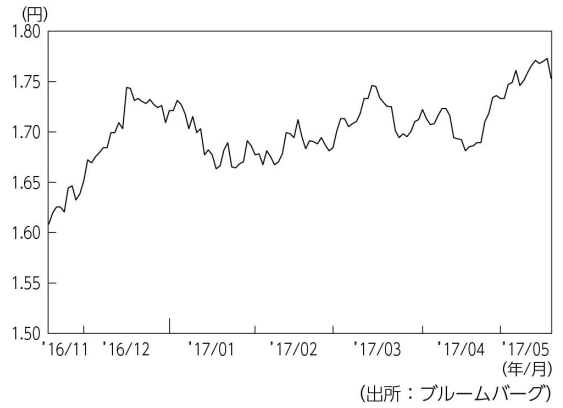
<円/トルコリラ レートの推移>



<円/南アフリカランド レートの推移>



<円/インドルピー レートの推移>



<円/メキシコペソ レートの推移>



## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー通貨セレクトクラス] 受益証券および[野村マネー 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・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー通貨セレクトクラス] 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

### [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー通貨セレクトクラス]

#### ・ポートフォリオ特性値

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムの当作成期末現在のポートフォリオ特性値は、下図のようになりました。

ポートフォリオ特性値	
組入比率	91.4%
カバー率	42.3%
平均行使価格	102.6%
平均行使期間	28.0日
配当利回り（年率、米ドル為替取引後ベース）*	3.4%
プレミアム（年率）	3.5%

- ・左記のポートフォリオ特性値は、各副投資顧問会社のポートフォリオの特性値（カバー率、平均行使価格等）を、その組入比率で加重平均したものです（米ドル建て）。
  - ・カバー率：純資産に対するオプションのポジション
  - ・平均行使価格：原資産価格（株価）に対する平均権利行使価格
  - ・平均行使期間：権利行使日までの平均日数
  - ・配当利回り：純資産に対する予想配当利回り
  - ・プレミアム（年率）：純資産に対する年率調整後のプレミアム収入
- ※米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、原則として米ドル以外の株式など組入資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行います。また、当該為替取引では、米ドルの金利が株式など組入資産にかかる通貨の金利より低い場合は為替取引によるコストが発生する場合があります。配当利回りは、組入資産（現地通貨建て）の配当利回りに当該為替取引によるプレミアム／コストを反映し、表示しています。

主要投資対象である [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム] のポートフォリオにおける地域別比率は、当作成期末現在で、米州29.0%、欧州33.3%、アジア・太平洋29.1%となりました。同ポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、金融29.6%、生活必需品15.8%、通信8.3%となりました。

\* 地域別株式配分比率において、国・地域は原則発行国・地域で区分しております。



また、高配当株への投資に加えて、『株式プレミアム戦略』に則り、現物株の買い入れと同時にコール・オプションの売却を行い、プレミアム収入の確保を図りました。

なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ（基礎的諸条件）、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定し、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、原則として実質的に米ドルを売り各選定通貨を買う為替取引を行いました。選定通貨は定期的に見直しを行いました。当作成期末時点ではブラジルレアル、トルコリラ、南アフリカランド、インドルピー、メキシコペソを選定しています。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・ブロードは、J. P. Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建ての世界主要国の債券、現地通貨建ての新興国の債券をそれぞれ対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

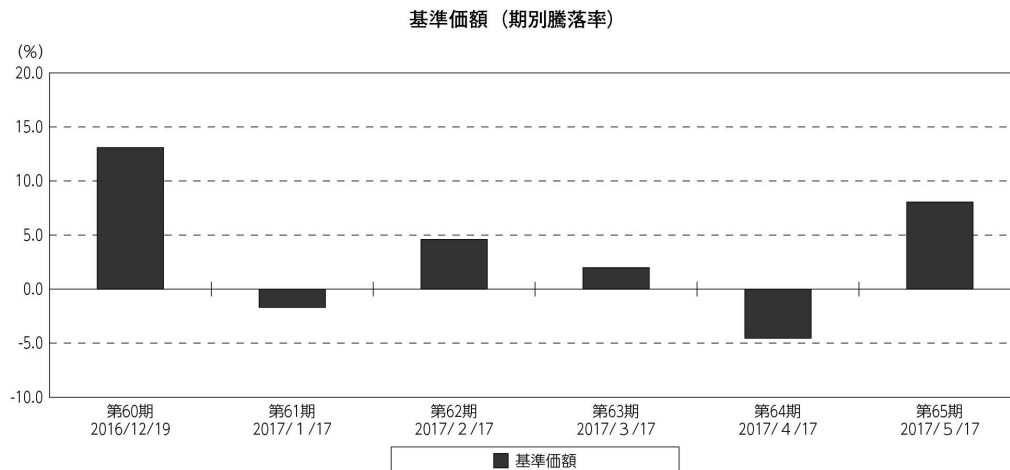
### **[野村マネー マザーファンド]**

残存期間の短い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い、あわせてコール・ローン等で運用を行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

収益分配については、各期毎の分配原資の範囲内で委託会社が決定するものとし、配当等の収入、信託報酬などの諸経費を勘案して分配を行いました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期
	2016年11月18日～ 2016年12月19日	2016年12月20日～ 2017年1月17日	2017年1月18日～ 2017年2月17日	2017年2月18日～ 2017年3月17日	2017年3月18日～ 2017年4月17日	2017年4月18日～ 2017年5月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	50 0.716%	50 0.734%	50 0.707%	50 0.698%	50 0.736%	50 0.687%
当期の収益	50	50	50	50	50	50
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	8,034	8,053	8,078	8,100	8,120	8,146

(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。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

## ◎今後の運用方針

### 【野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型】

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー通貨セレクトクラス〕受益証券および〔野村マネー 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・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー通貨セレクトクラス〕受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

### 【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー通貨セレクトクラス】

ファンドは、世界の株式市場から選別した高配当株に投資することにより、高水準のインカムゲイン（配当等収益）の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。また、保有する高配当株式にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す『株式プレミアム戦略』を活用し、更なる収益の獲得に努めていきます。

米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が当該資産について、原則として対米ドルで為替取引を行います。組入資産について、原則として、米ドルを売り、選定通貨（米ドルを除く）を買う為替取引を行うことで、各通貨への投資効果を追求します。通貨の選択にあたっては、原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に（原則、毎月）見直すこととします。

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う場合があります。

### 【野村マネー マザーファンド】

残存期間の短い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い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図って運用いたします。

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。

※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

(2016年11月18日～2017年5月17日)

項 目	第60期～第65期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 32	% 0.471	(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 ）	(13)	(0.187)	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 ）	(18)	(0.268)	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 ）	( 1)	(0.016)	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	32	0.473	
作成期間の平均基準価額は、6,820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。

## ○売買及び取引の状況

(2016年11月18日～2017年5月17日)

## 投資信託証券

銘 柄	第60期～第65期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内		千円		千円
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 通貨セレクトクラス	49,370	223,497	7,887,831	35,567,553

\*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

(2016年11月18日～2017年5月17日)

## 利害関係人との取引状況

＜野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型＞  
該当事項はございません。

## ＜野村マネー マザーファンド＞

区 分	第60期～第65期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 22,057	百万円 2,256	% 10.2	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2017年5月17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59期末	第65期末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 通貨セレクトクラス	48,692,539	40,854,078	194,383,703	99.0
合 計	48,692,539	40,854,078	194,383,703	99.0

\*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59期末		第65期末		
		口	数	口	数	評 価 額
野村マネー マザーファンド			千口 983		千口 983	千円 1,003

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月17日現在)

項	目	第65期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
投資信託受益証券		194,383,703	97.5
野村マネー マザーファンド		1,003	0.0
コール・ローン等、その他		4,989,367	2.5
投資信託財産総額		199,374,073	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60期末	第61期末	第62期末	第63期末	第64期末	第65期末
		2016年12月19日現在	2017年1月17日現在	2017年2月17日現在	2017年3月17日現在	2017年4月17日現在	2017年5月17日現在
		円	円	円	円	円	円
(A) 資産		222,901,958,555	212,412,649,240	210,935,218,585	207,172,728,193	191,111,270,677	199,374,073,047
	コール・ローン等	4,103,924,659	4,532,129,555	4,681,422,335	3,769,316,076	3,763,238,336	4,142,933,718
	投資信託受益証券(評価額)	216,534,757,424	207,219,962,884	205,356,078,480	202,361,868,332	186,544,348,144	194,383,703,124
	野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,735	1,003,735	1,003,637	1,003,637	1,003,637	1,003,539
	未収入金	2,262,272,737	659,553,066	896,714,133	1,040,540,148	802,680,560	846,432,666
(B) 負債		3,336,147,946	3,499,422,823	3,465,264,754	2,712,625,998	2,820,600,669	3,103,551,376
	未払収益分配金	1,584,505,716	1,544,712,764	1,477,154,045	1,437,395,154	1,397,113,661	1,356,997,726
	未払解約金	1,576,083,201	1,791,861,292	1,822,851,718	1,125,330,888	1,264,039,849	1,596,578,358
	未払信託報酬	174,957,397	162,290,001	164,691,377	149,386,165	158,900,264	149,460,220
	未払利息	5,196	5,514	6,180	4,529	5,199	5,556
	その他未払費用	596,436	553,252	561,434	509,262	541,696	509,516
(C) 純資産総額(A-B)		219,565,810,609	208,913,226,417	207,469,953,831	204,460,102,195	188,290,670,008	196,270,521,671
	元本	316,901,143,286	308,942,552,854	295,430,809,196	287,479,030,916	279,422,732,230	271,399,545,236
	次期繰越損益金	△ 97,335,332,677	△100,029,326,437	△ 87,960,855,365	△ 83,018,928,721	△ 91,132,062,222	△ 75,129,023,565
(D) 受益権総口数		316,901,143,286口	308,942,552,854口	295,430,809,196口	287,479,030,916口	279,422,732,230口	271,399,545,236口
	1万口当たり基準価額(C/D)	6,929円	6,762円	7,023円	7,112円	6,739円	7,232円

(注) 第60期首元本額は329,989,643,155円、第60～65期中追加設定元本額は6,909,732,808円、第60～65期中一部解約元本額は65,499,830,727円、1口当たり純資産額は、第60期0.6929円、第61期0.6762円、第62期0.7023円、第63期0.7112円、第64期0.6739円、第65期0.7232円です。

## ○損益の状況

項 目	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期
	2016年11月18日～ 2016年12月19日	2016年12月20日～ 2017年1月17日	2017年1月18日～ 2017年2月17日	2017年2月18日～ 2017年3月17日	2017年3月18日～ 2017年4月17日	2017年4月18日～ 2017年5月17日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,351,577,513	2,295,868,101	2,203,156,625	2,148,564,750	2,099,665,503	2,042,348,734
受取配当金	2,351,716,391	2,295,969,599	2,203,264,471	2,148,659,461	2,099,767,462	2,042,457,606
支払利息	△ 138,878	△ 101,498	△ 107,846	△ 94,711	△ 101,959	△ 108,872
(B) 有価証券売買損益	23,354,539,782	△ 5,740,985,467	7,109,411,367	1,994,215,284	△ 10,990,785,887	12,823,062,268
売買益	23,784,839,309	63,578,703	7,243,499,037	2,015,452,524	180,754,033	13,004,653,877
売買損	△ 430,299,527	△ 5,804,564,170	△ 134,087,670	△ 21,237,240	△ 11,171,539,920	△ 181,591,609
(C) 信託報酬等	△ 175,553,833	△ 162,843,253	△ 165,252,811	△ 149,895,427	△ 159,441,960	△ 149,969,736
(D) 当期損益金(A+B+C)	25,530,563,462	△ 3,607,960,619	9,147,315,181	3,992,884,607	△ 9,050,562,344	14,715,441,266
(E) 前期繰越損益金	△152,267,469,439	△124,511,436,923	△123,474,014,730	△112,281,259,570	△106,327,977,245	△113,042,535,876
(F) 追加信託差損益金	30,986,079,016	29,634,783,869	27,842,998,229	26,706,841,396	25,643,591,028	24,555,068,771
(配当等相当額)	( 208,802,825,188)	( 203,764,170,186)	( 195,026,369,046)	( 189,925,185,922)	( 184,723,620,602)	( 179,552,675,695)
(売買損益相当額)	(△177,816,746,172)	(△174,129,386,317)	(△167,183,370,817)	(△163,218,344,526)	(△159,080,029,574)	(△154,997,606,924)
(G) 計(D+E+F)	△ 95,750,826,961	△ 98,484,613,673	△ 86,483,701,320	△ 81,581,533,567	△ 89,734,948,561	△ 73,772,025,839
(H) 収益分配金	△ 1,584,505,716	△ 1,544,712,764	△ 1,477,154,045	△ 1,437,395,154	△ 1,397,113,661	△ 1,356,997,726
次期繰越損益金(G+H)	△ 97,335,332,677	△100,029,326,437	△ 87,960,855,365	△ 83,018,928,721	△ 91,132,062,222	△ 75,129,023,565
追加信託差損益金	30,986,079,016	29,634,783,869	27,842,998,229	26,706,841,396	25,643,591,028	24,555,068,771
(配当等相当額)	( 208,802,825,189)	( 203,764,170,188)	( 195,026,369,047)	( 189,925,185,923)	( 184,723,620,602)	( 179,552,675,695)
(売買損益相当額)	(△177,816,746,173)	(△174,129,386,319)	(△167,183,370,818)	(△163,218,344,527)	(△159,080,029,574)	(△154,997,606,924)
分配準備積立金	45,801,649,793	45,054,742,602	43,627,662,875	42,958,907,779	42,195,884,920	41,533,071,296
繰越損益金	△174,123,061,486	△174,718,852,908	△159,431,516,469	△152,684,677,896	△158,971,538,170	△141,217,163,632

\* 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(2016年11月18日～2017年5月17日)は以下の通りです。

項 目	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期
	2016年11月18日～ 2016年12月19日	2016年12月20日～ 2017年1月17日	2017年1月18日～ 2017年2月17日	2017年2月18日～ 2017年3月17日	2017年3月18日～ 2017年4月17日	2017年4月18日～ 2017年5月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	2,335,514,744円	2,133,025,276円	2,164,058,132円	2,070,829,326円	1,940,223,846円	2,021,743,152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	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	208,802,825,189円	203,764,170,188円	195,026,369,047円	189,925,185,923円	184,723,620,602円	179,552,675,695円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	45,050,640,765円	44,466,430,090円	42,940,758,788円	42,325,473,607円	41,652,774,735円	40,868,325,870円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	256,188,980,698円	250,363,625,554円	240,131,185,967円	234,321,488,856円	228,316,619,183円	222,442,744,717円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	8,084円	8,103円	8,128円	8,150円	8,170円	8,196円
g. 分配金	1,584,505,716円	1,544,712,764円	1,477,154,045円	1,437,395,154円	1,397,113,661円	1,356,997,726円
h. 分配金(1万円当たり)	50円	50円	50円	50円	50円	50円

## ○分配金のお知らせ

	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期
1万円当たり分配金（税込み）	50円	50円	50円	50円	50円	50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。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年5月17日現在）

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

下記は、野村マネー マザーファンド全体（18,894,740千口）の内容です。

## 国内公社債

## (A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	第65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	%	%	%	%	%
地方債証券	2,030,000 ( 2,030,000)	2,034,301 ( 2,034,301)	10.5 (10.5)	— (—)	— (—)	— (—)	10.5 (10.5)
特殊債券 (除く金融債)	2,630,000 ( 2,630,000)	2,634,019 ( 2,634,019)	13.7 (13.7)	— (—)	— (—)	— (—)	13.7 (13.7)
金融債券	3,420,000 ( 3,420,000)	3,422,483 ( 3,422,483)	17.7 (17.7)	— (—)	— (—)	— (—)	17.7 (17.7)
普通社債券 (含む投資法人債券)	6,190,000 ( 6,190,000)	6,204,226 ( 6,204,226)	32.2 (32.2)	— (—)	— (—)	— (—)	32.2 (32.2)
合 計	14,270,000 (14,270,000)	14,295,030 (14,295,030)	74.1 (74.1)	— (—)	— (—)	— (—)	74.1 (74.1)

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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	利 率	第65期末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
東京都 公募第647回	1.97	100,000	100,180	2017/6/20
神奈川県 公募第147回	1.98	1,500,000	1,502,725	2017/6/20
京都府 公募平成24年度第9回	0.14	30,000	30,038	2018/3/22
静岡県 公募平成19年度第2回	1.93	100,000	100,218	2017/6/28
福岡県 公募平成19年度第2回	2.01	100,000	100,177	2017/6/20
共同発行市場地方債 公募第52回	1.9	100,000	100,354	2017/7/25
共同発行市場地方債 公募第54回	1.7	100,000	100,605	2017/9/25
小 計		2,030,000	2,034,301	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	0.4	70,000	70,109	2017/9/27
福祉医療機構債券 第14回財投機関債	1.99	100,000	100,176	2017/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第5回	2.01	600,000	603,161	2017/8/21
東日本高速道路 第18回	0.387	130,000	130,187	2017/9/20
中日本高速道路社債 第53回	0.222	1,730,000	1,730,384	2017/6/20
小 計		2,630,000	2,634,019	
<b>金融債券</b>				
商工債券 利付第745回い号	0.35	200,000	200,085	2017/6/27
商工債券 利付第751回い号	0.25	20,000	20,032	2017/12/27
農林債券 利付第746回い号	0.35	700,000	700,464	2017/7/27
しんきん中金債券 利付第270回	0.35	100,000	100,014	2017/5/26
しんきん中金債券 利付第271回	0.35	300,000	300,138	2017/6/27
しんきん中金債券 利付第274回	0.3	1,000,000	1,001,140	2017/9/27
商工債券 利付(3年)第173回	0.2	500,000	500,137	2017/6/27
商工債券 利付(3年)第174回	0.15	200,000	200,073	2017/7/27
商工債券 利付(3年)第179回	0.14	400,000	400,396	2017/12/27
小 計		3,420,000	3,422,483	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
関西電力 第400回	3.1	100,000	100,825	2017/8/25
関西電力 第486回	0.821	796,000	797,188	2017/7/25
中国電力 第371回	0.575	100,000	100,056	2017/6/23
東北電力 第463回	0.72	194,000	194,143	2017/6/23
四国電力 第265回	1.79	100,000	100,479	2017/8/25
四国電力 第276回	0.592	100,000	100,209	2017/9/25
九州電力 第384回	1.47	300,000	300,419	2017/6/23
トヨタ自動車 第12回社債間限定同等特約付	0.317	500,000	500,550	2017/9/20
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	2.08	200,000	200,798	2017/7/28
みずほコーポレート銀行 第7回特定社債間限定同順位特約付	2.08	200,000	200,809	2017/7/27
みずほコーポレート銀行 第30回特定社債間限定同順位特約付	0.34	1,000,000	1,000,688	2017/7/25
三菱UFJ信託銀行 第1回特定社債間限定同順位特約付	0.345	100,000	100,024	2017/6/7
N T Tファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,018	2017/6/20
ホンダファイナンス 第19回社債間限定同順位特約付	0.372	200,000	200,083	2017/6/20
トヨタファイナンス 第49回社債間限定同等特約付	0.415	100,000	100,045	2017/6/20
リコーリース 第19回社債間限定同順位特約付	0.146	100,000	100,021	2017/7/11
日立キャピタル 第43回社債間限定同順位特約付	0.57	100,000	100,057	2017/6/20
三井住友ファイナンス&リース 第5回社債間限定同順位特約付	0.381	100,000	100,082	2017/7/31
三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付	0.487	300,000	300,059	2017/5/29

銘	柄	第65期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
三菱地所	第81回担保提供制限等財務上特約無	2.045	400,000	401,593	2017/7/28
東日本旅客鉄道	第7回社債間限定同順位特約付	3.3	600,000	605,341	2017/8/25
東日本旅客鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	1.86	100,000	100,642	2017/9/20
ポヨラ・バンク・ビーエルシー	第3回円貨社債(2014)	0.303	200,000	200,050	2017/6/16
ラボバンク・ネダーランド	第16回円貨社債(2012)(コー)	1.142	100,000	100,026	2017/5/25
ラボバンク・ネダーランド	第24回円貨社債(2014)(コー)	0.295	100,000	100,009	2017/5/22
小	計		6,190,000	6,204,226	
合	計		14,270,000	14,295,030	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

