

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72期(決算日2017年12月18日) 第73期(決算日2018年1月17日) 第74期(決算日2018年2月19日)
第75期(決算日2018年3月19日) 第76期(決算日2018年4月17日) 第77期(決算日2018年5月17日)

作成対象期間(2017年11月18日～2018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。 |
| | 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 | 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 証 組 入 | 信 託 比 | 純 資 産 | 額 |
|------------------|-------------|--------|--------|--------|------------------|--------|------------------|--------|------------------|-------------|-------------|---|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 | | | | | | | | |
| | 円 | | 円 | | % | | % | | % | | 百万円 | |
| 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 | |
| 66期(2017年6月19日) | 7,040 | | 50 | | △ 2.0 | 0.0 | — | | 98.8 | | 184,237 | |
| 67期(2017年7月18日) | 7,259 | | 50 | | 3.8 | 0.0 | — | | 99.2 | | 183,049 | |
| 68期(2017年8月17日) | 7,181 | | 50 | | △ 0.4 | 0.0 | — | | 99.1 | | 174,478 | |
| 69期(2017年9月19日) | 7,224 | | 50 | | 1.3 | 0.0 | — | | 99.2 | | 168,663 | |
| 70期(2017年10月17日) | 7,201 | | 50 | | 0.4 | 0.0 | — | | 99.0 | | 162,518 | |
| 71期(2017年11月17日) | 6,958 | | 50 | | △ 2.7 | 0.0 | — | | 99.1 | | 149,739 | |
| 72期(2017年12月18日) | 7,085 | | 50 | | 2.5 | 0.0 | — | | 99.1 | | 146,164 | |
| 73期(2018年1月17日) | 7,485 | | 50 | | 6.4 | 0.0 | — | | 99.0 | | 148,396 | |
| 74期(2018年2月19日) | 7,053 | | 50 | | △ 5.1 | 0.0 | — | | 98.9 | | 132,822 | |
| 75期(2018年3月19日) | 6,927 | | 50 | | △ 1.1 | 0.0 | — | | 99.1 | | 127,111 | |
| 76期(2018年4月17日) | 6,878 | | 50 | | 0.0 | 0.0 | — | | 99.0 | | 122,559 | |
| 77期(2018年5月17日) | 6,797 | | 50 | | △ 0.5 | 0.0 | — | | 98.7 | | 116,194 | |

*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 証 組 入 比 率 | 信 託 券 率 |
|------|-----------------------|------------|--------|-----------|-----------|-------------------|-----------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| 第72期 | (期 首) 2017年11月17日 | 円 6,958 | % — | % 0.0 | % — | % — | % 99.1 |
| | 11月末 | 7,115 | 2.3 | 0.0 | — | — | 99.3 |
| | (期 末) 2017年12月18日 | 7,135 | 2.5 | 0.0 | — | — | 99.1 |
| 第73期 | (期 首) 2017年12月18日 | 7,085 | — | 0.0 | — | — | 99.1 |
| | 12月末 | 7,334 | 3.5 | 0.0 | — | — | 99.0 |
| | (期 末) 2018年 1 月17日 | 7,535 | 6.4 | 0.0 | — | — | 99.0 |
| 第74期 | (期 首) 2018年 1 月17日 | 7,485 | — | 0.0 | — | — | 99.0 |
| | 1 月末 | 7,445 | △0.5 | 0.0 | — | — | 99.0 |
| | (期 末) 2018年 2 月19日 | 7,103 | △5.1 | 0.0 | — | — | 98.9 |
| 第75期 | (期 首) 2018年 2 月19日 | 7,053 | — | 0.0 | — | — | 98.9 |
| | 2 月末 | 7,203 | 2.1 | 0.0 | — | — | 99.4 |
| | (期 末) 2018年 3 月19日 | 6,977 | △1.1 | 0.0 | — | — | 99.1 |
| 第76期 | (期 首) 2018年 3 月19日 | 6,927 | — | 0.0 | — | — | 99.1 |
| | 3 月末 | 6,834 | △1.3 | 0.0 | — | — | 99.1 |
| | (期 末) 2018年 4 月17日 | 6,928 | 0.0 | 0.0 | — | — | 99.0 |
| 第77期 | (期 首) 2018年 4 月17日 | 6,878 | — | 0.0 | — | — | 99.0 |
| | 4 月末 | 6,917 | 0.6 | 0.0 | — | — | 99.0 |
| | (期 末) 2018年 5 月17日 | 6,847 | △0.5 | 0.0 | — | — | 98.7 |