### 国内その他有価証券

区 分	第65期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 899,993	% 4.7

\*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの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。

Nomura Multi Managers Fund V – Global High Dividend Equity Premium

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデント・エクイティ・プレミアム

2016年9月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託								
投資目的	<ul style="list-style-type: none"> <li>◆世界の高配当株を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。</li> <li>◆高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。</li> <li>◆投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、高配当株や株式オプションの運用を行う運用会社を選定します(選定する運用会社は複数になる場合があります)。</li> </ul>								
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>●高配当株を上場市場や所在地、発行通貨等から、「米州」、「欧州」、「アジア・太平洋」の各地域に属する株式に分類します。</li> <li>●各地域の株式への投資比率は、原則として、下記の通りとします。</li> </ul> <table border="1" style="width: 100%; text-align: center;"> <thead> <tr> <th>地域名</th> <th>米州</th> <th>欧州</th> <th>アジア・太平洋</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>投資比率</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> </tr> </tbody> </table> <p>※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●為替にかかる含み損益の状況によっては、一時的に上記のような運用ができない場合があります。</li> <li>●高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。</li> <li>※市場環境によっては、株式オプションのコール売り以外のオプション取引を行う場合があります。</li> <li>●株式プレミアム戦略によってさらなる収益の獲得を目指しますが、株価が権利行使価格を上回って値上がりした局面では、収益の一部を享受できない場合があります。</li> <li>●米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が当該資産について、原則として対米ドルで為替取引を行います。</li> <li>●ファンドには2つのクラス(日本円クラス、通貨セレクトクラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、各クラスの通貨(通貨セレクトクラスについては、米ドル以外の選定通貨)で為替取引を行うことで、各通貨への投資効果を追求します。</li> </ul> <p>&lt;通貨セレクトクラスにおける通貨運用方針&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に(原則、毎月)見直すこととします。</li> <li>●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%～30%程度の範囲内に維持することを基本とします。</li> <li>●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。</li> <li>●投資顧問会社が、高配当株や株式オプションの運用を行う副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。</li> <li>●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、高配当株や株式オプションの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。</li> <li>●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およびファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行います。</li> <li>●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋	投資比率	25～50%	25～50%	25～50%
	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋					
投資比率	25～50%	25～50%	25～50%						
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								
管理事務代行会社 保管銀行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー								

※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。

※掲載している組入資産の明細および計算書等は、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデント・エクイティ・プレミアムの年次報告書から抜粋・邦訳したものです。

純資産計算書  
2016年9月30日現在  
(金額は米ドル表示)

資産		
投資有価証券時価		2, 326, 986, 933
(取得原価 : 2, 429, 663, 995米ドル)		
現金預金等		200, 939, 737
先物契約に係る評価差益		646, 853
デリバティブに係る委託証拠金		810, 423
ブローカーからの受取金		22, 344, 413
未収収益		4, 457, 245
現金および現金等価物に係る利息		2, 062
		2, 556, 187, 666
資産合計		2, 556, 187, 666
負債		
投資オプション契約時価(売り)		18, 495, 167
(取得原価 : 16, 023, 396米ドル)		
銀行借越金		319, 330
外国為替先渡し契約に係る評価差損		40, 986, 778
受益証券買戻支払金		12, 351, 616
ブローカーへの未払金		9, 091, 416
未払費用		6, 873, 406
		88, 117, 713
負債合計		88, 117, 713
純資産総額		2, 468, 069, 953

## 受益証券一口当たり情報 :

	期末1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス(円)	9, 775	652, 143	6, 374, 743, 758
通貨セレクトクラス(円)	3, 978	55, 345, 590	220, 175, 129, 656

**運用計算書**  
**2016年9月30日に終了する計測期間**  
*(金額は米ドル表示)*

収益	
銀行口座利息	675,056
債券利息	24,766
受取配当金等	85,373,577
	86,073,399
収益合計	86,073,399
費用	
投資顧問報酬	24,959,805
事務管理代行報酬	2,777,042
保管費用	834,262
源泉徴収税	9,238
当座借越利息	8,784
取引銀行報酬	467,503
銀行手数料	129,600
受託報酬	555,962
法務報酬	7,406
海外登記手数料	2,283
立替費用	555,298
専門家報酬	60,609
雑費用	22,363
	30,390,155
費用合計	30,390,155
純投資損益	55,683,244
投資有価証券売買に係る損益	(155,750,014)
先物契約に係る損益	3,828,412
オプション契約に係る損益	19,931,741
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	117,997,572
	(13,992,289)
当期実現純損益	(13,992,289)
投資有価証券評価損益の増減	283,921,205
先物契約に係る評価損益の増減	2,305,433
オプション契約に係る評価損益の増減	(13,943,628)
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	37,139,610
	309,422,620
当期評価差損益	309,422,620
運用の結果による純資産の増減額	351,113,575

純資産変動計算書  
2016年9月30日に終了する計測期間  
(金額は米ドル表示)

期首純資産総額	3,076,169,466
純投資損益	55,683,244
当期実現純損益	(13,992,289)
当期評価差損益	309,422,620
運用の結果による純資産の増減額	351,113,575
受益証券の発行手取金	485,872,261
受益証券の買戻支払金	(275,159,091)
	210,713,170
受益者への支払分配金	(1,169,926,258)
期末純資産総額	2,468,069,953

**発行済受益証券数の変動表**  
**2016年9月30日に終了する計測期間**  
*(未監査)*

## 日本円クラス

期首受益証券数	737,600
発行受益証券数	132,299
買戻受益証券数	(217,756)
	652,143
期末発行済受益証券数	652,143

## 通貨セレクトクラス

期首受益証券数	53,754,985
発行受益証券数	7,224,461
買戻受益証券数	(5,633,856)
	55,345,590
期末発行済受益証券数	55,345,590

**統計情報**  
**2016年9月30日現在**  
*(未監査)*

	2016	2015	2014
期末純資産総額(米ドル)	2,468,069,953	3,076,169,466	1,612,464,979
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	6,374,743,758	7,436,449,560	5,859,732,583
期末1口当たり純資産価格	9,775	10,082	11,492
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	220,175,129,656	334,146,275,354	146,257,277,005
期末1口当たり純資産価格	3,978	6,216	9,978

**組入資産明細**  
**2016年9月30日現在**  
(金額は米ドル表示)

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		<b>オーストラリア</b>			
コール ワラント					
	71,438	21ST CENTURY FOX/UBS INV WTS 22	2,178,090	1,749,966	0.07
			2,178,090	1,749,966	0.07
普通株式					
	554,448	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA *	34,620,280	30,524,010	1.23
	1,053,156	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING *	22,442,044	22,126,656	0.90
	763,164	WESTPAC BANKING CORP *	19,219,404	17,124,950	0.69
	717,468	NTL AUSTRALIA BANK LTD *	17,346,370	15,204,835	0.62
	771,916	BHP BILLITON (AUD) *	15,176,818	13,136,278	0.53
	294,436	RIO TINTO LTD	11,576,779	11,554,921	0.47
	178,070	MACQUARIE GROUP LTD	10,073,764	11,095,042	0.45
	1,153,208	TRANSURBAN GROUP	9,528,836	9,970,348	0.40
	2,508,753	TELSTRA CORPORATION LIMITED	11,409,169	9,881,659	0.40
	2,672,522	SCENTRE GROUP	8,768,829	9,551,275	0.39
	464,297	WOOLWORTHS LTD	8,817,975	8,215,509	0.33
	680,047	ARISTOCRAT LEISURE LTD	5,648,339	8,175,475	0.33
	188,200	WESFARMERS LIMITED	6,049,253	6,311,033	0.26
	77,253	CSL LTD	5,926,956	6,285,522	0.25
	239,702	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	6,149,038	6,242,729	0.25
	1,095,895	GOODMAN GROUP STAPLED	5,650,660	6,066,561	0.25
	1,232,838	THE STAR ENTERTAINMENT GROUP LTD	4,663,288	5,643,451	0.23
	668,167	TREASURY WINE ESTATES LTD	4,919,594	5,609,140	0.23
	784,557	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	6,141,470	5,542,203	0.22
	856,754	RESMED INC CDI	5,457,670	5,524,516	0.22
	1,063,074	BORAL LIMITED	5,044,336	5,456,441	0.22
	3,047,660	MIRVAC GROUP	4,689,366	5,191,068	0.21
	657,253	CHALLENGER LTD	4,351,770	5,082,715	0.21
	2,036,561	ORORA LTD	3,988,385	4,878,094	0.20
	1,206,108	AMP LIMITED	5,366,798	4,842,419	0.20
	1,675,601	SANTOS LTD	6,516,807	4,599,600	0.19
	2,428,529	MEDIBANK PRIVATE LTD	5,476,855	4,579,702	0.19
	2,117,609	INCITEC PIVOT LTD	5,139,518	4,540,849	0.18
	97,808	REA GROUP LTD	3,961,596	4,198,368	0.17
	240,821	NEWCREST MINING LTD	3,936,163	4,063,440	0.16
	963,315	INSURANCE AUSTRALIAN GROUP LTD	4,110,991	4,006,802	0.16
	157,789	JB HI-FI LTD	3,111,167	3,475,901	0.14
	83,435	IRON MOUNTAIN INC CDI	3,459,228	3,108,756	0.13
	537,630	DULUX GROUP LTD	2,609,858	2,698,172	0.11
	298,391	BANK OF QUEENSLAND LTD	2,481,858	2,579,814	0.10
	344,290	WESTFIELD CORP	2,660,141	2,547,296	0.10
	525,600	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	3,451,652	2,489,921	0.10
	108,590	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	2,915,897	2,363,207	0.10
	158,793	AGL ENERGY LTD	2,197,018	2,300,216	0.09
	951,365	QANTAS AIRWAYS LTD	2,646,616	2,257,065	0.09



	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	409,714	SYDNEY AIRPORT	2,131,273	2,171,480	0.09
	260,268	TPG TELECOM LTD	2,328,657	1,705,966	0.07
	448,452	STOCKLAND	1,608,305	1,623,174	0.07
	130,657	AMCOR LTD	1,473,139	1,505,177	0.06
	1,043,612	ALUMINA LTD	1,053,443	1,158,602	0.05
	117,582	SUNCORP GROUP LTD	1,147,029	1,082,748	0.04
	228,969	DOWNER EDI LIMITED	851,836	938,443	0.04
	29,352	ALS LTD	133,352	133,023	0.01
			308,429,590	299,364,572	12.13
		合計：オーストラリア	310,607,680	301,114,538	12.20
		<b>オーストリア</b>			
普通株式	234,837	VIENNA INSURANCE GROUP AG	8,726,080	4,681,115	0.19
			8,726,080	4,681,115	0.19
		合計：オーストリア	8,726,080	4,681,115	0.19
		<b>ベルギー</b>			
普通株式	968,316	AGEAS NV	33,441,723	34,801,899	1.41
	91,695	SOLVAY SA	11,719,455	10,533,949	0.43
			45,161,178	45,335,848	1.84
		合計：ベルギー	45,161,178	45,335,848	1.84
		<b>バミューダ諸島</b>			
普通株式	5,050,000	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE	3,406,903	3,458,190	0.13
	92,300	XL GROUP LTD	3,139,224	3,094,819	0.13
	720,000	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG LTD	2,490,709	2,971,293	0.12
	1,120,000	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	3,315,750	2,744,319	0.11
	3,500,000	TEXWINCA HOLDINGS LTD	3,768,899	2,419,334	0.10
	2,300,780	COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	3,164,221	2,358,877	0.10
			19,285,706	17,046,832	0.69
		合計：バミューダ諸島	19,285,706	17,046,832	0.69
		<b>ブラジル</b>			
普通株式	467,400	ITAU UNIBANCO HOLDING SA SP ADR	4,242,851	5,080,638	0.20
	442,100	PETROLEO BRASILEIRO S.A ADR	3,778,904	4,146,898	0.17
	268,040	BANCO BRADESCO SPONSORED ADR	1,751,544	2,420,401	0.10
			9,773,299	11,647,937	0.47
		合計：ブラジル	9,773,299	11,647,937	0.47

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		<b>カナダ</b>			
普通株式	41,500	MAGNA INTERNATIONAL INC (USD)	2,109,988	1,754,620	0.07
			2,109,988	1,754,620	0.07
		合計：カナダ	2,109,988	1,754,620	0.07
		<b>ケイマン諸島</b>			
普通株式	365,000	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	4,331,298	4,641,226	0.18
	3,300,000	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS LTD	4,351,865	4,281,292	0.16
	3,050,000	SHIMAO PROPERTY HOLDING LTD	6,513,881	4,130,020	0.17
	460,000	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	3,081,588	3,357,664	0.14
	14,282,000	CHINA DONGXIANG GROUP CO	2,970,888	2,818,016	0.11
	630,000	SANDS CHINA LTD	3,175,740	2,733,938	0.11
	3,400,000	NAGACORP LTD	2,551,282	2,236,207	0.09
	1,300,000	STELLA INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,293,876	2,216,347	0.09
	1,800,000	LEE & MAN MANUFACT LTD (HKD)	1,418,436	1,634,211	0.07
	2,100,000	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1,443,920	1,378,479	0.06
	1,900,000	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,060,313	1,132,032	0.05
	1,630,000	WASION GROUP HOLDINGS LTD	1,615,828	887,081	0.04
			35,808,915	31,446,513	1.27
		合計：ケイマン諸島	35,808,915	31,446,513	1.27
		<b>中国</b>			
普通株式	14,200,000	CHINA PETROL & CHEM CORP SINOPEC H	10,309,881	10,346,650	0.41
	14,500,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	9,420,872	9,069,278	0.37
	12,200,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	9,186,396	9,046,710	0.37
	16,200,000	BANK OF CHINA LTD H	7,406,094	7,395,734	0.30
	2,150,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	2,391,156	2,972,325	0.12
	2,720,000	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD H	2,771,249	2,869,361	0.12
	6,500,000	AGRICULTURAL BANK OF CHINA H	3,005,833	2,783,008	0.11
	600,000	CHINA PACIFIC INSURANCE CO LTD H	2,156,360	2,216,863	0.09
	1,985,000	ANHUI EXPRESSWAY CO LTD H	1,175,738	1,651,137	0.07
			47,823,579	48,351,066	1.96
		合計：中国	47,823,579	48,351,066	1.96
		<b>チェコ</b>			
普通株式	47,231	PHILIP MORRIS CR AS	23,314,808	24,280,677	0.98
			23,314,808	24,280,677	0.98
		合計：チェコ	23,314,808	24,280,677	0.98

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		デンマーク			
普通株式	413,749	D/S NORDEN AS	9,060,279	5,899,700	0.24
			9,060,279	5,899,700	0.24
		合計：デンマーク	9,060,279	5,899,700	0.24
		フィンランド			
普通株式	691,038	FORTUM OYJ	10,216,033	11,077,027	0.45
	595,800	NOKIA CORP-SPON ADR	4,115,758	3,437,766	0.14
			14,331,791	14,514,793	0.59
		合計：フィンランド	14,331,791	14,514,793	0.59
		フランス			
普通株式	609,571	BNP PARIBAS	34,244,920	30,591,944	1.23
	794,056	ALSTOM	24,774,126	20,869,003	0.85
	389,803	CIE DE SAINT GOBAIN	16,937,285	16,667,397	0.68
	160,146	SANOFI	14,773,003	12,068,624	0.49
	1,558,961	COFACE SA	13,328,728	11,160,672	0.45
	2,439,971	VALLOUREC	20,847,446	10,898,308	0.44
	143,265	VINCI SA	8,893,444	10,884,611	0.44
			133,798,952	113,140,559	4.58
		合計：フランス	133,798,952	113,140,559	4.58
		ドイツ			
普通株式	657,871	BILFINGER BERGER AG	33,314,154	21,436,621	0.86
	159,683	BASF SE	13,824,012	13,471,635	0.55
	667,353	DEUTSCHE TELEKOM AG	11,058,366	11,051,956	0.45
	121,640	DAIMLER AG	9,544,185	8,425,244	0.34
			67,740,717	54,385,456	2.20
		合計：ドイツ	67,740,717	54,385,456	2.20
		香港			
普通株式	745,000	CHINA MOBILE LTD	9,870,043	9,016,824	0.36
	960,000	AIA GROUP LTD	5,412,411	6,382,089	0.26
	3,850,800	HKT TRUST AND HKT LTD	5,052,399	5,422,962	0.22
	1,230,000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,883,723	4,155,941	0.17
	260,000	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	3,311,107	3,926,388	0.16
			27,529,683	28,904,204	1.17
		合計：香港	27,529,683	28,904,204	1.17

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		<b>アイルランド</b>			
普通株式	109,940	MEDTRONIC PLC	6,960,864	9,421,858	0.39
	342,940	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	5,191,211	5,298,880	0.21
			<u>12,152,075</u>	<u>14,720,738</u>	<u>0.60</u>
		合計：アイルランド	<u>12,152,075</u>	<u>14,720,738</u>	<u>0.60</u>
		<b>イタリア</b>			
普通株式	6,246,595	INTESA SANPAOLO RSP	15,889,691	12,766,064	0.52
	1,486,625	SNAM SPA	7,746,747	8,198,294	0.33
	501,867	ENI SPA	9,549,227	7,202,618	0.29
			<u>33,185,665</u>	<u>28,166,976</u>	<u>1.14</u>
		合計：イタリア	<u>33,185,665</u>	<u>28,166,976</u>	<u>1.14</u>
		<b>日本</b>			
普通株式	670,000	NISSAN MOTOR CO LTD	6,434,084	6,524,713	0.25
	160,000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	5,388,565	5,359,229	0.21
	130,000	JAPAN TOBACCO INC	4,327,024	5,306,410	0.21
	1,050,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	5,649,681	5,255,722	0.21
	380,000	ITOCHU CORP	4,603,976	4,752,353	0.19
	170,000	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	3,584,679	4,642,106	0.19
	122,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	4,005,412	4,635,298	0.19
	93,000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	4,399,640	4,444,940	0.18
	170,000	NTT DOCOMO	3,140,812	4,316,122	0.17
	175,000	KOMATSU LTD	3,664,580	3,980,031	0.16
	87,000	NIPPON TELG & TEL CORP NTT	2,756,543	3,977,979	0.16
	135,000	SOMPO HOLDINGS INC	3,876,979	3,967,321	0.16
	173,000	MITSUBISHI CORP	3,352,532	3,917,401	0.16
	230,000	ASTELLAS PHARMA INC	3,109,800	3,586,413	0.15
	62,000	TOYOTA MOTOR CORP	3,884,870	3,550,668	0.14
	175,000	SEIKO EPSON CORP	2,965,950	3,350,510	0.14
	88,500	FUJI HEAVY INDUSTRIES LTD	3,013,444	3,293,206	0.13
	105,000	KDDI CORP	2,231,388	3,241,254	0.13
	220,000	SUMITOMO ELECTRIC IND LTD	2,840,166	3,087,107	0.13
	18,500	DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD	2,128,604	2,965,389	0.12
	65,000	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	2,076,251	2,955,950	0.12
	590,000	YAMADA DENKI CO LTD	3,021,709	2,923,396	0.12
	36,500	LAWSON INC	2,675,480	2,882,816	0.12
	225,000	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	2,597,466	2,859,602	0.12
	113,000	DAIICHI SANKYO CO LTD	2,501,148	2,704,340	0.11

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
185,000	MITSUI & CO LTD	2,550,085	2,549,226	0.10
190,000	TOHOKU ELEC POWER CO INC	2,401,963	2,475,968	0.10
33,000	SECOM CO LTD	1,960,516	2,455,296	0.10
43,000	KAO CORP	2,072,407	2,425,061	0.10
140,000	SEKISUI HOUSE LTD	1,855,713	2,373,798	0.10
110,000	LIXIL GROUP CORPORATION	1,912,495	2,351,303	0.10
26,000	TOKYO ELECTRON LTD	1,591,450	2,287,206	0.09
560,000	JX HOLDINGS INC	2,452,203	2,259,201	0.09
540,000	MITSUBISHI HEAVY IND LTD	2,845,239	2,242,731	0.09
340,000	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	1,737,723	2,116,618	0.09
180,000	ISUZU MOTORS LTD	2,249,185	2,103,954	0.09
235,000	KONICA MINOLTA INC	2,810,645	1,979,486	0.08
210,000	MINEBEA CO LTD	1,658,695	1,964,522	0.08
1,170,000	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	2,119,221	1,954,831	0.08
60,000	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	2,277,835	1,944,306	0.08
440,000	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	1,923,797	1,940,342	0.08
475,000	YAHOO JAPAN CORP	2,092,566	1,892,280	0.08
14,300	MURATA MANUFACTURING CO LTD	1,686,379	1,846,487	0.07
180,000	PANASONIC CORP	1,581,192	1,787,335	0.07
400,000	TOKYO GAS CO LTD	1,733,282	1,774,254	0.07
62,000	HONDA MOTOR CO LTD	2,036,666	1,774,105	0.07
140,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	1,862,512	1,757,804	0.07
195,000	INPEX CORP	1,545,286	1,756,951	0.07
35,000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	1,312,354	1,649,935	0.07
355,000	HITACHI LTD	2,271,470	1,648,528	0.07
390,000	RESONA HOLDINGS INC	1,858,057	1,632,117	0.07
350,000	NIPPON EXPRESS	1,601,460	1,630,165	0.07
170,000	HASEKO CORP	1,664,952	1,625,706	0.07
110,000	ORIX CORP	1,500,502	1,610,593	0.07
44,000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	1,286,568	1,584,976	0.06
600,000	SOJITZ CORPORATION	1,423,051	1,528,094	0.06
54,000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	1,376,708	1,492,746	0.06
24,000	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	1,397,219	1,483,619	0.06
430,000	AOZORA BANK LTD	1,514,903	1,478,644	0.06
185,000	ASAHI KASEI CORPORATION	1,177,922	1,468,120	0.06
60,000	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT CO	1,823,989	1,437,716	0.06
66,000	MITSUBISHI TANABE PHARMA CORP	1,205,563	1,409,473	0.06
260,000	FUJITSU LTD	1,020,752	1,391,339	0.06
320,000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	1,565,910	1,322,366	0.05
200,000	ASAHI GLASS CO LTD	1,189,146	1,288,276	0.05
44,000	CANON INC	1,390,260	1,274,740	0.05
60,000	HITACHI CAPITAL	1,209,515	1,266,475	0.05
125,000	TONENGENERAL SEKIYU K. K	1,119,883	1,263,502	0.05
35,000	OMRON CORP	1,069,340	1,250,371	0.05
85,000	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	949,476	1,208,750	0.05
460,000	NEC CORP	1,253,421	1,180,656	0.05
364,000	SEVEN BANK LTD	1,299,508	1,161,510	0.05
71,000	KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD	1,132,290	1,115,905	0.05
95,000	HAKUHODO DY HOLDINGS INC	1,062,284	1,109,008	0.04
23,000	OTSUKA CORP	1,041,834	1,088,346	0.04
96,000	T&D HOLDINGS INC	1,145,292	1,074,541	0.04

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	70,000	CHUBU ELEC POWER CO INC	999,869	1,016,946	0.04
	28,500	SANKYO CO LTD, GUNMA	1,053,111	971,559	0.04
	77,000	JAPAN POST HOLDINGS CO LTD	1,193,101	963,740	0.04
	73,000	MARUI GROUP CO LTD	1,015,636	960,697	0.04
	170,000	CHIBA BANK LTD	864,885	960,261	0.04
	47,000	NIPPON PAPER INDUSTRIES CO LTD	834,141	857,467	0.03
	70,000	HITACHI METALS LTD	817,587	854,623	0.03
	40,000	RESORTTRUST INC	842,594	811,812	0.03
	270,000	TAIHEIYO CEMENT CORP	702,942	773,263	0.03
	26,000	JAPAN AIRLINES	861,212	762,402	0.03
	42,000	USS CO LTD	654,551	706,729	0.03
	70,000	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	670,360	683,976	0.03
	54,000	DAICEL CORP	665,419	678,010	0.03
	160,000	OSAKA GAS CO LTD	639,320	669,270	0.03
	19,000	TREND MICRO INC	701,457	660,886	0.03
	13,500	AISIN SEIKI CO LTD	530,916	614,731	0.02
	16,500	AOYAMA TRADING CO LTD	588,986	569,022	0.02
	30,000	JSR CORPORATION	535,688	469,428	0.02
	70,000	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	378,652	378,060	0.02
			<u>187,601,894</u>	<u>199,532,440</u>	<u>8.08</u>
		合計：日本	<u>187,601,894</u>	<u>199,532,440</u>	<u>8.08</u>
		ジャージー			
普通株式	96,627	HENDERSON GROUP PLC CDI	388,734	280,675	0.01
			<u>388,734</u>	<u>280,675</u>	<u>0.01</u>
		合計：ジャージー	<u>388,734</u>	<u>280,675</u>	<u>0.01</u>
		ルクセンブルク			
普通株式	509,868	TENARIS SA	7,251,604	7,197,675	0.29
			<u>7,251,604</u>	<u>7,197,675</u>	<u>0.29</u>
		合計：ルクセンブルク	<u>7,251,604</u>	<u>7,197,675</u>	<u>0.29</u>
		マレーシア			
普通株式	1,750,030	MALAYAN BANKING BHD MAYBANK	4,508,585	3,167,661	0.13
			<u>4,508,585</u>	<u>3,167,661</u>	<u>0.13</u>
		合計：マレーシア	<u>4,508,585</u>	<u>3,167,661</u>	<u>0.13</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		<b>オランダ</b>			
普通株式	479,020	RELX NV	7,178,500	8,567,956	0.35
	287,757	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	5,958,533	6,505,300	0.26
	142,900	AKZO NOBEL NV SPON ADR	3,394,054	3,200,960	0.13
	46,100	UNILEVER NV NY SHS	2,095,297	2,115,990	0.09
			<u>18,626,384</u>	<u>20,390,206</u>	<u>0.83</u>
		合計：オランダ	<u>18,626,384</u>	<u>20,390,206</u>	<u>0.83</u>
		<b>ノルウェー</b>			
普通株式	1,079,149	DNB ASA	15,948,964	13,932,957	0.56
	400,272	STATOIL ASA	8,033,897	6,639,533	0.27
			<u>23,982,861</u>	<u>20,572,490</u>	<u>0.83</u>
		合計：ノルウェー	<u>23,982,861</u>	<u>20,572,490</u>	<u>0.83</u>
		<b>ポーランド</b>			
普通株式	21,918,514	ORANGE POLSKA SA	53,153,985	34,125,173	1.38
	2,221,231	PGE POLSKA GRUPA ENER SA	11,124,745	5,875,012	0.24
			<u>64,278,730</u>	<u>40,000,185</u>	<u>1.62</u>
		合計：ポーランド	<u>64,278,730</u>	<u>40,000,185</u>	<u>1.62</u>
		<b>韓国</b>			
普通株式	140,000	DONGBU INSURANCE CO LTD	6,746,814	8,663,301	0.35
	27,000	MANDO CORP	3,610,687	6,051,063	0.25
	630,000	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	4,313,849	5,036,019	0.20
	20,500	POSCO	3,746,817	4,222,315	0.17
	46,000	HYUNDAI MOTOR CO LTD PFD NON-VOTING	4,193,523	4,194,641	0.17
	82,000	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,519,149	4,017,710	0.16
	35,000	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	2,724,509	3,969,620	0.16
	17,700	LG CHEM LTD PREFERENCE	3,443,185	2,641,862	0.11
	74,000	KANGWON LAND INC	2,216,300	2,638,731	0.11
	53,000	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,744,774	1,930,778	0.08
	3,400	SK TELECOM CO LTD	860,667	697,201	0.03
			<u>38,120,274</u>	<u>44,063,241</u>	<u>1.79</u>
		合計：韓国	<u>38,120,274</u>	<u>44,063,241</u>	<u>1.79</u>
		<b>ルーマニア</b>			
投資信託	116,055,067	SC FONDUL PROPRIETATEA SA ETF	21,985,550	23,333,354	0.95
			<u>21,985,550</u>	<u>23,333,354</u>	<u>0.95</u>
		合計：ルーマニア	<u>21,985,550</u>	<u>23,333,354</u>	<u>0.95</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		ロシア			
普通株式					
	1,541,318	M VIDEO	8,222,683	8,085,087	0.33
			8,222,683	8,085,087	0.33
		合計：ロシア	8,222,683	8,085,087	0.33
		シンガポール			
普通株式					
	4,270,000	COMFORTDELGRO CORP LTD	8,881,592	8,786,392	0.35
	2,700,000	SINGAPORE TELECOM 1000	8,163,697	7,849,294	0.32
	602,451	DBS GROUP HOLDING LTD	7,860,762	6,789,482	0.28
	3,350,000	CAPITALAND MALL TRUST REITS	4,842,097	5,323,299	0.22
	292,766	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	4,821,226	4,036,893	0.16
	459,988	OVERSEAS CHINESE BANKING CORP LTD	2,722,707	2,913,660	0.12
	1,465,948	FRASERS COMMERCIAL TRUST	1,616,691	1,508,243	0.06
			38,908,772	37,207,263	1.51
		合計：シンガポール	38,908,772	37,207,263	1.51
		スペイン			
普通株式					
	1,673,660	ENDESA	36,931,531	35,608,433	1.44
			36,931,531	35,608,433	1.44
		合計：スペイン	36,931,531	35,608,433	1.44
		スウェーデン			
普通株式					
	969,460	SWEDBANK AB A SHARES	22,233,289	22,478,961	0.91
	212,190	ERICSSON (LM)TELEFON SP ADR	2,465,662	1,521,402	0.06
			24,698,951	24,000,363	0.97
		合計：スウェーデン	24,698,951	24,000,363	0.97
		スイス			
普通株式					
	236,864	SWISS RE AG	19,947,686	21,268,328	0.86
	122,401	NOVARTIS AG	10,280,435	9,611,985	0.39
			30,228,121	30,880,313	1.25
		合計：スイス	30,228,121	30,880,313	1.25



	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		台湾			
普通株式					
	3,410,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	14,824,194	19,855,807	0.81
	4,000,000	PRIMAX ELECTRONICS LTD	4,715,077	5,864,295	0.24
	1,200,000	CHUNGHWA TELECOM CO LTD (TWD)	3,874,262	4,230,716	0.17
	1,060,000	TONG HSING ELECTRONIC INDUSTRIES LT	2,815,919	4,007,694	0.16
	1,210,000	TAIWAN SECOCOM	3,460,538	3,517,014	0.14
	2,700,000	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENG INC	3,363,127	3,239,082	0.13
	2,620,000	WPG HOLDINGS CO LTD	3,133,360	3,101,312	0.13
	540,000	MERIDA INDUSTRY CO LTD	2,718,269	2,549,916	0.10
	2,950,000	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,127,357	2,075,396	0.08
	41,000	ST SHINE OPTICAL CO LTD	509,061	953,634	0.04
	787,500	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,501,770	871,867	0.04
	50,665	MAKALOT INDUSTRIAL CO LTD	337,338	242,476	0.01
			43,380,272	50,509,209	2.05
		合計：台湾	43,380,272	50,509,209	2.05
		タイ			
普通株式					
	2,430,000	PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC CO LTD F	4,157,870	4,114,044	0.16
	14,000,000	LAND AND HOUSE PLC NVDR	3,472,586	3,610,819	0.15
	8,400,000	DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F	2,939,042	3,582,578	0.15
			10,569,498	11,307,441	0.46
		合計：タイ	10,569,498	11,307,441	0.46
		トルコ			
普通株式					
	3,807,474	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	10,372,435	7,209,966	0.29
			10,372,435	7,209,966	0.29
		合計：トルコ	10,372,435	7,209,966	0.29
		イギリス			
普通株式					
	6,850,655	HSBC HOLDINGS PLC (GBP)	60,701,265	51,052,107	2.07
	15,280,544	CENTRICA PLC	61,272,063	45,193,000	1.83
	16,010,523	TESCO PLC	49,308,303	37,452,408	1.52
	11,784,145	MORRISON WM SUPERMARKETS PLC	33,984,895	32,944,808	1.33
	4,391,764	BP PLC	28,839,238	25,591,030	1.04
	392,940	NIELSEN HOLDINGS PLC	18,051,690	21,057,655	0.85
	6,889,027	VODAFONE GROUP PLC (NEW)	23,120,618	19,723,450	0.80
	6,803,485	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	23,495,066	19,152,577	0.78
	2,686,463	BAE SYSTEMS PLC	19,483,971	18,158,820	0.74
	3,957,609	ASHMORE GROUP PLC	14,855,877	18,028,723	0.73

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	1,410,419	PEARSON PLC	16,733,956	13,871,141	0.56
	4,945,757	RBS GROUP	19,182,791	11,271,500	0.46
	231,963	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,206,654	1,091,841	0.04
			370,236,387	314,589,060	12.75
		合計：イギリス	370,236,387	314,589,060	12.75
		<b>アメリカ</b>			
<b>投資信託</b>	93,150	ISHARES MSCI CANADA ETF	2,615,062	2,396,749	0.10
			2,615,062	2,396,749	0.10
<b>普通株式</b>	633,940	QUALCOMM INC *	39,951,460	44,109,544	1.79
	1,284,770	CISCO SYSTEMS INC *	32,897,629	40,566,613	1.64
	595,771	JPMORGAN CHASE & CO *	33,957,483	39,481,744	1.60
	827,590	CITIGROUP INC *	43,026,130	38,333,969	1.55
	1,036,900	PFIZER INC *	31,843,771	34,870,947	1.41
	490,520	APACHE CORP	32,468,361	31,618,919	1.28
	551,400	DISCOVER FINANCIAL SERVICES *	32,469,750	30,977,652	1.26
	253,660	APPLE INC	27,747,944	28,625,531	1.16
	1,649,240	MARATHON OIL CORP	39,866,066	26,379,594	1.07
	481,000	VERIZON COMMUNICATIONS INC	23,379,914	25,214,020	1.02
	1,835,460	AES CORP *	23,186,892	23,796,739	0.96
	316,100	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP *	24,845,427	22,405,168	0.91
	620,700	EXELON CORP	20,274,551	20,700,345	0.84
	326,100	MERCK & CO INC *	17,181,291	20,329,074	0.82
	420,300	BAXTER INTL INC *	16,394,840	19,779,318	0.80
	235,540	GILEAD SCIENCES INC	20,874,808	18,544,064	0.75
	104,970	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,471,981	13,587,317	0.55
	494,300	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC	12,448,656	13,504,276	0.55
	266,200	DEVON ENERGY CORP	6,584,748	11,537,108	0.47
	376,710	GULFPORT ENERGY CORP	15,139,408	10,434,867	0.42
	77,700	LEAR CORP	6,992,593	9,300,690	0.38
	134,560	NASDAQ INC	6,278,816	9,137,970	0.37
	297,900	KROGER CO	8,191,815	8,877,420	0.36
	156,780	VALERO ENERGY CORP	7,955,555	8,188,619	0.33
	123,100	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,722,098	7,864,859	0.32
	183,250	MARATHON PETROLEUM CORP	7,407,273	7,335,498	0.30
	89,150	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	7,098,826	7,195,297	0.29
	312,060	STARWOOD PROPERTY TRUST INC	7,494,630	7,030,712	0.28
	174,160	ORACLE CORP	6,692,455	6,830,555	0.28
	365,090	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	7,083,169	6,352,566	0.26
	75,100	OMNICOM GROUP INC	5,536,450	6,349,705	0.26
	503,550	DYNEGY INC	9,667,156	5,987,210	0.24
	87,800	COMCAST CORP A	5,061,253	5,824,652	0.24
	107,940	NEWELL BRANDS INC	3,662,523	5,619,356	0.23
	125,530	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	4,806,326	5,345,067	0.22
	439,000	KEYCORP	5,963,527	5,285,560	0.21
	40,070	BOEING CO	4,962,068	5,271,609	0.21

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
235,180	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,704,506	5,228,051	0.21
620,300	SLM CORP	5,336,050	4,577,814	0.19
316,500	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	4,792,326	4,499,048	0.18
55,600	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	4,570,501	4,412,972	0.18
185,300	TERADYNE INC	3,552,163	3,970,979	0.16
136,600	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,477,816	3,823,434	0.15
31,800	UNITED PARCEL SERVICE INC B	3,084,164	3,458,886	0.14
60,100	CROWN HOLDINGS	3,115,283	3,417,887	0.14
41,500	RELIANCE STEEL & ALUMINIUM	2,700,742	2,986,340	0.12
139,090	GNC HOLDINGS INC A	5,658,240	2,779,018	0.11
38,000	LOWE'S COMPANIES INC	2,363,664	2,713,960	0.11
35,100	TUPPERWARE BRANDS CORP	2,709,763	2,271,321	0.09
72,230	AECOM	2,180,659	2,129,340	0.09
43,680	LINCOLN NATIONAL CORP	2,351,947	2,011,901	0.08
21,200	CVS HEALTH CORPORATION *	1,704,732	1,877,260	0.08
192,500	REGIONS FINANCIAL CORP	1,895,850	1,873,025	0.08
15,700	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,491,479	1,825,753	0.07
19,910	THOR INDUSTRIES INC	1,099,204	1,700,911	0.07
46,900	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,073,124	1,696,842	0.07
33,900	TOTAL SYSTEM SERVICE INC	1,210,992	1,585,503	0.06
10,900	DUN & BRADSTREET CORP	1,055,449	1,473,026	0.06
18,800	AVERY DENNISON CORP	1,157,714	1,452,864	0.06
18,100	PACKAGING CORP OF AMERICA	1,285,149	1,449,448	0.06
11,100	PPG INDUSTRIES INC	1,183,845	1,144,521	0.05
36,200	CSX CORP	1,017,611	1,093,240	0.04
16,100	DARDEN RESTAURANTS INC	1,058,132	975,821	0.04
6,800	RAYTHEON CO	614,641	918,952	0.04
52,380	ARES CAPITAL CORP	882,907	814,509	0.03
17,000	APPLIED MATERIALS INC	428,976	506,770	0.02
		<u>686,345,272</u>	<u>701,263,550</u>	<u>28.41</u>
	合計：アメリカ	<u>688,960,334</u>	<u>703,660,299</u>	<u>28.51</u>
	<b>組入資産合計</b>	<b><u>2,429,663,995</u></b>	<b><u>2,326,986,933</u></b>	<b><u>94.28</u></b>

\* 部分的にデリバティブの担保として差し入れられている証券

## 財務書類に関する注記

2016年9月30日現在

(購入金額、売却金額、契約数は通貨を欄左側に表示)

## 注記1-外国為替先渡し契約

2016年9月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	38,535,931	SGD	52,000,000	2016年10月7日	455,334
JPY	13,388,981	USD	132,079	2016年10月11日	666
JPY	2,770,679	USD	26,870	2016年10月11日	600
JPY	1,866,862	USD	18,054	2016年10月11日	454
JPY	4,173,449	USD	41,170	2016年10月11日	208
JPY	149,841	USD	1,465	2016年10月11日	20
JPY	174,736	USD	1,720	2016年10月25日	13
JPY	174,832	USD	1,720	2016年10月11日	13
JPY	89,888	USD	883	2016年10月11日	8
USD	63,948,840	HKD	496,000,000	2016年10月28日	(34,009)
USD	189,873,417	MXN	3,600,000,000	2016年10月27日	6,958,431
ZAR	2,112,000,000	USD	146,591,335	2016年11月22日	2,693,629
INR	14,720,000,000	USD	218,243,819	2016年10月27日	1,490,893
USD	11,095,723	ZAR	150,000,000	2016年10月27日	438,115
ZAR	269,000,000	USD	18,814,049	2016年10月27日	298,596
USD	11,190,903	ZAR	155,000,000	2016年10月27日	178,041
MXN	370,000,000	USD	18,580,453	2016年11月22日	166,449
USD	10,634,408	TRY	32,000,000	2016年10月27日	44,716
USD	7,124,304	INR	480,000,000	2016年10月27日	(40,958)
TRY	675,200,000	USD	223,930,592	2016年10月27日	(488,072)
INR	14,273,000,000	USD	212,633,147	2016年11月22日	(538,260)
MXN	370,000,000	USD	19,961,048	2016年10月27日	(1,161,453)
TRY	358,200,000	USD	119,475,667	2016年11月22日	(1,584,706)
MXN	710,000,000	USD	38,265,443	2016年10月27日	(2,190,543)
MXN	1,490,000,000	USD	78,433,436	2016年11月22日	(2,939,155)
MXN	3,600,000,000	USD	189,468,698	2016年11月22日	(7,066,405)
ZAR	3,082,000,000	USD	227,207,383	2016年10月27日	(8,229,051)
BRL	1,837,400,000	USD	566,242,411	2016年11月3日	(8,249,264)
MXN	7,600,000,000	USD	411,712,126	2016年10月27日	(25,558,264)
JPY	3,058,055,601	USD	29,566,506	2016年10月11日	752,570
JPY	3,038,089,470	USD	29,855,480	2016年10月25日	283,708
USD	363,550	JPY	36,488,649	2016年10月11日	1,784
USD	363,550	JPY	36,469,926	2016年10月25日	1,753
USD	92,692	JPY	9,303,282	2016年10月11日	455
USD	92,692	JPY	9,298,508	2016年10月25日	447
USD	67,082	JPY	6,818,470	2016年10月11日	(519)
USD	67,082	JPY	6,814,713	2016年10月25日	(522)
USD	102,286	JPY	10,458,874	2016年10月11日	(1,408)
USD	85,333	JPY	8,800,625	2016年10月11日	(1,920)
USD	140,993	JPY	14,463,893	2016年10月11日	(2,409)