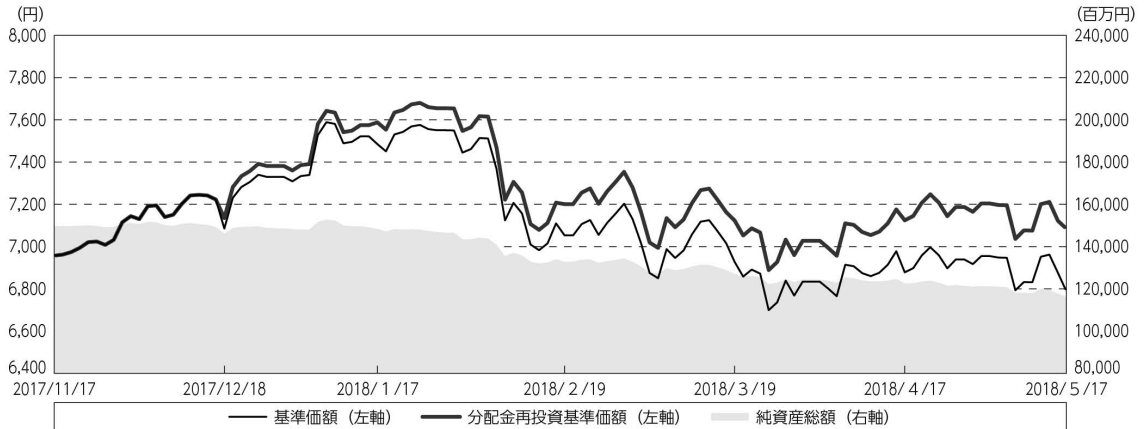
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第72期首：6,958円

第77期末：6,797円（既払分配金（税込み）：300円）

騰落率：1.9%（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（2017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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、当作成期首6,958円から当作成期末には6,797円となりました。

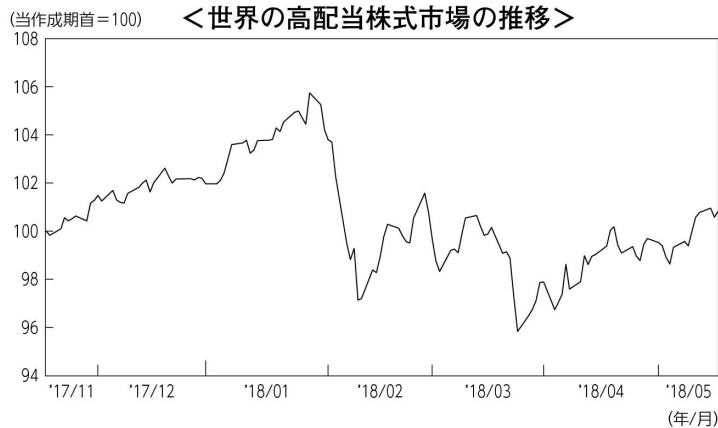
- ・実質的に投資している世界の高配当利回り株式（以下、「高配当株」といいます。）からのインカムゲイン（配当等収益）
- ・実質的に投資している世界の高配当株からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・実質的に保有する高配当株式の銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す『株式プレミアム戦略』による、オプションのプレミアム収入（またはオプションにおける支払い）
- ・円／選定通貨※の為替変動

※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、米国の税制改革法案が成立したことや、好調な米経済指標が発表されたことなどから、世界経済に対し楽観的な見方が強まったことなどを背景に、2018年1月にかけて堅調に推移しました。その後は、1月の米雇用統計において非農業部門雇用者数と賃金の伸びが市場予想を上回ったことから、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げが加速するとの観測が高まり、米国の債券利回りが上昇したことや、米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから軟調に推移しましたが、当作成期間では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>

米国では、米国経済の緩やかな回復を受け、2017年12月及び2018年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。

南アフリカでは、2017年12月に実施された与党アフリカ民族会議（ANC）の党首選において、反汚職や経済の立て直しを掲げるラマポーザ氏が選出されて以降、2018年度予算では付加価値税の引き上げなど財政再建策が講じられたほか、内閣改造により市場からの信任の厚い人材が閣僚に抜擢されており、新政権の経済立て直しへの期待から通貨は堅調に推移しました。

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との対立が続いており、米国とはクーデター未遂事件の捜査に関する対立やトルコ国内の銀行のイラン制裁違反を巡る問題で関係が悪化しています。高進するインフレ率に対し、政治の介入からトルコ中央銀行が有効な金融引締策を取ることが困難であることなども懸念され、通貨は軟調に推移しました。

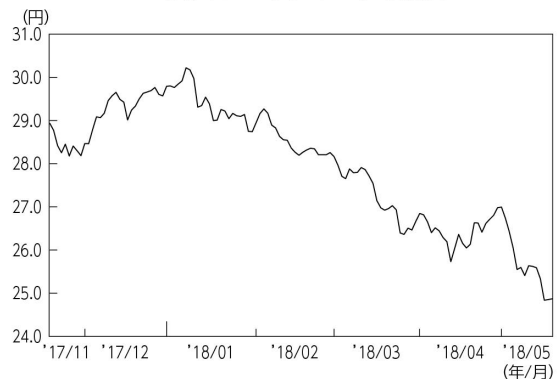
当作成期に通貨セレクトコースにおいて選定した通貨の円に対する為替レートは以下のように推移いたしました。

<円/ブラジルレアル レートの推移>



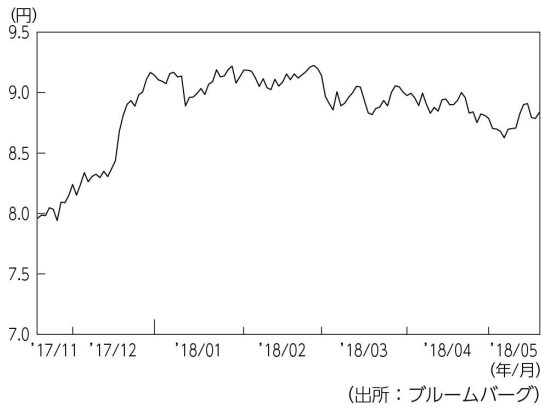
（出所：ブルームバーグ）

<円/トルコリラ レートの推移>



（出所：ブルームバーグ）

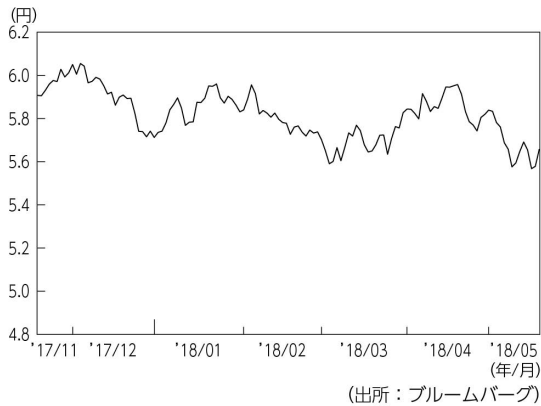
<円/南アフリカランド レートの推移>



<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 | 89.4% |
| カバー率 | 46.4% |
| 平均行使価格 | 100.3% |
| 平均行使期間 | 25.7日 |
| 配当利回り（年率、米ドル為替取引後ベース）* | 3.8% |
| プレミアム（年率） | 3.9% |

・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27.0%、欧州33.0%、アジア・太平洋29.4%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26.4%、生活必需品16.2%、エネルギー9.3%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（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・マーケット・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。