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	108,369	JPY	11,176,397	2016年10月11日	(2,439)
USD	266,732	JPY	27,154,041	2016年10月11日	(2,487)
USD	297,124,649	GBP	223,247,565	2016年10月13日	7,967,893
USD	317,995,209	EUR	282,766,718	2016年10月13日	1,498,841
USD	321,898,525	AUD	422,500,000	2016年10月31日	871,413
USD	17,286,709	SEK	146,737,163	2016年10月13日	229,829
USD	9,474,590	MYR	38,500,000	2016年10月7日	186,823
USD	7,218,241	TRY	21,317,374	2016年10月13日	143,023
NOK	21,833,078	USD	2,619,398	2016年10月13日	83,381
USD	38,160,656	SGD	52,000,000	2016年11月10日	71,948
TWD	127,000,000	USD	4,010,737	2016年10月14日	42,835
USD	2,241,484	SEK	18,919,292	2016年10月13日	42,287
USD	3,441,756	MYR	14,200,000	2016年12月2日	26,215
TRY	2,489,402	USD	800,047	2016年10月13日	26,183
USD	4,957,393	EUR	4,406,863	2016年10月13日	24,860
USD	741,843	TRY	2,181,963	2016年10月13日	17,652
USD	2,003,050	PLN	7,671,922	2016年10月13日	16,236
USD	11,509,504	THB	399,000,000	2016年12月2日	15,810
CHF	2,763,812	USD	2,846,614	2016年10月13日	11,360
USD	2,106,185	RON	8,343,352	2016年10月13日	11,298
MYR	8,300,000	USD	1,993,993	2016年10月7日	8,304
USD	822,895	TRY	2,460,983	2016年10月13日	6,097
USD	526,172	DKK	3,463,556	2016年10月13日	5,969
THB	23,000,000	USD	657,964	2016年10月7日	4,771
USD	65,531,053	HKD	508,000,000	2016年10月21日	4,739
USD	1,805,250	SEK	15,509,589	2016年10月13日	2,400
USD	1,646,281	CZK	39,743,010	2016年10月13日	472
USD	753,396	DKK	5,015,529	2016年10月13日	97
DKK	3,561,953	USD	535,451	2016年10月13日	(470)
CHF	1,724,007	USD	1,785,344	2016年10月13日	(2,601)
USD	794,342	DKK	5,306,599	2016年10月13日	(2,673)
PLN	8,206,276	USD	2,128,308	2016年10月13日	(3,112)
USD	2,094,745	CHF	2,034,513	2016年10月13日	(9,083)
USD	817,724	RUB	52,833,190	2016年10月13日	(13,151)
USD	2,434,845	KRW	2,700,000,000	2016年10月21日	(14,583)
USD	823,909	RUB	53,323,405	2016年10月13日	(14,676)
MYR	3,000,000	USD	738,825	2016年10月7日	(15,103)
USD	2,684,206	CHF	2,613,666	2016年10月13日	(18,506)
THB	389,000,000	USD	11,227,523	2016年10月7日	(18,658)
MYR	14,200,000	USD	3,446,601	2016年10月7日	(20,984)
USD	3,181,112	PLN	12,370,597	2016年10月13日	(22,528)
MYR	3,000,000	USD	746,733	2016年10月7日	(23,011)
USD	4,954,139	DKK	33,162,313	2016年10月13日	(26,622)
USD	11,838,400	THB	412,000,000	2016年10月7日	(33,200)
USD	2,222,910	CZK	54,506,996	2016年10月13日	(34,294)
USD	2,128,894	RON	8,636,855	2016年10月13日	(39,687)
MYR	10,000,000	USD	2,478,069	2016年10月7日	(65,662)
USD	2,106,597	PLN	8,403,148	2016年10月13日	(69,584)
SGD	52,000,000	USD	38,156,736	2016年10月7日	(76,139)
USD	2,971,815	PLN	11,798,135	2016年10月13日	(83,574)
USD	6,416,711	RUB	419,508,561	2016年10月13日	(180,645)

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	20,964,887	CZK	510,965,044	2016年10月13日	(194,831)
USD	42,500,970	KRW	47,100,000,000	2016年10月21日	(227,941)
USD	19,462,013	RON	78,843,964	2016年10月13日	(334,491)
USD	30,041,834	CHF	29,499,009	2016年10月13日	(462,202)
USD	67,924,216	JPY	6,900,000,000	2016年11月4日	(555,104)
USD	60,717,643	JPY	6,200,000,000	2016年10月28日	(797,009)
USD	55,108,456	TWD	1,753,000,000	2016年10月14日	(843,612)
USD	21,489,088	NOK	181,148,159	2016年10月13日	(935,758)
USD	30,000,373	PLN	119,774,109	2016年10月13日	(1,017,790)
USD	75,021,877	JPY	7,750,000,000	2016年10月14日	(1,825,339)
HKD	37,000,000	USD	4,772,535	2016年10月21日	50
					(40,986,778)

## 注記2-先物契約

2016年9月30日現在、ファンドは以下の未決済先物契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
<i>買い持ちポジション</i>					
USD	333	FUT S&P 500 EMINI	2016年12月	35,830,800	646,853
				35,830,800	646,853
					<b>646,853</b>

## 注記3-オプション契約

2016年9月30日現在、ファンドは以下の未決済オプション契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
<i>売り持ちポジション</i>						
EUR	(18,852)	C AD NA 22.4065 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(7,039)	0	7,039
AUD	(84,965)	C AGL AU 21.687 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(11,625)	0	11,625
EUR	(56,422)	C AGS BB 32.9507 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(37,681)	0	37,681
AUD	(277,002)	C AMP AU 5.8636 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(26,378)	0	26,378
EUR	(67,038)	C BNP FP 45.3827 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(59,633)	0	59,633
GBP	(658,357)	C BP/ LN 4.930578 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(54,833)	0	54,833
AUD	(28,555)	C CBA AU 79.9555 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(18,146)	0	18,146
GBP	(2,520,752)	C CNA LN 2.432631 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(136,156)	0	136,156
EUR	(21,476)	C DG FP 68.8076 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(27,947)	0	27,947
NOK	(319,684)	C DNB NO 112.3785 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(68,746)	0	68,746
EUR	(121,598)	C FUM1V FH 16.0586 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(35,124)	0	35,124
EUR	(27,530)	C GBF GY 30.7161 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(14,788)	0	14,788
AUD	(307,099)	C IAG AU 6.0779 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(19,519)	0	19,519
THB	(2,000,000)	C LH-R TB 10.282 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(4,400)	0	4,400
AUD	(430,343)	C MPL AU 3.2824 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(18,115)	0	18,115
AUD	(52,078)	C NCM AU 29.0972 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(22,519)	0	22,519
CHF	(11,341)	C NOVX VX 84.9422 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(13,128)	0	13,128
GBP	(232,669)	C PSON LN 10.271925 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(52,319)	0	52,319
EUR	(141,616)	C REN NA 16.4596 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(44,567)	0	44,567
EUR	(24,007)	C SAN FP 79.273 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(35,704)	0	35,704
AUD	(209,487)	C SCG AU 5.3978 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(9,517)	0	9,517
SGD	(700,000)	C ST SP 4.2923 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(11,130)	0	11,130
NOK	(70,433)	C STL NO 161.616 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(17,144)	0	17,144
AUD	(143,707)	C TCL AU 12.9358 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(13,461)	0	13,461
AUD	(88,753)	C TPM AU 12.878 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(11,923)	0	11,923
GBP	(887,345)	C TSCO LN 1.8751632 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(34,251)	0	34,251
TRY	(750,147)	C TTKOM TI 6.9801 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(29,677)	0	29,677
EUR	(12,271)	C VIG AV 18.678 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(4,603)	0	4,603

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(141, 407)	C WFD AU 11.1298 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(13, 747)	0	13, 747
JPY	(55, 000)	C 4902 JT 1009.1532 03/10/16 OTC	2016年10月3日	(3, 559)	0	3, 559
JPY	(35, 000)	C 5802 JT 1713.4541 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(3, 199)	0	3, 199
JPY	(16, 000)	C 6178 JT 1438.4152 03/10/16 OTC	2016年10月3日	(1, 421)	0	1, 421
USD	(38)	C AAL UQ 37.5 28/10/16	2016年10月28日	(3, 232)	(3, 572)	(340)
USD	(86)	C AAL UQ 38.5 04/11/16	2016年11月4日	(5, 764)	(6, 106)	(342)
USD	(87)	C AAL UQ 41 07/10/16	2016年10月7日	(4, 992)	(2, 610)	2, 382
USD	(79)	C AAPL UQ 105 21/10/16	2016年10月21日	(20, 595)	(66, 360)	(45, 765)
USD	(116)	C AAPL UQ 106 14/10/16	2016年10月14日	(18, 300)	(82, 244)	(63, 944)
USD	(140)	C AAPL UQ 108 07/10/16	2016年10月7日	(31, 662)	(86, 100)	(54, 438)
USD	(140)	C AAPL UQ 108 14/10/16	2016年10月14日	(34, 566)	(71, 400)	(36, 834)
USD	(235)	C AAPL UQ 110 21/10/16	2016年10月21日	(45, 767)	(92, 120)	(46, 353)
USD	(79)	C AAPL UQ 110 28/10/16	2016年10月28日	(12, 956)	(41, 080)	(28, 124)
USD	(232)	C AAPL UQ 114 04/11/16	2016年11月4日	(68, 379)	(71, 920)	(3, 541)
USD	(121)	C AAPL UQ 120 18/11/16	2016年11月18日	(30, 219)	(16, 940)	13, 279
USD	(32, 500)	C ACM UN 28.809 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(33, 472)	(53, 368)	(19, 896)
EUR	(57, 551)	C AD NA 21.9975 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(20, 924)	(9, 829)	11, 095
EUR	(65, 204)	C AD NA 22.0681 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(9, 128)	(133)	8, 995
EUR	(57, 484)	C AD NA 22.4843 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(23, 173)	(437)	22, 736
EUR	(69, 633)	C AD NA 22.7035 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(29, 183)	(1, 618)	27, 565
USD	(227, 000)	C AES UN 12.1 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(82, 719)	(222, 478)	(139, 759)
USD	(114, 000)	C AES UN 12.156 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(49, 396)	(105, 737)	(56, 341)
USD	(100, 000)	C AES UN 12.17 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(51, 220)	(82, 034)	(30, 814)
USD	(150, 000)	C AES UN 12.504 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(55, 950)	(105, 507)	(49, 557)
USD	(145, 000)	C AES UN 12.574 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(73, 646)	(75, 594)	(1, 948)
USD	(93, 000)	C AES UN 13.033 08/11/16 OTC	2016年11月8日	(32, 485)	(38, 659)	(6, 174)
EUR	(133, 237)	C AGS BB 32.507 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(85, 188)	(93, 687)	(8, 499)
EUR	(84, 492)	C AGS BB 32.8313 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(51, 098)	(70, 307)	(19, 209)
EUR	(122, 097)	C AGS BB 33.3251 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(25, 803)	(23, 256)	2, 547
EUR	(148, 164)	C AGS BB 35.4313 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(84, 824)	(62, 133)	22, 691
AUD	(71, 469)	C ALL AU 16.2713 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(9, 837)	(13, 193)	(3, 356)
AUD	(71, 420)	C ALL AU 16.4206 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(13, 354)	(18, 764)	(5, 410)
AUD	(85, 380)	C ALL AU 16.5175 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(10, 059)	(4, 326)	5, 733
AUD	(85, 657)	C ALL AU 16.9815 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(24, 181)	(7, 828)	16, 353
EUR	(119, 357)	C ALO FP 23.0779 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(44, 497)	(56, 358)	(11, 861)
EUR	(92, 993)	C ALO FP 23.274 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(29, 061)	(81, 301)	(52, 240)
EUR	(144, 114)	C ALO FP 25.2114 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(59, 111)	(48, 810)	10, 301
EUR	(192, 152)	C ALO FP 25.5219 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(23, 121)	(6, 405)	16, 716
EUR	(147, 984)	C ALO FP 26.76 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(61, 640)	(45, 645)	15, 995
USD	(78)	C AMAT UQ 31 28/10/16	2016年10月28日	(5, 831)	(2, 964)	2, 867
AUD	(86, 325)	C AMC AU 16.8131 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(8, 539)	(9)	8, 530
AUD	(243, 152)	C AMP AU 5.5928 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(13, 894)	(13, 028)	866
AUD	(396, 126)	C AMP AU 5.6424 23/11/16 OTC	2016年11月23日	(19, 867)	(11, 139)	8, 728
AUD	(1, 112)	C ANZ AU 27.5 22/12/16	2016年12月22日	(39, 942)	(71, 450)	(31, 508)
AUD	(107, 127)	C ANZ AU 28.1148 11/01/17 OTC	2017年1月11日	(48, 088)	(45, 378)	2, 710



## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(107,341)	C ANZ AU 28.3904 07/12/16 OTC	2016年12月7日	(30,997)	(28,559)	2,438
USD	(175)	C APA UN 52.5 21/10/16	2016年10月21日	(34,957)	(210,000)	(175,043)
USD	(74)	C APA UN 53 14/10/16	2016年10月14日	(12,020)	(11,766)	254
USD	(180)	C APA UN 54.5 07/10/16	2016年10月7日	(26,416)	(103,500)	(77,084)
USD	(180)	C APA UN 60 18/11/16	2016年11月18日	(74,358)	(105,300)	(30,942)
USD	(72)	C APA UN 62.5 21/10/16	2016年10月21日	(7,540)	(22,248)	(14,708)
USD	(365)	C APA UN 65.5 04/11/16	2016年11月4日	(73,650)	(105,850)	(32,200)
USD	(180)	C APA UN 65.5 28/10/16	2016年10月28日	(14,536)	(32,940)	(18,404)
USD	(35,000)	C ARCC UQ 15.534 01/11/16 OTC	2016年11月1日	(10,766)	(14,461)	(3,695)
GBP	(103,987)	C ASHM LN 3.649925 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(8,393)	(5,503)	2,890
GBP	(485,847)	C ASHM LN 3.701007 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(33,765)	(46,863)	(13,098)
USD	(9,500)	C AVY UN 76.283 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(13,965)	(20,836)	(6,871)
AUD	(1,043,612)	C AWC AU 1.5594 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(45,122)	(1,143)	43,979
GBP	(537,292)	C BA/ LN 5.4548 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(49,601)	(44,583)	5,018
GBP	(536,663)	C BA/ LN 5.482575 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(48,639)	(6,074)	42,565
GBP	(650,092)	C BA/ LN 5.52501 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(61,927)	(14,378)	47,549
GBP	(650,092)	C BA/ LN 5.691114 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(21,241)	(404)	20,837
USD	(82)	C BA UN 133 14/10/16	2016年10月14日	(11,598)	(11,562)	36
USD	(77)	C BA UN 133 21/10/16	2016年10月21日	(14,808)	(12,782)	2,026
USD	(21)	C BA UN 135 18/11/16	2016年11月18日	(4,858)	(4,851)	7
EUR	(23,937)	C BAS GY 73.7024 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(32,750)	(46,796)	(14,046)
EUR	(31,899)	C BAS GY 74.3221 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(32,129)	(83,243)	(51,114)
EUR	(34,648)	C BAS GY 75.675 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(12,472)	(43,209)	(30,737)
EUR	(34,067)	C BAS GY 77.274 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(37,411)	(52,725)	(15,314)
EUR	(27,147)	C BAS GY 77.9505 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(34,540)	(60,052)	(25,512)
USD	(433)	C BAX UN 46.5 14/10/16	2016年10月14日	(30,638)	(22,083)	8,555
USD	(393)	C BAX UN 47.5 04/11/16	2016年11月4日	(32,917)	(33,405)	(488)
USD	(393)	C BAX UN 47.5 07/10/16	2016年10月7日	(39,345)	(31,833)	7,512
USD	(520)	C BAX UN 47.5 21/10/16	2016年10月21日	(42,773)	(33,280)	9,493
USD	(152)	C BAX UN 48 28/10/16	2016年10月28日	(12,427)	(10,944)	1,483
USD	(330)	C BBD UN 9 21/10/16	2016年10月21日	(11,197)	(13,860)	(2,663)
USD	(34,100)	C BBD UN 9.36 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(10,742)	(11,677)	(935)
AUD	(91,531)	C BHP AU 20.7379 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(33,781)	(114,305)	(80,524)
AUD	(108,984)	C BHP AU 23.282 23/11/16 OTC	2016年11月23日	(21,614)	(41,860)	(20,246)
AUD	(108,984)	C BHP AU 23.4956 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(29,114)	(49,082)	(19,968)
AUD	(197,194)	C BLD AU 6.9071 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(12,987)	(23,611)	(10,624)
AUD	(189,445)	C BLD AU 7.219 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(13,880)	(17,657)	(3,777)
AUD	(192,375)	C BLD AU 7.2231 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(13,548)	(50)	13,498
AUD	(194,089)	C BLD AU 7.3851 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(16,224)	(323)	15,901
EUR	(60,885)	C BNP FP 47.9664 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(56,470)	(18,077)	38,393
EUR	(73,754)	C BNP FP 49.3629 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(65,679)	(25,508)	40,171
EUR	(73,754)	C BNP FP 50.066 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(22,878)	(1,165)	21,713
EUR	(91,435)	C BNP FP 51.9416 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(74,512)	(34,462)	40,050
AUD	(92,442)	C BOQ AU 11.8745 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(11,227)	(9,526)	1,701
GBP	(877,324)	C BP/ LN 4.453077 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(82,164)	(140,677)	(58,513)