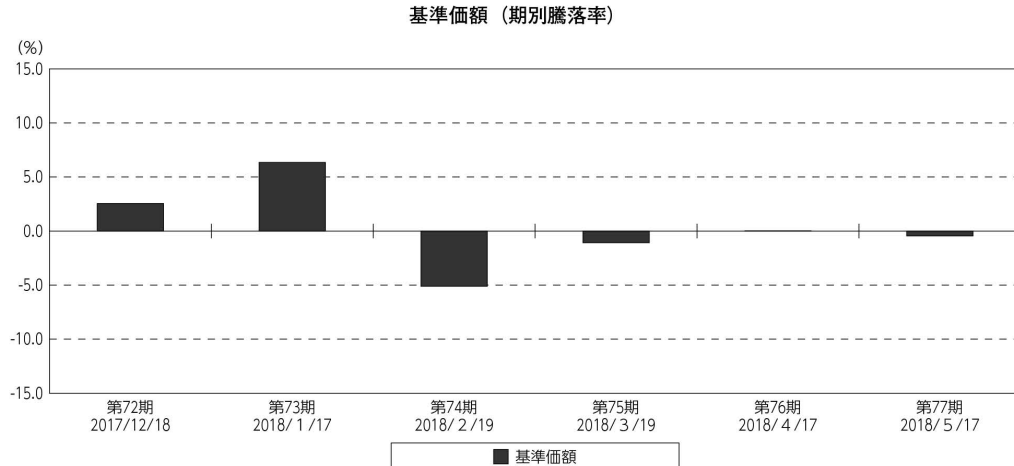
[野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、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72期 | 第73期 | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77期 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2017年11月18日～ 2017年12月18日 | 2017年12月19日～ 2018年1月17日 | 2018年1月18日～ 2018年2月19日 | 2018年2月20日～ 2018年3月19日 | 2018年3月20日～ 2018年4月17日 | 2018年4月18日～ 2018年5月17日 |
| 当期分配金 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 |
| (対基準価額比率) | 0.701% | 0.664% | 0.704% | 0.717% | 0.722% | 0.730% |
| 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 | 8,303 | 8,330 | 8,352 | 8,375 | 8,398 | 8,421 |

(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・エマーシング・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1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、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。

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

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

○1万口当たりの費用明細

(2017年11月18日～2018年5月17日)

| 項 目 | 第72期～第77期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 34 | % 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 ） | (19) | (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 | 34 | 0.473 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,141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

(2017年11月18日～2018年5月17日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 第72期～第77期 | | | |
|-----|---|-----------|---------|----------------|------------------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | 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 | 口 — | 千円 — | 口 6,402,567 | 千円 29,273,110 |

*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

(2017年11月18日～2018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72期～第77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 9,954 | 百万円 703 | % 7.1 | 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

(2018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71期末 | 第77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 | 口 32,988,983 | 口 26,586,416 | 千円 114,667,212 | % 98.7 |
| 合 計 | 32,988,983 | 26,586,416 | 114,667,212 | 98.7 |

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 第71期末 | 第77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

(2018年5月17日現在)

| 項 | 目 | 第77期末 | |
|---------------|---|-------------|-------|
| | | 評価額 | 比率 |
| | | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | | 114,667,212 | 96.9 |
| 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 | | 3,665,198 | 3.1 |
| 投資信託財産総額 | | 118,333,413 | 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72期末 | 第73期末 | 第74期末 | 第75期末 | 第76期末 | 第77期末 |
|----------------|--------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | | 2017年12月18日現在 | 2018年1月17日現在 | 2018年2月19日現在 | 2018年3月19日現在 | 2018年4月17日現在 | 2018年5月17日現在 |
| | | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | | 149,292,014,119 | 151,190,859,970 | 134,722,235,320 | 128,975,935,532 | 124,862,760,698 | 118,333,413,413 |
| | コール・ローン等 | 3,442,084,843 | 3,235,273,747 | 2,291,478,137 | 2,339,459,618 | 2,154,158,361 | 2,329,064,845 |
| | 投資信託受益証券(評価額) | 144,910,001,640 | 146,871,471,732 | 131,330,768,613 | 125,955,049,650 | 121,288,101,309 | 114,667,212,208 |
| | 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,003,539 | 1,003,539 | 1,003,440 | 1,003,440 | 1,003,440 | 1,003,440 |
| | 未収入金 | 938,924,097 | 1,083,110,952 | 1,098,985,130 | 680,422,824 | 1,419,497,588 | 1,336,132,920 |
| (B) 負債 | | 3,127,858,858 | 2,794,069,823 | 1,900,040,066 | 1,864,068,222 | 2,302,951,338 | 2,139,180,103 |
| | 未払収益分配金 | 1,031,506,509 | 991,262,266 | 941,637,775 | 917,541,221 | 891,009,206 | 854,700,678 |
| | 未払解約金 | 1,974,688,304 | 1,685,666,419 | 835,957,490 | 850,678,086 | 1,317,544,620 | 1,189,663,151 |
| | 未払信託報酬 | 121,247,043 | 116,739,506 | 122,025,944 | 95,519,271 | 94,073,206 | 94,490,157 |
| | 未払利息 | 3,669 | 3,666 | 2,870 | 4,018 | 3,612 | 3,999 |
| | その他未払費用 | 413,333 | 397,966 | 415,987 | 325,626 | 320,694 | 322,118 |
| (C) 純資産総額(A-B) | | 146,164,155,261 | 148,396,790,147 | 132,822,195,254 | 127,111,867,310 | 122,559,809,360 | 116,194,233,310 |
| | 元本 | 206,301,301,810 | 198,252,453,357 | 188,327,555,011 | 183,508,244,216 | 178,201,841,303 | 170,940,135,775 |
| | 次期繰越損益金 | △ 60,137,146,549 | △ 49,855,663,210 | △ 55,505,359,757 | △ 56,396,376,906 | △ 55,642,031,943 | △ 54,745,902,465 |
| (D) 受益権総口数 | | 206,301,301,810口 | 198,252,453,357口 | 188,327,555,011口 | 183,508,244,216口 | 178,201,841,303口 | 170,940,135,775口 |
| | 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,085円 | 7,485円 | 7,053円 | 6,927円 | 6,878円 | 6,797円 |