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
GBP	(1,044,306)	C BP/ LN 4.4749782 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(79,091)	(142,475)	(63,384)
GBP	(845,535)	C BP/ LN 4.4872685 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(21,312)	(86,277)	(64,965)
GBP	(746,653)	C BP/ LN 4.600557 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(65,910)	(102,002)	(36,092)
USD	(17,400)	C BRX UN 28.29/11/16 OTC	2016年11月29日	(9,643)	(18,320)	(8,677)
USD	(19,000)	C BRX UN 28.78 09/11/16 OTC	2016年11月9日	(21,892)	(9,104)	12,788
USD	(25,000)	C BRX UN 28.886 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(8,653)	(2,698)	5,955
USD	(110)	C C UN 45 21/10/16	2016年10月21日	(19,998)	(22,770)	(2,772)
USD	(505)	C C UN 47 11/11/16	2016年11月11日	(81,777)	(83,325)	(1,548)
USD	(173)	C C UN 47.5 07/10/16	2016年10月7日	(18,988)	(3,806)	15,182
USD	(297)	C C UN 47.5 18/11/16	2016年11月18日	(56,060)	(35,937)	20,123
USD	(510)	C C UN 47.5 21/10/16	2016年10月21日	(77,906)	(36,720)	41,186
USD	(288)	C C UN 48 28/10/16	2016年10月28日	(45,434)	(19,008)	26,426
USD	(185)	C C UN 48.5 14/10/16	2016年10月14日	(18,945)	(6,660)	12,285
AUD	(470)	C CBA AU 76 24/11/16	2016年11月24日	(25,149)	(17,512)	7,637
AUD	(29,554)	C CBA AU 76.3466 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(19,779)	(5,768)	14,011
AUD	(290)	C CBA AU 78 27/10/16	2016年10月27日	(32,785)	(662)	32,123
USD	(13,000)	C CCK UN 54.65 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(21,863)	(30,567)	(8,704)
USD	(4,700)	C CCK UN 55.197 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(5,241)	(8,778)	(3,537)
USD	(9,300)	C CCK UN 55.197 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(12,118)	(18,876)	(6,758)
SGD	(900,000)	C CD SP 2.9106 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(9,720)	(6,867)	2,853
SGD	(1,000,000)	C CD SP 2.961 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(10,300)	(7,748)	2,552
AUD	(169,628)	C CGF AU 9.6361 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(33,288)	(88,784)	(55,496)
AUD	(138,100)	C CGF AU 9.6843 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(23,497)	(59,997)	(36,500)
AUD	(137,855)	C CGF AU 9.7209 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(18,242)	(50,453)	(32,211)
USD	(128)	C CMCSA UQ 67 04/11/16	2016年11月4日	(13,921)	(15,872)	(1,951)
USD	(26)	C CMCSA UQ 67 07/10/16	2016年10月7日	(1,580)	(676)	904
USD	(33)	C CMCSA UQ 67 14/10/16	2016年10月14日	(2,320)	(1,221)	1,099
USD	(51)	C CMCSA UQ 67 28/10/16	2016年10月28日	(3,863)	(5,508)	(1,645)
USD	(10)	C CMCSA UQ 67.5 18/11/16	2016年11月18日	(1,379)	(1,200)	179
USD	(147)	C CMCSA UQ 67.5 21/10/16	2016年10月21日	(29,952)	(6,762)	23,190
GBP	(3,697,710)	C CNA LN 2.36269 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(84,325)	(14,748)	69,577
GBP	(1,619,741)	C CNA LN 2.3754204 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(84,057)	(87,713)	(3,656)
GBP	(3,625,782)	C CNA LN 2.414388 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(171,506)	(46,762)	124,744
GBP	(3,052,531)	C CNA LN 2.430432 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(139,932)	(9,961)	129,971
USD	(283)	C COF UN 71.5 07/10/16	2016年10月7日	(50,240)	(18,678)	31,562
USD	(283)	C COF UN 72.5 21/10/16	2016年10月21日	(62,700)	(30,564)	32,136
USD	(225)	C COF UN 73.5 28/10/16	2016年10月28日	(32,795)	(32,400)	395
USD	(1,590)	C CSCO UQ 31.5 04/11/16	2016年11月4日	(66,396)	(65,190)	1,206
USD	(655)	C CSCO UQ 31.5 07/10/16	2016年10月7日	(33,902)	(13,755)	20,147
USD	(300)	C CSCO UQ 31.5 14/10/16	2016年10月14日	(11,101)	(11,700)	(599)
USD	(1,585)	C CSCO UQ 31.5 21/10/16	2016年10月21日	(71,065)	(71,325)	(260)
USD	(697)	C CSCO UQ 31.5 28/10/16	2016年10月28日	(29,106)	(34,153)	(5,047)
USD	(300)	C CSCO UQ 32 14/10/16	2016年10月14日	(9,528)	(3,300)	6,228
USD	(655)	C CSCO UQ 32 21/10/16	2016年10月21日	(24,732)	(12,445)	12,287
USD	(162)	C CSX UN 29 21/10/16	2016年10月21日	(9,559)	(22,680)	(13,121)

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
SGD	(800,000)	C CT SP 2.163 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(7,840)	(26,128)	(18,288)
SGD	(800,000)	C CT SP 2.2472 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(7,600)	(3,386)	4,214
AUD	(47,876)	C CTX AU 34.414 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(22,049)	(21,560)	489
AUD	(47,474)	C CTX AU 34.6434 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(21,762)	(6,379)	15,383
AUD	(44,954)	C CTX AU 35.3432 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(17,232)	(20,445)	(3,213)
USD	(30)	C CVS UN 90.5 11/11/16	2016年11月11日	(5,523)	(5,490)	33
USD	(23)	C CVS UN 91 04/11/16	2016年11月4日	(3,505)	(2,783)	722
USD	(28)	C CVS UN 92 07/10/16	2016年10月7日	(4,112)	(420)	3,692
USD	(14)	C CVS UN 93.5 28/10/16	2016年10月28日	(1,302)	(420)	882
EUR	(34,248)	C DAI GY 60.499 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(37,603)	(56,739)	(19,136)
EUR	(28,691)	C DAI GY 66.2176 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(33,140)	(10,968)	22,172
EUR	(34,633)	C DAI GY 66.6243 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(41,982)	(21,652)	20,330
EUR	(17,986)	C DAI GY 68.735 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(22,386)	(14,096)	8,290
SGD	(150,000)	C DBS SP 15.7815 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(4,950)	(9,342)	(4,392)
SGD	(200,000)	C DBS SP 16.148 31/10/16 OTC	2016年10月31日	(7,900)	(9,167)	(1,267)
USD	(690)	C DFS UN 57.5 21/10/16	2016年10月21日	(37,093)	(35,190)	1,903
USD	(690)	C DFS UN 60 07/10/16	2016年10月7日	(84,702)	(19,320)	65,382
EUR	(34,398)	C DG FP 69.5302 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(11,547)	(12,906)	(1,359)
EUR	(28,619)	C DG FP 70.0568 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(32,040)	(14,180)	17,860
EUR	(34,668)	C DG FP 70.3017 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(35,507)	(22,869)	12,638
EUR	(16,940)	C DG FP 71.3002 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(22,801)	(18,284)	4,517
GBP	(231,963)	C DLG LN 3.43448 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(20,115)	(60,530)	(40,415)
AUD	(167,321)	C DLX AU 6.8033 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(8,513)	(136)	8,377
NOK	(290,344)	C DNB NO 102.1433 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(55,198)	(143,521)	(88,323)
NOK	(67,419)	C DNB NO 107.9858 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(14,357)	(15,791)	(1,434)
NOK	(182,543)	C DNB NO 109.6326 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(10,155)	(7,208)	2,947
NOK	(165,201)	C DNB NO 114.5056 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(32,889)	(27,637)	5,252
USD	(52)	C DNB UN 140 18/11/16	2016年11月18日	(12,453)	(14,560)	(2,107)
USD	(72)	C DRI UN 62.5 21/10/16	2016年10月21日	(9,648)	(6,192)	3,456
EUR	(161,491)	C DTE GY 15.0637 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(15,694)	(18,312)	(2,618)
EUR	(133,470)	C DTE GY 16.0846 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(35,389)	(16,820)	18,569
USD	(50)	C DVN UN 41 14/10/16	2016年10月14日	(8,988)	(13,700)	(4,712)
USD	(50)	C DVN UN 43 14/10/16	2016年10月14日	(4,973)	(7,300)	(2,327)
USD	(116)	C DVN UN 44 21/10/16	2016年10月21日	(27,127)	(15,080)	12,047
USD	(115)	C DVN UN 45 04/11/16	2016年11月4日	(11,854)	(17,020)	(5,166)
USD	(219)	C DVN UN 45 07/10/16	2016年10月7日	(49,878)	(6,789)	43,089
USD	(57)	C DVN UN 46.5 04/11/16	2016年11月4日	(5,971)	(6,099)	(128)
USD	(58)	C DVN UN 46.5 11/11/16	2016年11月11日	(7,236)	(7,366)	(130)
USD	(250)	C DYN UN 12.5 21/10/16	2016年10月21日	(19,689)	(23,750)	(4,061)
USD	(525)	C DYN UN 14.76 01/11/16 FLEX	2016年11月1日	(22,448)	(10,786)	11,662
USD	(530)	C DYN UN 15 18/11/16	2016年11月18日	(28,492)	(29,150)	(658)
EUR	(250,421)	C ELE SM 18.8297 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(89,303)	(134,856)	(45,553)
EUR	(307,987)	C ELE SM 19.1427 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(48,270)	(52,583)	(4,313)
EUR	(334,341)	C ELE SM 19.588 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(91,343)	(33,076)	58,267
EUR	(334,732)	C ELE SM 19.8544 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(81,669)	(80,810)	859

通貨	契約数	銘柄名		満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
USD	(100,000)	C ERIC UQ 7.6 07/10/16	OTC	2016年10月7日	(19,070)	(3,557)	15,513
USD	(220)	C EWC UP 25 21/10/16		2016年10月21日	(11,167)	(11,000)	167
USD	(200)	C EWC UP 26 18/11/16		2016年11月18日	(8,752)	(9,000)	(248)
USD	(1,253)	C EXC UN 33.85 09/11/16	FLEX	2016年11月9日	(103,695)	(92,144)	11,551
USD	(514)	C EXC UN 34 21/10/16		2016年10月21日	(31,230)	(24,672)	6,558
USD	(512)	C EXC UN 36 18/11/16		2016年11月18日	(26,284)	(10,240)	16,044
EUR	(89,140)	C FUMIV FH 14.4076 14/10/16	OTC	2016年10月14日	(10,055)	(22,671)	(12,616)
EUR	(138,207)	C FUMIV FH 14.9828 20/12/16	OTC	2016年12月20日	(41,612)	(72,425)	(30,813)
EUR	(167,222)	C FUMIV FH 15.0302 11/11/16	OTC	2016年11月11日	(50,360)	(41,506)	8,854
EUR	(138,046)	C FUMIV FH 15.5652 25/10/16	OTC	2016年10月25日	(37,315)	(4,642)	32,673
EUR	(27,686)	C GBF GY 28.4426 11/11/16	OTC	2016年11月11日	(17,253)	(53,687)	(36,434)
EUR	(40,370)	C GBF GY 30.7098 14/10/16	OTC	2016年10月14日	(9,593)	(10,540)	(947)
EUR	(19,995)	C GBF GY 31.6103 25/10/16	OTC	2016年10月25日	(10,730)	(5,835)	4,895
EUR	(27,052)	C GBF GY 32.9714 20/12/16	OTC	2016年12月20日	(13,724)	(19,873)	(6,149)
AUD	(205,088)	C GMG AU 7.6719 19/10/16	OTC	2016年10月19日	(22,542)	(2,010)	20,532
AUD	(172,109)	C GMG AU 7.8214 16/11/16	OTC	2016年11月16日	(10,925)	(3,920)	7,005
USD	(225)	C GNC UN 22.5 18/11/16		2016年11月18日	(19,970)	(20,250)	(280)
USD	(400)	C GNC UN 22.5 21/10/16		2016年10月21日	(38,303)	(10,000)	28,303
USD	(460)	C GPOR UQ 27.5 21/10/16		2016年10月21日	(51,868)	(43,240)	8,628
USD	(13,000)	C GPOR UQ 28.665 28/10/16	OTC	2016年10月28日	(11,570)	(10,981)	589
USD	(35,000)	C GPOR UQ 29.033 14/11/16	OTC	2016年11月14日	(36,386)	(36,358)	28
USD	(240)	C HIG UN 42 21/10/16		2016年10月21日	(16,502)	(30,960)	(14,458)
USD	(80)	C HIG UN 43.5 28/10/16		2016年10月28日	(6,861)	(6,320)	541
USD	(50)	C HON UN 120 18/11/16		2016年11月18日	(5,117)	(5,500)	(383)
USD	(20)	C HON UN 120 21/10/16		2016年10月21日	(1,555)	(1,220)	335
GBP	(1,029,738)	C HSBA LN 5.0327135 30/09/16	OTC	2016年9月30日	(114,974)	(967,080)	(852,106)
GBP	(1,368,527)	C HSBA LN 5.447208 25/10/16	OTC	2016年10月25日	(124,031)	(510,454)	(386,423)
GBP	(1,657,777)	C HSBA LN 5.81229 11/11/16	OTC	2016年11月11日	(165,520)	(232,225)	(66,705)
GBP	(1,421,080)	C HSBA LN 5.889429 14/10/16	OTC	2016年10月14日	(63,677)	(77,029)	(13,352)
GBP	(1,031,000)	C HSBA LN 6.139267 20/12/16	OTC	2016年12月20日	(88,725)	(85,937)	2,788
AUD	(267,521)	C IAG AU 5.7762 19/10/16	OTC	2016年10月19日	(7,606)	(1,459)	6,147
AUD	(309,119)	C IAG AU 5.8882 16/11/16	OTC	2016年11月16日	(16,819)	(4,156)	12,663
USD	(580)	C IPG UN 24 18/11/16		2016年11月18日	(18,150)	(15,660)	2,490
USD	(470)	C IPG UN 24 21/10/16		2016年10月21日	(17,041)	(5,170)	11,871
AUD	(454,260)	C IPL AU 2.9795 14/12/16	OTC	2016年12月14日	(21,712)	(30,808)	(9,096)
AUD	(479,058)	C IPL AU 3.0352 09/11/16	OTC	2016年11月9日	(24,621)	(15,372)	9,249
AUD	(462,775)	C IPL AU 3.1266 05/10/16	OTC	2016年10月5日	(17,297)	(18)	17,279
USD	(20,000)	C ITUB UN 11.342 06/10/16	OTC	2016年10月6日	(10,220)	(1,093)	9,127
USD	(970)	C ITUB UN 12 18/11/16		2016年11月18日	(25,471)	(26,675)	(1,204)
AUD	(43,383)	C JBH AU 31.5566 30/11/16	OTC	2016年11月30日	(25,335)	(23,794)	1,541
AUD	(43,513)	C JBH AU 31.6994 16/11/16	OTC	2016年11月16日	(22,337)	(17,061)	5,276
AUD	(44,073)	C JBH AU 32.1383 12/10/16	OTC	2016年10月12日	(15,196)	(1,287)	13,909
AUD	(62,005)	C JHX AU 21.8723 14/12/16	OTC	2016年12月14日	(18,305)	(19,691)	(1,386)
AUD	(50,198)	C JHX AU 22.8871 23/11/16	OTC	2016年11月23日	(16,199)	(4,214)	11,985
AUD	(50,198)	C JHX AU 22.8871 26/10/16	OTC	2016年10月26日	(8,992)	(702)	8,290

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(58, 713)	C JHX AU 23.6806 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(17, 365)	(1, 441)	15, 924
AUD	(89, 780)	C JHX AU 23.6946 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(32, 911)	(3)	32, 908
USD	(8)	C JPM UN 66 30/09/16	2016年9月30日	(1, 022)	(328)	694
USD	(122)	C JPM UN 67.5 21/10/16	2016年10月21日	(13, 476)	(7, 930)	5, 546
USD	(688)	C JPM UN 68 14/10/16	2016年10月14日	(67, 945)	(22, 704)	45, 241
USD	(317)	C JPM UN 68 28/10/16	2016年10月28日	(32, 353)	(16, 801)	15, 552
USD	(354)	C JPM UN 68.5 07/10/16	2016年10月7日	(25, 402)	(1, 770)	23, 632
USD	(92, 000)	C KEY UN 12.443 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(29, 587)	(7, 394)	22, 193
USD	(200)	C KEY UN 12.5 03/10/16 (USD) FLEX	2016年10月3日	(3, 952)	(134)	3, 818
USD	(290)	C KR UN 31.88 17/11/16 FLEX	2016年11月17日	(21, 100)	(8, 472)	12, 628
USD	(146)	C KR UN 32.5 21/10/16	2016年10月21日	(19, 382)	(1, 168)	18, 214
USD	(24, 000)	C KR UN 32.82 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(21, 574)	(313)	21, 261
USD	(24, 000)	C KR UN 32.82 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(24, 677)	(1, 660)	23, 017
USD	(29, 000)	C KR UN 32.936 03/11/16 OTC	2016年11月3日	(27, 170)	(2, 937)	24, 233
USD	(134)	C KR UN 33.75 06/10/16 FLEX	2016年10月6日	(9, 482)	(1)	9, 481
USD	(11, 000)	C LEA UN 115.6 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(39, 288)	(67, 798)	(28, 510)
USD	(4, 900)	C LEA UN 115.66 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(17, 282)	(20, 967)	(3, 685)
USD	(189)	C LEA UN 120 18/11/16	2016年11月18日	(71, 867)	(79, 380)	(7, 513)
GBP	(1, 122, 335)	C LGEN LN 2.034288 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(47, 974)	(203, 057)	(155, 083)
GBP	(1, 646, 362)	C LGEN LN 2.256519 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(70, 326)	(67, 389)	2, 937
GBP	(1, 019, 327)	C LGEN LN 2.269932 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(48, 602)	(19, 152)	29, 450
GBP	(1, 020, 522)	C LGEN LN 2.3968 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(46, 174)	(26, 548)	19, 626
THB	(2, 000, 000)	C LH-R TB 10.0439 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(4, 600)	(43)	4, 557
THB	(3, 000, 000)	C LH-R TB 9.3999 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(5, 100)	(4, 202)	898
THB	(3, 000, 000)	C LH-R TB 9.7376 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(5, 700)	(2, 630)	3, 070
USD	(135)	C LNC UN 47.5 21/10/16	2016年10月21日	(15, 627)	(9, 180)	6, 447
USD	(44)	C LOW UN 72.5 18/11/16	2016年11月18日	(8, 261)	(8, 096)	165
USD	(29)	C LOW UN 74 28/10/16	2016年10月28日	(1, 906)	(2, 842)	(936)
USD	(55)	C LOW UN 75 04/11/16	2016年11月4日	(3, 545)	(3, 905)	(360)
USD	(43)	C LOW UN 75 18/11/16	2016年11月18日	(4, 720)	(3, 784)	936
MYR	(800, 000)	C MAY MK 7.9689 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(3, 120)	(124)	2, 996
USD	(109)	C MDT UN 87 11/11/16	2016年11月11日	(13, 201)	(14, 170)	(969)
USD	(157)	C MDT UN 87 14/10/16	2016年10月14日	(21, 750)	(14, 130)	7, 620
USD	(53)	C MDT UN 87 28/10/16	2016年10月28日	(5, 015)	(5, 936)	(921)
USD	(87)	C MDT UN 87.5 21/10/16	2016年10月21日	(7, 408)	(6, 699)	709
USD	(90)	C MDT UN 88 04/11/16	2016年11月4日	(10, 566)	(4, 410)	6, 156
USD	(63)	C MGA UN 40 21/10/16	2016年10月21日	(5, 922)	(12, 537)	(6, 615)
USD	(10, 000)	C MGA UN 41.006 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(9, 494)	(13, 039)	(3, 545)
USD	(33)	C MGA UN 42.5 18/11/16	2016年11月18日	(2, 607)	(4, 785)	(2, 178)
AUD	(716, 103)	C MGR AU 2.1892 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(25, 630)	(34, 708)	(9, 078)
AUD	(677, 758)	C MGR AU 2.2345 23/11/16 OTC	2016年11月23日	(30, 859)	(30, 572)	287
USD	(133)	C MPC UN 42.5 21/10/16	2016年10月21日	(25, 636)	(6, 650)	18, 986
USD	(200)	C MPC UN 44 07/10/16	2016年10月7日	(18, 351)	(800)	17, 551
USD	(87)	C MPC UN 44 14/10/16	2016年10月14日	(10, 680)	(1, 566)	9, 114
USD	(87)	C MPC UN 44 28/10/16	2016年10月28日	(14, 160)	(13, 920)	240

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(588,688)	C MPL AU 2.6589 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(18,603)	(12,870)	5,733
AUD	(465,734)	C MPL AU 2.8522 30/11/16 OTC	2016年11月30日	(15,169)	(4,579)	10,590
AUD	(365,214)	C MPL AU 3.23 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(14,400)	(3)	14,397
AUD	(436,314)	C MPL AU 3.3101 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(17,328)	(30)	17,298
AUD	(25,001)	C MQG AU 83.0192 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(17,583)	(21,974)	(4,391)
AUD	(27,280)	C MQG AU 84.7625 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(9,822)	(3,840)	5,982
AUD	(31,300)	C MQG AU 85.9297 30/11/16 OTC	2016年11月30日	(25,162)	(18,525)	6,637
AUD	(20,818)	C MQG AU 86.1811 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(8,324)	(4,082)	4,242
USD	(525)	C MRK UN 62.5 07/10/16	2016年10月7日	(66,109)	(28,875)	37,234
USD	(418)	C MRK UN 63 14/10/16	2016年10月14日	(42,952)	(31,350)	11,602
USD	(110)	C MRK UN 64 04/11/16	2016年11月4日	(10,533)	(11,990)	(1,457)
USD	(110)	C MRK UN 64.5 21/10/16	2016年10月21日	(9,103)	(7,370)	1,733
USD	(430)	C MRK UN 65 21/10/16	2016年10月21日	(17,096)	(18,920)	(1,824)
USD	(600)	C MRO UN 15 04/11/16	2016年11月4日	(53,254)	(86,400)	(33,146)
USD	(600)	C MRO UN 15 18/11/16	2016年11月18日	(62,854)	(104,400)	(41,546)
USD	(633)	C MRO UN 16 28/10/16	2016年10月28日	(20,103)	(54,438)	(34,335)
USD	(399)	C MRO UN 16.5 04/11/16	2016年11月4日	(25,439)	(34,713)	(9,274)
USD	(175)	C MRO UN 16.5 07/10/16	2016年10月7日	(11,376)	(4,025)	7,351
USD	(397)	C MRO UN 16.5 28/10/16	2016年10月28日	(20,548)	(25,805)	(5,257)
USD	(840)	C MRO UN 17 14/10/16	2016年10月14日	(44,317)	(21,000)	23,317
USD	(479)	C MRO UN 17 21/10/16	2016年10月21日	(32,936)	(19,160)	13,776
GBP	(1,247,138)	C MRW LN 1.9310562 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(52,177)	(366,489)	(314,312)
GBP	(2,354,070)	C MRW LN 1.993222 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(85,649)	(519,396)	(433,747)
GBP	(2,851,623)	C MRW LN 2.0645625 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(44,113)	(368,554)	(324,441)
GBP	(2,623,493)	C MRW LN 2.09017 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(118,595)	(349,227)	(230,632)
GBP	(2,118,613)	C MRW LN 2.3606856 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(81,493)	(65,128)	16,365
AUD	(1,216)	C NAB AU 28.12 22/12/16	2016年12月22日	(34,650)	(56,191)	(21,541)
AUD	(105,165)	C NAB AU 28.515 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(34,887)	(26,888)	7,999
AUD	(57,030)	C NCM AU 25.5759 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(5,417)	(5,162)	255
USD	(360)	C NDAQ UQ 70 21/10/16	2016年10月21日	(35,193)	(19,800)	15,393
USD	(32,000)	C NDAQ UQ 70.59 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(43,456)	(5,049)	38,407
USD	(985)	C NLSN UN 54.01 06/10/16 FLEX	2016年10月6日	(57,877)	(34,715)	23,162
USD	(78,500)	C NLSN UN 54.292 10/11/16 OTC	2016年11月10日	(82,708)	(88,214)	(5,506)
USD	(670)	C NOK UN 5.5 30/09/16	2016年9月30日	(19,958)	(13,400)	6,558
CHF	(28,084)	C NOVN VX 79.618 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(13,351)	(979)	12,372
CHF	(27,523)	C NOVN VX 80.0935 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(29,256)	(8,048)	21,208
CHF	(24,480)	C NOVN VX 82.2369 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(26,958)	(7,877)	19,081
CHF	(24,451)	C NOVN VX 84.8936 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(26,618)	(45)	26,573
USD	(37,800)	C NWL UN 51 07/11/16 OTC	2016年11月7日	(63,882)	(87,521)	(23,639)
USD	(37,800)	C NWL UN 51 21/11/16 OTC	2016年11月21日	(75,222)	(97,914)	(22,692)
USD	(32,300)	C NYCB UN 14.515 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(11,279)	(4,352)	6,927
SGD	(120,000)	C OCBC SP 9.0312 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(2,244)	(2,573)	(329)
USD	(340)	C OMC UN 85 21/10/16	2016年10月21日	(47,237)	(54,400)	(7,163)
PLN	(160,292)	C OPL PW 5.69 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(3,287)	(13,286)	(9,999)
PLN	(142,761)	C OPL PW 6.24 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(1,261)	(1,559)	(298)

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
PLN	(494, 045)	C OPL PW 6.57 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(11, 797)	(16, 385)	(4, 588)
AUD	(469, 339)	C ORA AU 2.9462 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(14, 476)	(72, 922)	(58, 446)
USD	(160)	C ORCL UN 40 04/11/16	2016年11月4日	(6, 600)	(6, 720)	(120)
USD	(160)	C ORCL UN 40 11/11/16	2016年11月11日	(7, 848)	(8, 000)	(152)
USD	(107)	C ORCL UN 40 18/11/16	2016年11月18日	(7, 036)	(5, 778)	1, 258
USD	(107)	C ORCL UN 40.5 04/11/16	2016年11月4日	(3, 612)	(2, 782)	830
USD	(211)	C ORCL UN 41 28/10/16	2016年10月28日	(7, 123)	(2, 110)	5, 013
USD	(16)	C ORCL UN 41.5 07/10/16	2016年10月7日	(1, 228)	(768)	460
USD	(16)	C ORCL UN 41.5 14/10/16	2016年10月14日	(972)	(208)	764
USD	(405)	C PBR UN 10.5 07/10/16	2016年10月7日	(15, 292)	(1, 215)	14, 077
USD	(700)	C PBR UN 9.5 28/10/16	2016年10月28日	(40, 899)	(36, 400)	4, 499
USD	(700)	C PFE UN 34.5 04/11/16	2016年11月4日	(38, 331)	(31, 500)	6, 831
USD	(700)	C PFE UN 34.5 28/10/16	2016年10月28日	(27, 831)	(17, 500)	10, 331
USD	(604)	C PFE UN 35 18/11/16	2016年11月18日	(15, 558)	(14, 496)	1, 062
USD	(703)	C PFE UN 35.5 07/10/16	2016年10月7日	(18, 108)	(3, 515)	14, 593
USD	(691)	C PFE UN 35.5 14/10/16	2016年10月14日	(12, 962)	(2, 764)	10, 198
USD	(604)	C PFE UN 37.35 13/10/16 FLEX	2016年10月13日	(27, 034)	(4)	27, 030
PLN	(129, 091)	C PGE PW 12.55 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(2, 333)	(13)	2, 320
PLN	(164, 248)	C PGE PW 13.93 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(9, 372)	(25)	9, 347
USD	(8, 100)	C PKG UN 80 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(25, 753)	(22, 653)	3, 100
USD	(57)	C PPG UN 110 21/10/16	2016年10月21日	(9, 443)	(1, 425)	8, 018
USD	(60)	C PRU UN 78 30/09/16 FLEX	2016年9月30日	(9, 165)	(16, 979)	(7, 814)
USD	(28)	C PRU UN 80 21/10/16	2016年10月21日	(6, 657)	(6, 384)	273
USD	(73)	C PRU UN 82.5 21/10/16	2016年10月21日	(10, 348)	(6, 935)	3, 413
USD	(72)	C PRU UN 85 21/10/16	2016年10月21日	(4, 519)	(2, 376)	2, 143
GBP	(211, 562)	C PSON LN 8.24704 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(32, 413)	(33, 395)	(982)
GBP	(255, 978)	C PSON LN 9.165645 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(50, 814)	(1, 223)	49, 591
AUD	(393, 143)	C QAN AU 3.5374 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(19, 577)	(6, 945)	12, 632
AUD	(461, 117)	C QAN AU 3.6318 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(16, 820)	(165)	16, 655
AUD	(135, 260)	C QBE AU 10.025 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(18, 399)	(15, 780)	2, 619
AUD	(136, 228)	C QBE AU 10.1695 23/11/16 OTC	2016年11月23日	(10, 265)	(7, 744)	2, 521
AUD	(154, 403)	C QBE AU 10.7046 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(12, 195)	(4)	12, 191
AUD	(177, 250)	C QBE AU 10.8525 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(20, 520)	(1, 562)	18, 958
USD	(299)	C QCOM UQ 62 14/10/16	2016年10月14日	(28, 033)	(47, 242)	(19, 209)
USD	(428)	C QCOM UQ 63 07/10/16	2016年10月7日	(49, 061)	(278, 199)	(229, 138)
USD	(314)	C QCOM UQ 64 04/11/16	2016年11月4日	(62, 409)	(197, 820)	(135, 411)
USD	(299)	C QCOM UQ 64 07/10/16	2016年10月7日	(23, 848)	(97, 175)	(73, 327)
USD	(314)	C QCOM UQ 65 18/11/16	2016年11月18日	(55, 187)	(181, 806)	(126, 619)
USD	(297)	C QCOM UQ 65 21/10/16	2016年10月21日	(17, 748)	(148, 500)	(130, 752)
USD	(901)	C QCOM UQ 66.5 11/11/16	2016年11月11日	(233, 146)	(235, 161)	(2, 015)
GBP	(494, 575)	C RBS LN 2.14555 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(18, 250)	(11, 195)	7, 055
GBP	(566, 165)	C RBS LN 2.2275 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(8, 985)	(22)	8, 963
GBP	(364, 845)	C RBS LN 2.2678825 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(16, 875)	(841)	16, 034
AUD	(22, 461)	C REA AU 59.9848 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(13, 547)	(4, 504)	9, 043
AUD	(22, 745)	C REA AU 62.4618 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(13, 204)	(580)	12, 624

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(21, 871)	C REA AU 63.3107 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(16, 683)	(3, 118)	13, 565
EUR	(95, 804)	C REN NA 16.5209 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(29, 864)	(32, 288)	(2, 424)
EUR	(145, 218)	C REN NA 16.5513 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(38, 639)	(11, 182)	27, 457
USD	(480)	C RF UN 10 18/11/16	2016年11月18日	(11, 404)	(13, 440)	(2, 036)
AUD	(31, 269)	C RIO AU 52.8307 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(10, 738)	(8, 788)	1, 950
AUD	(50, 483)	C RIO AU 54.0075 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(18, 207)	(29, 220)	(11, 013)
AUD	(54, 900)	C RIO AU 55.9651 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(35, 657)	(26, 629)	9, 028
AUD	(150, 075)	C RMD AU 9.0053 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(13, 183)	(15, 586)	(2, 403)
AUD	(170, 619)	C RMD AU 9.1463 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(14, 391)	(7, 395)	6, 996
AUD	(1, 531)	C RMD AU 9.25 27/10/16	2016年10月27日	(18, 357)	(2, 910)	15, 447
USD	(180)	C RS UN 72.5 21/10/16	2016年10月21日	(18, 496)	(44, 100)	(25, 604)
USD	(38)	C RTN UN 141.5 14/10/16 FLEX	2016年10月14日	(7, 135)	(262)	6, 873
EUR	(18, 937)	C SAN FP 72.2079 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(25, 400)	(16, 827)	8, 573
EUR	(38, 753)	C SAN FP 72.5926 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(52, 265)	(10, 296)	41, 969
EUR	(38, 450)	C SAN FP 72.9729 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(17, 962)	(443)	17, 519
EUR	(31, 991)	C SAN FP 76.9543 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(38, 750)	(252)	38, 498
AUD	(269, 435)	C SCG AU 4.9487 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(8, 490)	(3, 106)	5, 384
AUD	(269, 435)	C SCG AU 4.9958 23/11/16 OTC	2016年11月23日	(11, 802)	(6, 722)	5, 080
AUD	(256, 552)	C SCG AU 5.2149 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(10, 054)	(587)	9, 467
AUD	(294, 913)	C SCG AU 5.2996 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(14, 142)	(36)	14, 106
AUD	(215, 257)	C SCG AU 5.3607 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(9, 724)	(476)	9, 248
EUR	(146, 575)	C SGO FP 38.0672 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(113, 610)	(22, 595)	91, 015
EUR	(125, 517)	C SGO FP 40.6288 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(79, 441)	(21, 128)	58, 313
EUR	(77, 960)	C SGO FP 41.9182 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(59, 681)	(39, 052)	20, 629
AUD	(216, 971)	C SGR AU 6.2489 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(11, 374)	(8, 886)	2, 488
AUD	(211, 231)	C SGR AU 6.3669 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(12, 268)	(10, 794)	1, 474
USD	(80, 800)	C SLM UQ 7.37 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(29, 629)	(28, 636)	993
USD	(35, 000)	C SLM UQ 7.44 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(10, 007)	(4, 761)	5, 246
USD	(54, 000)	C SLM UQ 7.45 03/11/16 OTC	2016年11月3日	(17, 890)	(18, 988)	(1, 098)
USD	(54, 000)	C SLM UQ 7.45 10/11/16 OTC	2016年11月10日	(19, 062)	(20, 681)	(1, 619)
USD	(55, 000)	C SLM UQ 7.545 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(8, 630)	(8, 851)	(221)
USD	(21, 000)	C SNI UQ 62.5 15/11/16 OTC	2016年11月15日	(32, 342)	(73, 093)	(40, 751)
USD	(250)	C SNI UQ 65 18/11/16	2016年11月18日	(35, 902)	(60, 000)	(24, 098)
USD	(95)	C SNI UQ 65 21/10/16	2016年10月21日	(12, 891)	(12, 255)	636
EUR	(22, 015)	C SOLB BB 103.8975 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(10, 841)	(22, 808)	(11, 967)
EUR	(22, 188)	C SOLB BB 104.0194 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(37, 765)	(53, 285)	(15, 520)
EUR	(16, 759)	C SOLB BB 109.5865 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(25, 877)	(26, 145)	(268)
EUR	(7, 831)	C SOLB BB 89.6228 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(12, 981)	(114, 996)	(102, 015)
EUR	(18, 317)	C SOLB BB 99.51 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(24, 585)	(86, 558)	(61, 973)
USD	(400)	C SPN UN 15 18/11/16	2016年11月18日	(32, 503)	(32, 000)	503
USD	(51, 100)	C SPN UN 16.122 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(33, 895)	(93, 885)	(59, 990)
USD	(25)	C SPXW UN 2175 31/10/16	2016年10月31日	(53, 225)	(49, 000)	4, 225
USD	(10)	C SPXW UN 2180 14/10/16	2016年10月14日	(11, 990)	(9, 600)	2, 390
USD	(40)	C SPXW UN 2215 04/11/16	2016年11月4日	(47, 490)	(25, 400)	22, 090
CHF	(68, 483)	C SREN VX 85.8884 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(89, 627)	(187, 018)	(97, 391)



## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
CHF	(57,530)	C SREN VX 86.1734 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(63,508)	(115,373)	(51,865)
CHF	(50,677)	C SREN VX 86.526 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(76,812)	(19,587)	57,225
CHF	(47,372)	C SREN VX 92.7199 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(58,396)	(35,896)	22,500
SGD	(700,000)	C ST SP 4.032 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(13,020)	(21,575)	(8,555)
SGD	(700,000)	C ST SP 4.2684 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(14,840)	(1,020)	13,820
NOK	(53,317)	C STL NO 136.5789 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(4,903)	(9,933)	(5,030)
NOK	(80,054)	C STL NO 138.7124 20/12/16 OTC	2016年10月20日	(19,533)	(39,474)	(19,941)
NOK	(95,179)	C STL NO 139.708 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(26,371)	(22,085)	4,286
NOK	(79,960)	C STL NO 144.6943 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(24,273)	(4,520)	19,753
AUD	(344,273)	C STO AU 4.2263 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(32,692)	(24,815)	7,877
AUD	(291,970)	C STO AU 4.7878 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(13,109)	(964)	12,145
AUD	(395,173)	C STO AU 4.9528 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(43,244)	(3,344)	39,900
AUD	(291,111)	C STO AU 5.1181 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(17,341)	(111)	17,230
USD	(28,000)	C STWD UN 22.5 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(8,243)	(13,082)	(4,839)
USD	(340)	C STWD UN 22.5 18/11/16	2016年11月18日	(19,978)	(22,100)	(2,122)
USD	(40,000)	C STWD UN 22.65 10/11/16 OTC	2016年11月10日	(12,636)	(27,479)	(14,843)
USD	(38,500)	C STWD UN 23.393 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(7,758)	(10,509)	(2,751)
SEK	(170,590)	C SWEDA SS 186.8614 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(61,818)	(266,358)	(204,540)
SEK	(193,665)	C SWEDA SS 190.6312 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(62,029)	(245,319)	(183,290)
SEK	(125,058)	C SWEDA SS 204.6297 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(12,909)	(16,270)	(3,361)
SEK	(234,597)	C SWEDA SS 205.6227 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(84,016)	(80,255)	3,761
SEK	(193,892)	C SWEDA SS 211.7916 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(61,245)	(64,736)	(3,491)
USD	(25,000)	C TDS UN 27.511 06/12/16 OTC	2016年12月6日	(28,980)	(29,679)	(699)
USD	(49,000)	C TDS UN 28.161 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(43,370)	(45,749)	(2,379)
USD	(25,000)	C TDS UN 28.634 14/11/16 OTC	2016年11月14日	(25,368)	(12,731)	12,637
USD	(48,500)	C TDS UN 29.05 28/11/16 OTC	2016年11月28日	(52,865)	(24,348)	28,517
USD	(21,000)	C TDS UN 29.087 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(16,189)	(4,318)	11,871
USD	(29,000)	C TDS UN 29.25 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(27,695)	(1,690)	26,005
USD	(25,000)	C TDS UN 30.4 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(29,360)	(6)	29,354
USD	(25,000)	C TER UN 21.381 30/09/16 OTC	2016年9月30日	(9,638)	(1,475)	8,163
USD	(594)	C TER UN 22 18/11/16	2016年11月18日	(46,782)	(43,362)	3,420
USD	(116)	C THO UN 80 21/10/16	2016年10月21日	(36,279)	(75,400)	(39,121)
AUD	(403,223)	C TLS AU 5.4753 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(11,829)	(2,484)	9,345
GBP	(2,398,767)	C TSCO LN 1.7261748 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(92,633)	(346,554)	(253,921)
GBP	(2,905,767)	C TSCO LN 1.76715 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(46,502)	(258,872)	(212,370)
GBP	(2,905,767)	C TSCO LN 1.8278538 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(123,361)	(245,778)	(122,417)
GBP	(2,401,578)	C TSCO LN 2.0415298 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(87,993)	(78,087)	9,906
TRY	(228,448)	C TTKOM TI 6.3874 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(7,958)	(6,415)	1,543
TRY	(303,975)	C TTKOM TI 6.585 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(11,512)	(354)	11,158
USD	(79)	C TUP UN 65 18/11/16	2016年11月18日	(17,918)	(22,910)	(4,992)
USD	(79)	C TUP UN 65 21/10/16	2016年10月21日	(13,983)	(17,380)	(3,397)
AUD	(115,284)	C TWE AU 11.4854 23/11/16 OTC	2016年11月23日	(22,588)	(19,237)	3,351
AUD	(95,227)	C TWE AU 11.6712 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(8,299)	(3,421)	4,878
AUD	(96,828)	C TWE AU 11.8131 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(15,166)	(14,591)	575
USD	(5,200)	C UN UN 46.46 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(3,851)	(1,919)	1,932

## ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
USD	(7,800)	C UN UN 46.899 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(4,781)	(3,732)	1,049
USD	(7,700)	C UN UN 47.726 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(5,044)	(1,462)	3,582
SGD	(80,000)	C UOB SP 18.6078 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(4,056)	(15,726)	(11,670)
SGD	(100,000)	C UOB SP 19.605 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(5,120)	(5,013)	107
USD	(73)	C UPS UN 109 04/11/16	2016年11月4日	(15,604)	(15,768)	(164)
USD	(35)	C UPS UN 110 14/10/16	2016年10月14日	(3,270)	(1,890)	1,380
USD	(35)	C UPS UN 111 21/10/16	2016年10月21日	(2,474)	(1,925)	549
EUR	(17,268)	C VIG AV 18.676 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(5,450)	(6,958)	(1,508)
EUR	(13,015)	C VIG AV 18.9321 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(1,532)	(2,139)	(607)
EUR	(29,298)	C VIG AV 19.9585 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(9,103)	(17,460)	(8,357)
USD	(84)	C VLO UN 56.5 07/10/16	2016年10月7日	(7,571)	(336)	7,235
USD	(85)	C VLO UN 57 14/10/16	2016年10月14日	(7,568)	(3,570)	3,998
USD	(56)	C VLO UN 57 21/10/16	2016年10月21日	(5,642)	(1,288)	4,354
USD	(28)	C VLO UN 57.5 04/11/16	2016年11月4日	(2,604)	(2,240)	364
USD	(28)	C VLO UN 57.5 18/11/16	2016年11月18日	(4,116)	(1,288)	2,828
USD	(110)	C VLO UN 57.5 21/10/16	2016年10月21日	(15,813)	(1,870)	13,943
GBP	(1,377,805)	C VOD LN 2.310729 20/12/16 OTC	2016年12月20日	(69,346)	(65,852)	3,494
GBP	(952,780)	C VOD LN 2.3282628 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(20,965)	(4,639)	16,326
GBP	(1,430,430)	C VOD LN 2.4200907 11/11/16 OTC	2016年11月11日	(66,725)	(15,003)	51,722
GBP	(1,990,425)	C VOD LN 2.4847625 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(79,479)	(2,320)	77,159
USD	(138)	C VZ UN 52.5 18/11/16	2016年11月18日	(11,283)	(12,420)	(1,137)
USD	(513)	C VZ UN 52.5 21/10/16	2016年10月21日	(55,279)	(28,728)	26,551
USD	(238)	C VZ UN 53 07/10/16	2016年10月7日	(11,604)	(2,380)	9,224
USD	(381)	C VZ UN 53 14/10/16	2016年10月14日	(25,816)	(6,858)	18,958
USD	(236)	C VZ UN 53 28/10/16	2016年10月28日	(19,059)	(11,800)	7,259
USD	(381)	C VZ UN 55 21/10/16	2016年10月21日	(7,147)	(1,524)	5,623
USD	(70)	C WBA UQ 82 04/11/16	2016年11月4日	(10,409)	(10,500)	(91)
USD	(180)	C WBA UQ 85 21/10/16	2016年10月21日	(21,868)	(6,660)	15,208
AUD	(84,662)	C WBC AU 30.7734 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(28,332)	(17,899)	10,433
AUD	(72,234)	C WBC AU 30.8949 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(11,269)	(2,485)	8,784
AUD	(736)	C WBC AU 32 27/10/16	2016年10月27日	(31,111)	(1,119)	29,992
AUD	(39,498)	C WES AU 44.0208 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(16,884)	(28,232)	(11,348)
AUD	(41,736)	C WES AU 44.0523 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(23,360)	(14,614)	8,746
AUD	(77,370)	C WFD AU 10.521 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(2,479)	(62)	2,417
AUD	(125,510)	C WFD AU 11.0712 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(15,707)	(880)	14,827
AUD	(63,477)	C WOW AU 24.3986 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(9,410)	(2,628)	6,782
AUD	(66,589)	C WOW AU 24.8247 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(14,924)	(5)	14,919
AUD	(88,864)	C WOW AU 24.8621 16/11/16 OTC	2016年11月16日	(23,409)	(8,544)	14,865
AUD	(54,940)	C WOW AU 24.8647 14/12/16 OTC	2016年12月14日	(12,073)	(10,358)	1,715
AUD	(44,286)	C WPL AU 31.1618 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(8,124)	(88)	8,036
USD	(230)	C XL UN 34 21/10/16	2016年10月21日	(13,278)	(10,350)	2,928
USD	(20,000)	C XL UN 34.66 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(10,566)	(7,206)	3,360
USD	(149)	C ZBH UN 129 07/11/16 FLEX	2016年11月7日	(24,251)	(53,820)	(29,569)
USD	(16,100)	C ZBH UN 129.118 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(35,404)	(17,991)	17,413
USD	(165)	C ZBH UN 130 21/10/16	2016年10月21日	(45,829)	(34,320)	11,509

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
KRW	(12,000)	C 005385 KS 104199.48 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(5,180)	(2,278)	2,902
KRW	(10,000)	C 005385 KS 105525 21/10/16 OTC	2016年10月21日	(5,045)	(2,740)	2,305
KRW	(5,000)	C 005490 KS 234427.156 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(12,035)	(16,637)	(4,602)
KRW	(5,000)	C 005490 KS 244495 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(6,097)	(9,597)	(3,500)
KRW	(30,000)	C 005830 KS 71599.8821 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(14,523)	(20,727)	(6,204)
KRW	(25,000)	C 005830 KS 72774.98 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(10,708)	(19,682)	(8,974)
KRW	(15,000)	C 015760 KS 60632 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(6,141)	0	6,141
KRW	(20,000)	C 015760 KS 62669.32 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(6,314)	(675)	5,639
KRW	(10,000)	C 033780 KS 120750 21/10/16 OTC	2016年10月21日	(10,272)	(54,236)	(43,964)
KRW	(10,000)	C 033780 KS 129150 31/10/16 OTC	2016年10月31日	(10,329)	(19,663)	(9,334)
KRW	(20,000)	C 035250 KS 41393 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(5,380)	(125)	5,255
KRW	(20,000)	C 035250 KS 42156.2 04/11/16 OTC	2016年11月4日	(4,504)	(4,096)	408
KRW	(3,000)	C 051915 KS 183600 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(4,473)	(767)	3,706
KRW	(3,000)	C 051915 KS 196070.76 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(6,213)	(4)	6,209
KRW	(15,000)	C 055550 KS 41422.5 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(3,648)	(4,649)	(1,001)
KRW	(15,000)	C 055550 KS 43210.9 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(3,552)	(28)	3,524
KRW	(100,000)	C 088980 KS 8885.8736 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(4,030)	0	4,030
HKD	(80,000)	C 1 HK 107.428 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(4,144)	(365)	3,779
HKD	(300,000)	C 1052 HK 5.6385 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(840)	(1)	839
HKD	(130,000)	C 1113 HK 60.804 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(8,489)	(5,099)	3,390
HKD	(850,000)	C 1199 HK 8.6022 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(8,330)	(1,327)	7,003
HKD	(2,000,000)	C 1288 HK 3.465 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(9,400)	(5,481)	3,919
HKD	(2,000,000)	C 1288 HK 3.5595 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(6,200)	(1,478)	4,722
HKD	(250,000)	C 1299 HK 53.8192 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(12,600)	(12,225)	375
HKD	(300,000)	C 1308 HK 4.5217 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(3,300)	(5,218)	(1,918)
HKD	(3,000,000)	C 1398 HK 5.0747 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(16,500)	(15,344)	1,156
HKD	(4,000,000)	C 1398 HK 5.1273 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(21,600)	(13,448)	8,152
HKD	(80,000)	C 16 HK 125.9679 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(5,952)	(3,613)	2,339
HKD	(70,000)	C 16 HK 126.581 04/11/16 OTC	2016年11月4日	(5,236)	(4,462)	774
JPY	(40,000)	C 1605 JT 918.3363 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(2,573)	(10,015)	(7,442)
JPY	(50,000)	C 1605 JT 941.7415 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(4,476)	(5,638)	(1,162)
JPY	(50,000)	C 1605 JT 984.1813 21/10/16 OTC	2016年10月21日	(4,305)	(3,874)	431
HKD	(600,000)	C 177 HK 11.2405 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(5,880)	(3,043)	2,837
HKD	(500,000)	C 177 HK 11.2723 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(4,850)	(4,580)	270
HKD	(600,000)	C 1813 HK 5.4677 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(4,560)	(2,744)	1,816
HKD	(200,000)	C 1928 HK 35.722 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(13,300)	(13,681)	(381)
JPY	(30,000)	C 1928 JT 1815.897 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(3,542)	(3,558)	(16)
JPY	(25,000)	C 1928 JT 1837.9528 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(2,679)	(1,869)	810
JPY	(30,000)	C 1928 JT 1886.8663 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(3,079)	(435)	2,644
KRW	(7,000)	C 204320 KS 271950 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(23,034)	(3,214)	19,820
KRW	(6,000)	C 204320 KS 297201.06 21/10/16 OTC	2016年10月21日	(17,646)	(1,063)	16,583
TWD	(1,000,000)	C 2311 TT 38.948 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(9,300)	(17,439)	(8,139)
TWD	(800,000)	C 2330 TT 191.547 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(34,000)	(31,392)	2,608
TWD	(300,000)	C 2347 TT 35.8838 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(2,190)	(2,943)	(753)
HKD	(410,214)	C 2388 HK 26.2638 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(8,080)	(9,541)	(1,461)

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
TWD	(300,000)	C 2412 TT 115.36 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(1,920)	(81)	1,839
HKD	(200,000)	C 2601 HK 30.1508 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(8,300)	(7,973)	327
JPY	(10,000)	C 2651 JT 8498.0571 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(4,463)	(2,004)	2,459
JPY	(120,000)	C 2768 JT 276.48 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(1,475)	(209)	1,266
TWD	(800,000)	C 2886 TT 22.932 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(4,880)	(497)	4,383
JPY	(30,000)	C 2914 JT 4509.5257 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(2,324)	(2,665)	(341)
HKD	(400,000)	C 321 HK 5.8003 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(4,000)	(621)	3,379
JPY	(9,000)	C 3382 JT 4781.889 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(2,167)	(3,767)	(1,600)
JPY	(8,000)	C 3382 JT 4824.226 03/10/16 OTC	2016年10月3日	(2,298)	(1,283)	1,015
JPY	(9,000)	C 3382 JT 5039.593 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(2,991)	(2,740)	251
JPY	(7,000)	C 3382 JT 5135.4 04/11/16 OTC	2016年11月4日	(2,165)	(1,836)	329
JPY	(40,000)	C 3407 JT 881.4939 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(2,452)	(730)	1,722
JPY	(40,000)	C 3407 JT 886.38 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(1,634)	(1,644)	(10)
JPY	(35,000)	C 3407 JT 913.6323 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(1,638)	(30)	1,608
TWD	(800,000)	C 3702 TT 39.5686 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(2,800)	(1,070)	1,730
HKD	(1,500,000)	C 3818 HK 1.6632 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(2,550)	(716)	1,834
HKD	(4,000,000)	C 386 HK 5.6081 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(20,800)	(63,300)	(42,500)
HKD	(3,000,000)	C 386 HK 5.7131 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(16,800)	(44,488)	(27,688)
HKD	(800,000)	C 3918 HK 5.5226 21/10/16 OTC	2016年10月21日	(8,080)	(4,407)	3,673
HKD	(600,000)	C 3918 HK 5.7766 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(5,640)	(422)	5,218
HKD	(600,000)	C 3918 HK 5.883 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(4,500)	(3)	4,497
HKD	(4,000,000)	C 3988 HK 3.696 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(14,400)	(14,289)	111
JPY	(90,000)	C 4005 JT 528.5265 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(3,423)	(37)	3,386
JPY	(100,000)	C 4005 JT 534.4034 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(4,623)	(282)	4,341
JPY	(80,000)	C 4188 JT 712.225 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(1,927)	(503)	1,424
JPY	(8,000)	C 4452 JT 6022.1708 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(1,938)	(150)	1,788
JPY	(8,000)	C 4452 JT 6056.7832 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(3,068)	(2,387)	681
JPY	(9,000)	C 4452 JT 6059.0916 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(2,888)	(900)	1,988
JPY	(10,000)	C 4452 JT 6168.7207 21/10/16 OTC	2016年10月21日	(3,206)	(1,071)	2,135
JPY	(18,000)	C 4502 JT 4854.6 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(3,785)	(10,248)	(6,463)
JPY	(20,000)	C 4502 JT 4856.5916 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(4,161)	(5,348)	(1,187)
JPY	(19,000)	C 4502 JT 4936.9355 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(3,457)	(8,458)	(5,001)
JPY	(22,000)	C 4502 JT 5148.305 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(3,998)	(4,100)	(102)
JPY	(60,000)	C 4503 JT 1725.1687 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(4,859)	(643)	4,216
JPY	(40,000)	C 4503 JT 1728.3587 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(3,407)	(968)	2,439
JPY	(60,000)	C 4503 JT 1746.9982 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(4,992)	(6)	4,986
JPY	(16,000)	C 4508 JT 2145.8764 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(1,136)	(6,545)	(5,409)
JPY	(16,000)	C 4508 JT 2196.4176 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(1,961)	(6,066)	(4,105)
JPY	(11,000)	C 4519 JT 3537.0775 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(2,060)	(12,041)	(9,981)
JPY	(29,000)	C 4568 JT 2582.8422 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(2,692)	(76)	2,616
JPY	(100,000)	C 4689 JT 449.3042 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(2,870)	(14)	2,856
JPY	(50,000)	C 4902 JT 1028.0968 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(4,044)	(1)	4,043
TWD	(800,000)	C 4915 TT 46.8756 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(8,560)	(14,565)	(6,005)
TWD	(800,000)	C 4915 TT 48.2086 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(8,000)	(11,905)	(3,905)
JPY	(130,000)	C 5020 JT 434.0507 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(2,266)	(597)	1,669

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(50,000)	C 5201 JT 713.9227 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(1,383)	(1,391)	(8)
HKD	(200,000)	C 551 HK 33.2831 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(11,140)	(8,529)	2,611
HKD	(200,000)	C 551 HK 34.763 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(11,380)	(932)	10,448
HKD	(800,000)	C 576 HK 8.9464 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(9,600)	(10)	9,590
HKD	(200,000)	C 590 HK 18.564 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(6,340)	(16,133)	(9,793)
HKD	(200,000)	C 590 HK 19.8818 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(4,060)	(11,739)	(7,679)
TWD	(250,000)	C 6271 TT 120.225 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(16,275)	(11,533)	4,742
TWD	(300,000)	C 6271 TT 131.6461 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(21,840)	(3)	21,837
JPY	(40,000)	C 6301 JT 2403.643 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(7,568)	(1,735)	5,833
JPY	(34,000)	C 6301 JT 2471.2168 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(5,932)	(1,701)	4,231
JPY	(15,000)	C 6460 JT 1523.467 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(1,523)	(1,696)	(173)
JPY	(18,000)	C 6460 JT 1547.8299 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(2,050)	(194)	1,856
JPY	(24,000)	C 6460 JT 1602.0325 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(2,274)	(180)	2,094
JPY	(20,000)	C 6460 JT 1635.1195 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(2,301)	(198)	2,103
JPY	(90,000)	C 6501 JT 512.6661 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(3,423)	(79)	3,344
JPY	(80,000)	C 6501 JT 541.2376 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(4,088)	(56)	4,032
JPY	(50,000)	C 6503 JT 1400.6196 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(5,432)	(3,720)	1,712
JPY	(110,000)	C 6701 JT 299.75 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(2,416)	(25)	2,391
JPY	(100,000)	C 6702 JT 581.9843 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(4,769)	(1,944)	2,825
JPY	(160,000)	C 6702 JT 587.9486 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(6,441)	(70)	6,371
JPY	(35,000)	C 6724 JT 2098.6751 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(6,314)	(1,519)	4,795
JPY	(35,000)	C 6724 JT 2128.28 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(6,633)	(48)	6,585
JPY	(50,000)	C 6752 JT 1180.7477 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(3,368)	0	3,368
HKD	(800,000)	C 6823 HK 11.1465 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(7,120)	(3,240)	3,880
HKD	(800,000)	C 6823 HK 11.452 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(7,280)	(5,957)	1,323
JPY	(140,000)	C 7011 JT 464.8734 03/10/16 OTC	2016年10月3日	(3,676)	0	3,676
JPY	(150,000)	C 7011 JT 494.6169 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(4,688)	(13)	4,675
JPY	(15,000)	C 7203 JT 6535.6998 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(7,395)	0	7,395
JPY	(11,000)	C 7751 JT 3107.7421 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(1,892)	(2)	1,890
JPY	(8,000)	C 7751 JT 3112.955 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(969)	(616)	353
JPY	(11,000)	C 7751 JT 3209.1726 14/10/16 OTC	2016年10月14日	(1,487)	(44)	1,443
JPY	(80,000)	C 8001 JT 1292.973 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(6,083)	(9,036)	(2,953)
JPY	(90,000)	C 8001 JT 1349.028 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(6,145)	(7,140)	(995)
JPY	(40,000)	C 8031 JT 1449.2465 03/10/16 OTC	2016年10月3日	(3,023)	(78)	2,945
JPY	(45,000)	C 8031 JT 1467.4997 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(3,859)	(1,210)	2,649
JPY	(36,000)	C 8031 JT 1482.8201 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(2,469)	(102)	2,367
JPY	(45,000)	C 8031 JT 1497.7659 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(3,166)	(2,293)	873
JPY	(28,000)	C 8058 JT 2285.3049 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(3,252)	(16,150)	(12,898)
JPY	(45,000)	C 8058 JT 2329.344 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(5,980)	(21,770)	(15,790)
JPY	(40,000)	C 8058 JT 2445.7637 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(4,340)	(1,287)	3,053
HKD	(800,000)	C 813 HK 11.7072 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(8,960)	(1,899)	7,061
HKD	(800,000)	C 813 HK 11.847 31/10/16 OTC	2016年10月31日	(13,520)	(3,653)	9,867
JPY	(200,000)	C 8306 JT 572.205 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(6,096)	(3,433)	2,663
JPY	(30,000)	C 8316 JT 3815.07 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(5,792)	(3,606)	2,186
JPY	(280,000)	C 8411 JT 189.97 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(2,383)	(1,017)	1,366

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(6,000)	C 9201 JT 3270.7762 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(1,144)	(286)	858
JPY	(6,500)	C 9201 JT 3389.8262 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(1,224)	(16)	1,208
HKD	(3,000,000)	C 939 HK 6.0848 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(22,500)	(8,040)	14,460
HKD	(3,500,000)	C 939 HK 6.342 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(17,850)	(537)	17,313
HKD	(200,000)	C 941 HK 100.464 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(21,420)	(588)	20,832
HKD	(200,000)	C 941 HK 99.7353 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(25,960)	(8,161)	17,799
JPY	(23,000)	C 9432 JT 4951.7429 19/10/16 OTC	2016年10月19日	(6,883)	(2,003)	4,880
JPY	(20,000)	C 9432 JT 5060.211 04/10/16 OTC	2016年10月4日	(3,603)	0	3,603
JPY	(23,000)	C 9432 JT 5088.4339 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(4,699)	(124)	4,575
JPY	(22,000)	C 9433 JT 3291.4792 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(2,793)	(5,315)	(2,522)
JPY	(20,000)	C 9433 JT 3320.3602 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(2,746)	(103)	2,643
JPY	(26,000)	C 9433 JT 3370.032 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(5,241)	(5,038)	203
JPY	(24,000)	C 9433 JT 3418.678 28/10/16 OTC	2016年10月28日	(2,484)	(2,384)	100
JPY	(40,000)	C 9437 JT 2748.6216 24/10/16 OTC	2016年10月24日	(4,650)	(3,178)	1,472
JPY	(30,000)	C 9437 JT 2788.6045 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(1,704)	(1,790)	(86)
JPY	(45,000)	C 9437 JT 2814.2227 06/10/16 OTC	2016年10月6日	(3,187)	(5)	3,182
JPY	(45,000)	C 9437 JT 2831.755 17/10/16 OTC	2016年10月17日	(3,551)	(421)	3,130
JPY	(110,000)	C 9531 JT 476.5354 18/10/16 OTC	2016年10月18日	(2,586)	(1,332)	1,254
JPY	(100,000)	C 9531 JT 485.1719 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(2,670)	(4)	2,666
JPY	(100,000)	C 9531 JT 488.669 26/10/16 OTC	2016年10月26日	(2,224)	(977)	1,247
JPY	(40,000)	C 9532 JT 429.4951 13/10/16 OTC	2016年10月13日	(570)	(1,329)	(759)
JPY	(40,000)	C 9532 JT 448.804 27/10/16 OTC	2016年10月27日	(1,128)	(552)	576
JPY	(8,000)	C 9735 JT 8100 07/10/16 OTC	2016年10月7日	(2,269)	(14)	2,255
JPY	(7,000)	C 9735 JT 8109.9806 20/10/16 OTC	2016年10月20日	(2,697)	(496)	2,201
JPY	(7,000)	C 9735 JT 8154.1137 02/11/16 OTC	2016年11月2日	(1,771)	(1,240)	531
JPY	(8,000)	C 9735 JT 8353.8174 25/10/16 OTC	2016年10月25日	(2,466)	(263)	2,203
TWD	(100,000)	C 9917 TT 95.069 05/10/16 OTC	2016年10月5日	(1,170)	0	1,170
TWD	(100,000)	C 9917 TT 95.172 12/10/16 OTC	2016年10月12日	(1,570)	(6)	1,564
HKD	(200,000)	C 995 HK 7.4151 11/10/16 OTC	2016年10月11日	(780)	(1)	779
				(16,023,396)	(18,495,167)	(2,471,771)
				(16,023,396)	(18,495,167)	(2,471,771)

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日2016年8月19日）

作成対象期間（2015年8月20日～2016年8月19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	本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、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。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

## ○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	純資産額
		騰	落			
	円		%	%	%	百万円
10期(2012年8月20日)	10,181		0.1	100.7	—	2,216
11期(2013年8月19日)	10,191		0.1	80.9	—	5,297
12期(2014年8月19日)	10,199		0.1	59.7	—	8,648
13期(2015年8月19日)	10,206		0.1	44.7	—	22,034
14期(2016年8月19日)	10,211		0.0	68.6	—	19,722

\*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		
(期首) 2015年8月19日	円 10,206		% —	% 44.7	% —
8月末	10,207		0.0	48.6	—
9月末	10,207		0.0	43.6	—
10月末	10,208		0.0	44.4	—
11月末	10,209		0.0	48.8	—
12月末	10,209		0.0	48.5	—
2016年1月末	10,210		0.0	51.8	—
2月末	10,211		0.0	49.1	—
3月末	10,211		0.0	40.8	—
4月末	10,211		0.0	39.9	—
5月末	10,211		0.0	62.4	—
6月末	10,211		0.0	58.0	—
7月末	10,211		0.0	65.1	—
(期末) 2016年8月19日	10,211		0.0	68.6	—

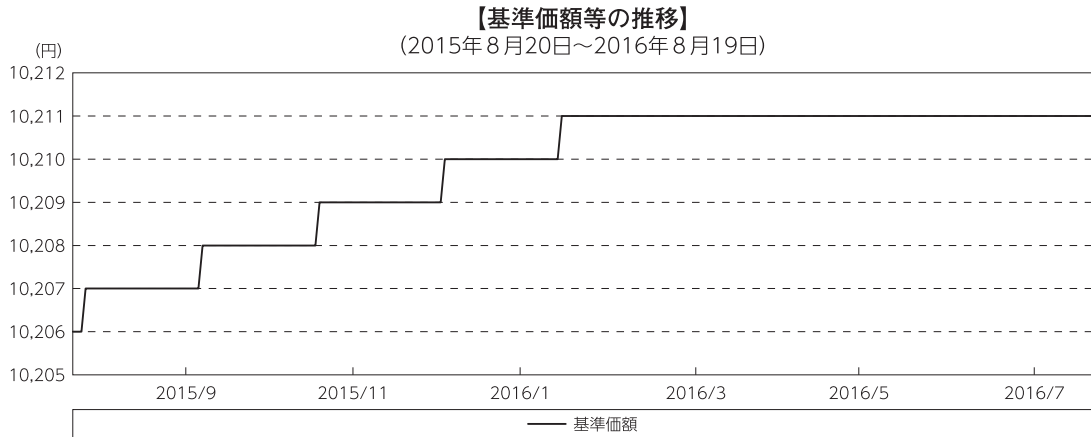
\*騰落率は期首比です。

\*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等からのインカムゲイン（利息収入）。

## ○投資環境

国内経済は、足許の企業収益に弱さがみられるものの、企業収益の水準としては依然として高水準にある事や雇用環境の改善などを受け、基調としては緩やかな回復を続けました。しかしながら、新興国を中心とした海外経済には弱さが見られ、また個人消費の不振が長引く中で物価見通しについても低下するなど、国内経済の下押しリスクがより認識されるようになりました。

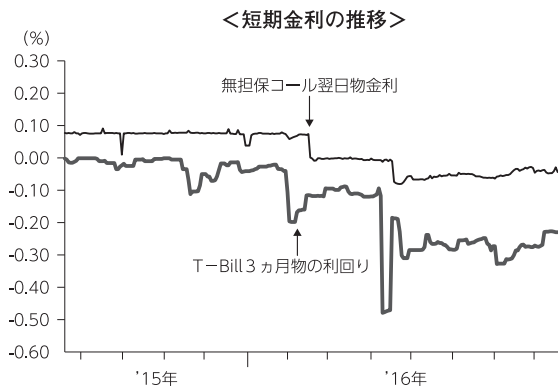
このような中、日本銀行は「量的・質的金融緩和」を継続し、2016年1月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定するなど、一層の金融緩和を図りました。

### ・無担保コール翌日物金利の推移

2016年2月半ば頃まで概ね0.07%台で推移しました。日本銀行当座預金の一部へのマイナス金利の適用が開始された2月16日以降は、概ねゼロ%近傍のマイナス圏で推移しました。無担保コール取引による資金の運用ニーズが高まった4月18日以降、そのマイナス幅は深まりました。

### ・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

日本銀行による買入や海外からの資金流入に伴う需給ひっ迫などにより、期を通じて利回りはマイナス圏で推移しました。日本銀行がマイナス金利導入を決定した2016年1月末以降、利回りは低下し、4月以降についてはマイナス幅が一段と深まりました。



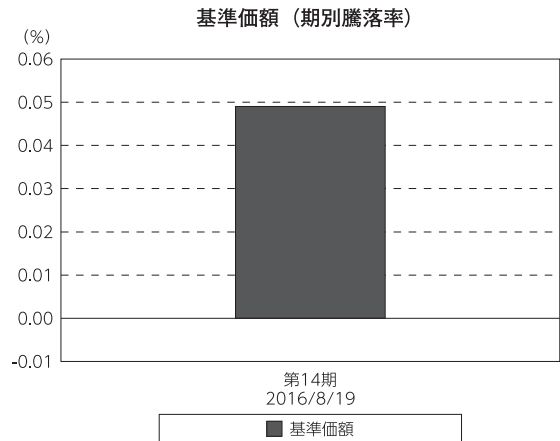
## ○当ファンドのポートフォリオ

- (1) 残存期間の短い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により利息等収益の確保を図り、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図るという方針のもと、運用してまいりました。
- (2) 今期の運用につきましては、残存期間の短い高格付けの公社債等によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローン等により運用してまいりました。

## ○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

今後も、残存期間の短い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、あわせて債券現先取引やコール・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してまいります。

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

(2015年8月20日～2016年8月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、10,209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

(2015年8月20日～2016年8月19日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 42,008,214	千円 38,608,278 (4,580,000)
	地方債証券	8,739,283	— (7,094,300)
	特殊債券	18,846,302	— (15,866,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,709,487	— (3,400,000)

\*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、上段の数字には含まれておりません。

\*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## その他有価証券

		買 付 額	売 付 額
国 内	コマーシャル・ペーパー	千円 5,898,732	千円 — (7,200,000)

\*金額は受け渡し代金。

\*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

(2015年8月20日～2016年8月19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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	34,695	4,630	13.3	—	—	—
預金	231,734	231,734	100.0	231,734	231,734	100.0

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、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年8月19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B B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	%	%	%	%	%	
地方債証券	2,898,010	2,904,779	14.7	—	—	—	14.7
	( 2,898,010)	( 2,904,779)	(14.7)	(—)	(—)	(—)	(14.7)
特殊債券 (除く金融債)	5,325,000	5,333,466	27.0	—	—	—	27.0
	( 5,325,000)	( 5,333,466)	(27.0)	(—)	(—)	(—)	(27.0)
金融債券	3,780,000	3,783,502	19.2	—	—	—	19.2
	( 3,780,000)	( 3,783,502)	(19.2)	(—)	(—)	(—)	(19.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,500,000	1,501,704	7.6	—	—	—	7.6
	( 1,500,000)	( 1,501,704)	( 7.6)	(—)	(—)	(—)	( 7.6)
合 計	13,503,010	13,523,452	68.6	—	—	—	68.6
	(13,503,010)	(13,523,452)	(68.6)	(—)	(—)	(—)	(68.6)

\* ( )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	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
東京都 公募第637回	1.81	200,000	200,273	2016/9/20
東京都 公募第638回	1.9	600,000	600,929	2016/9/20
北海道 公募平成18年度第7回	2.0	1,500	1,505	2016/10/31
北海道 公募平成18年度第10回	1.9	200,000	201,375	2016/12/28
北海道 公募(5年)平成23年度第12回	0.38	5,000	5,007	2017/1/31
北海道 公募(5年)平成23年度第14回	0.35	200,000	200,477	2017/3/23
神奈川県 公募第143回	1.77	100,000	100,596	2016/12/20
神奈川県 公募(5年)第49回	0.37	101,700	101,728	2016/9/20
大阪府 公募第294回	2.0	12,000	12,024	2016/9/28
大阪府 公募第295回	1.9	1,000	1,003	2016/10/28
大阪府 公募(5年)第77回	0.42	100,000	100,071	2016/10/28
兵庫県 公募平成18年度第8回	2.1	200,000	200,060	2016/8/24
埼玉県 公募(5年)平成23年度第5回	0.41	200,000	200,098	2016/9/29
福岡県 公募平成18年度第3回	1.9	1,000	1,003	2016/10/31
千葉県 公募平成18年度第4回	1.8	8,600	8,626	2016/10/25
群馬県 公募第3回	1.9	9,000	9,042	2016/11/25
大分県 公募平成18年度第1回	1.8	198,000	198,709	2016/10/31
共同発行市場地方債 公募第41回	2.0	6,000	6,001	2016/8/25
共同発行市場地方債 公募第43回	1.8	4,000	4,012	2016/10/25
共同発行市場地方債 公募第44回	1.8	100,000	100,476	2016/11/25
島根県 公募平成23年度第1回	0.38	2,500	2,502	2016/11/25
熊本県 公募平成18年度第2回	1.8	7,500	7,524	2016/10/27
名古屋市 公募第456回	1.82	16,000	16,024	2016/9/20
京都市 公募平成23年度第3回	0.364	4,000	4,001	2016/9/29
横浜市 公募平成18年度第3回	1.87	200,000	201,260	2016/12/20
札幌市 公募(5年)平成23年度第5回	0.4	12,900	12,903	2016/9/20
川崎市 公募(5年)第29回	0.36	12,200	12,203	2016/9/20
川崎市 公募(5年)第31回	0.27	2,000	2,002	2017/3/17
北九州市 公募(5年)平成23年度第1回	0.36	7,000	7,002	2016/9/28
福岡市 公募平成23年度第3回	0.39	300,000	300,041	2016/8/26
広島市 公募平成18年度第1回	1.82	6,000	6,037	2016/12/26
仙台市 公募平成23年度第1回	0.36	59,410	59,484	2017/1/27
さいたま市 公募第4回	1.8	5,000	5,030	2016/12/26
鹿児島県 公募平成18年度第1回	1.9	7,200	7,226	2016/10/31
鹿児島県 公募(5年)平成23年度第1回	0.37	8,500	8,505	2016/10/31
小 計		2,898,010	2,904,779	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
政保 地方公共団体金融機構債券(4年)第2回	0.13	200,000	200,017	2016/8/30
日本政策投資銀行債券 政府保証第13回	2.0	290,000	290,093	2016/8/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第17回	2.0	100,000	100,067	2016/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第19回	1.8	700,000	701,332	2016/9/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第21回	1.8	125,000	125,645	2016/11/30
日本政策投資銀行社債 財投機関債第19回	0.445	300,000	300,482	2016/12/20
日本政策投資銀行債券 財投機関債第27回	1.98	100,000	100,172	2016/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第15回	2.05	100,000	100,177	2016/9/20
地方公共団体金融機構債券(5年)第9回	0.34	100,000	100,251	2017/4/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
地方公共団体金融機構債券(2年) 第2回		0.1	200,000	200,179	2017/3/28
公営企業債券 第24回財投機関債		1.94	100,000	100,650	2016/12/20
首都高速道路 第8回		0.439	140,000	140,048	2016/9/20
日本政策金融公庫社債 第20回財投機関債		0.471	900,000	900,378	2016/9/20
日本政策金融公庫社債 第43回財投機関債		0.101	200,000	200,076	2016/11/18
関西国際空港社債 財投機関債第31回		0.504	70,000	70,030	2016/9/20
中部国際空港社債 財投機関債第2回		0.489	1,300,000	1,303,478	2017/2/24
日本学生支援債券 財投機関債第38回		0.1	300,000	300,206	2017/2/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第10回		1.99	100,000	100,176	2016/9/20
小	計		5,325,000	5,333,466	
<b>金融債券</b>					
商工債券 利付第736回い号		0.45	300,000	300,133	2016/9/27
商工債券 利付第737回い号		0.45	200,000	200,156	2016/10/27
商工債券 利付第738回い号		0.45	200,000	200,239	2016/11/25
農林債券 利付第735回い号		0.45	150,000	150,012	2016/8/26
農林債券 利付第736回い号		0.5	750,000	750,407	2016/9/27
農林債券 利付第737回い号		0.5	80,000	80,063	2016/10/27
農林債券 利付第739回い号		0.5	500,000	500,885	2016/12/27
農林債券 利付第742回い号		0.45	200,000	200,540	2017/3/27
しんきん中金債券 利付第261回		0.45	500,000	500,073	2016/8/26
しんきん中金債券 利付第262回		0.45	100,000	100,045	2016/9/27
しんきん中金債券 利付第263回		0.5	100,000	100,093	2016/10/27
しんきん中金債券 利付第266回		0.45	300,000	300,618	2017/1/27
商工債券 利付(3年)第164回		0.2	200,000	200,036	2016/9/27
商工債券 利付(3年)第166回		0.2	100,000	100,052	2016/11/25
商工債券 利付(3年)第171回		0.2	100,000	100,142	2017/4/27
小	計		3,780,000	3,783,502	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
アサヒグループホールディングス 第1回特定社債間限定同順位特約付		0.52	200,000	200,181	2016/10/21
みずほコーポレート銀行 第27回特定社債間限定同順位特約付		0.515	500,000	500,431	2016/10/20
三菱東京UFJ銀行 第129回特定社債間限定同順位特約付		0.465	100,000	100,078	2016/10/20
三菱東京UFJ銀行 第148回特定社債間限定同順位特約付		0.195	100,000	100,041	2016/10/31
三井住友銀行 第55回社債間限定同順位特約付		0.47	100,000	100,083	2016/10/20
トヨタファイナンス 第23回社債間限定同等特約付		1.97	100,000	100,166	2016/9/20
三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付		0.66	400,000	400,720	2016/12/14
小	計		1,500,000	1,501,704	
合	計		13,503,010	13,523,452	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,199,980	% 6.1

\*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。

## ○投資信託財産の構成

(2016年8月19日現在)

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	13,523,452	65.9
その他有価証券	1,199,980	5.8
コール・ローン等、その他	5,800,725	28.3
投資信託財産総額	20,524,157	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 (2016年8月19日現在)

項目	当 期 末
	円
(A) 資産	20,524,157,958
コール・ローン等	5,763,236,241
公社債(評価額)	13,523,452,183
その他有価証券	1,199,980,051
未収利息	16,503,055
前払費用	20,986,428
(B) 負債	801,532,052
未払金	801,524,000
未払利息	8,052
(C) 純資産総額(A-B)	19,722,625,906
元本	19,315,765,955
次期繰越損益金	406,859,951
(D) 受益権総口数	19,315,765,955口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,211円

(注) 期首元本額は21,588,342,274円、期中追加設定元本額は3,803,787,310円、期中一部解約元本額は6,076,363,629円、1口当たり純資産額は1.0211円です。

## ○損益の状況 (2015年8月20日～2016年8月19日)

項目	当 期
	円
(A) 配当等収益	92,619,318
受取利息	92,152,370
その他収益金	1,948,259
支払利息	△ 1,481,311
(B) 有価証券売買損益	△ 83,175,377
売買益	14,438
売買損	△ 83,189,815
(C) 保管費用等	△ 214,563
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,229,378
(E) 前期繰越損益金	445,681,696
(F) 追加信託差損益金	79,665,282
(G) 解約差損益金	△127,716,405
(H) 計(D+E+F+G)	406,859,951
次期繰越損益金(H)	406,859,951

\*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。

## ○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
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッドF30(非課税適格機関投資家専用)	5,423,785,404
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッドF50(適格機関投資家販売制限付)	4,206,288,588
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	4,181,906,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Zプライス(適格機関投資家専用)	2,296,160,091
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家販売制限付)	1,186,053,936
野村DC運用戦略ファンド	379,067,282
ネクストコア	343,183,624
野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	317,657,897

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村世界高金利通貨投信	151,953,753
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06	146,986,772
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネーボールファンド)年2回決算型	113,781,191
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09	98,039,216
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	84,639,967
野村米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	49,578,893
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623
野村新エマージング債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	47,082,117



ファンド名	当期末	円
	元本額	
野村ビクテ・ジェネリック&グノム マネープール・ファンド	33,758,750	
野村新中国株投資 マネープール・ファンド	17,198,352	
野村世界業種別投資シリアルズ(マネープール・ファンド)	10,016,716	
米国変動好金利ファンド Aコース	8,829,589	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネープールファンド)年2回決算型	8,788,959	
野村グローバルCB投信(マネープールファンド)年2回決算型	6,157,226	
野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド	5,393,879	
野村DC運用戦略ファンドM	4,553,821	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(マネープールファンド)年2回決算型	4,315,818	
コインの未来(毎月分配型)	3,965,894	
野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド	3,607,923	
野村・グリーン・テクノロジ マネープール・ファンド	1,511,406	
コインの未来(年2回分配型)	991,474	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	984,834	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	984,834	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834	
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834	
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543	
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543	
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543	
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543	
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543	
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252	
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768	
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768	
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768	
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768	
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768	
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672	
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672	
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672	
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672	
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672	
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672	
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381	
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381	
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381	
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091	
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091	
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091	
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091	
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現物通貨建て債券 Aコース)	982,995	
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898	
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898	
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801	
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609	
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609	
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609	
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609	
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609	
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609	

ファンド名	当期末	円
	元本額	
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609	
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609	
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609	
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609	
野村新世界高金利通貨投資	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608	
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608	
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608	
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608	
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608	
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	982,608	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,608	
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608	
野村PMICO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース	982,608	
野村新エマージング債券投資(円コース)毎月分配型	982,608	
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608	
野村新エマージング債券投資(インドネシアコース)毎月分配型	982,608	
野村新エマージング債券投資(円コース)年2回決算型	982,608	
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608	
野村新エマージング債券投資(中国元コース)年2回決算型	982,608	
野村アジアCB投信(毎月分配型)	982,608	
野村PMICO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608	
野村グローバルREITプレミアム(Aコース)毎月分配型	982,608	
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608	
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608	
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608	
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607	
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,607	
野村新エマージング債券投資(中国元コース)毎月分配型	982,607	
野村PMICO新興国インフラ関連債券投資(円コース)毎月分配型	982,607	
野村PMICO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607	
第12回 野村短期公社債ファンド	982,607	
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415	
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415	
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415	
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415	
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029	
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029	
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029	
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029	
野村カルミニヤック・ファンド Aコース	981,547	
野村カルミニヤック・ファンド Bコース	981,547	
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	981,451	
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	981,451	
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451	

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
米国変動好金利ファンド Bコース	981,066
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 年2回決算型	980,297
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 毎月分配型	588,871
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース) 毎月分配型	294,436
野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース) 年2回決算型	294,436
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 年2回決算型	196,925
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型	196,291
野村通貨選択日本株投信(インドネシアコース) 年2回決算型	196,291
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新興国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村新興国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261
第1回 野村短期公社債ファンド	98,261
第2回 野村短期公社債ファンド	98,261
第3回 野村短期公社債ファンド	98,261
第4回 野村短期公社債ファンド	98,261
第5回 野村短期公社債ファンド	98,261
第6回 野村短期公社債ファンド	98,261
第7回 野村短期公社債ファンド	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
第11回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村新興国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村新興国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,260
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	98,260
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型	98,146
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村新興国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,805
野村新興国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,805
野村新興国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,805
野村新興国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 年2回決算型	9,803
野村新興国高配当株トリプルウィング プラジールAL毎月分配型	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 年2回決算型	4,908
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	1,967
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 毎月分配型	1,963

## ○お知らせ

該当事項はございません。

### <お申し込み時の留意点>

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

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

(2017年5月17日現在)

年 月	日
2017年5月	25、29
6月	5、12、23
7月	4
8月	7、15、28
9月	4
10月	2
11月	1
12月	25、26

※2017年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

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

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