(注) 第72期首元本額は215,214,276,883円、第72～77期中追加設定元本額は3,845,952,947円、第72～77期中一部解約元本額は48,120,094,055円、1口当たり純資産額は、第72期0.7085円、第73期0.7485円、第74期0.7053円、第75期0.6927円、第76期0.6878円、第77期0.6797円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第72期 | 第73期 | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77期 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2017年11月18日～ 2017年12月18日 | 2017年12月19日～ 2018年1月17日 | 2018年1月18日～ 2018年2月19日 | 2018年2月20日～ 2018年3月19日 | 2018年3月20日～ 2018年4月17日 | 2018年4月18日～ 2018年5月17日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,580,935,904 | 1,529,101,763 | 1,455,175,308 | 1,422,384,997 | 1,387,793,660 | 1,332,612,700 |
| 受取配当金 | 1,581,011,728 | 1,529,168,906 | 1,455,254,856 | 1,422,469,833 | 1,387,874,584 | 1,332,689,232 |
| 支払利息 | △ 75,824 | △ 67,143 | △ 79,548 | △ 84,836 | △ 80,924 | △ 76,532 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,169,006,605 | 7,486,270,707 | △ 8,556,359,445 | △ 2,732,075,467 | △ 1,282,997,269 | △ 1,771,432,684 |
| 売買益 | 2,297,417,101 | 7,709,321,552 | 129,482,438 | 31,663,140 | 53,480,331 | 43,179,634 |
| 売買損 | △ 128,410,496 | △ 223,050,845 | △ 8,685,841,883 | △ 2,763,738,607 | △ 1,336,477,600 | △ 1,814,612,318 |
| (C) 信託報酬等 | △ 121,660,376 | △ 117,137,472 | △ 122,441,931 | △ 95,844,897 | △ 94,393,900 | △ 94,812,275 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,628,282,133 | 8,898,234,998 | △ 7,223,626,068 | △ 1,405,535,367 | 10,402,491 | △ 533,632,259 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 79,695,228,183 | △ 73,831,092,792 | △ 62,475,824,252 | △ 68,639,530,635 | △ 68,588,989,803 | △ 66,378,023,941 |
| (F) 追加信託差損益金 | 16,961,306,010 | 16,068,456,850 | 15,135,728,338 | 14,566,230,317 | 13,827,564,575 | 13,020,454,413 |
| (配当等相当額) | (137,218,326,299) | (131,973,576,911) | (125,430,841,065) | (122,304,078,470) | (118,904,858,589) | (114,168,875,461) |
| (売買損益相当額) | (△120,257,020,289) | (△115,905,120,061) | (△110,295,112,727) | (△107,737,848,153) | (△105,077,294,014) | (△101,148,421,048) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 59,105,640,040 | △ 48,864,400,944 | △ 54,563,721,982 | △ 55,478,835,685 | △ 54,751,022,737 | △ 53,891,201,787 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,031,506,509 | △ 991,262,266 | △ 941,637,775 | △ 917,541,221 | △ 891,009,206 | △ 854,700,678 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 60,137,146,549 | △ 49,855,663,210 | △ 55,505,359,757 | △ 56,396,376,906 | △ 55,642,031,943 | △ 54,745,902,465 |
| 追加信託差損益金 | 16,961,306,010 | 16,068,456,850 | 15,135,728,338 | 14,566,230,317 | 13,827,564,575 | 13,020,454,413 |
| (配当等相当額) | (137,218,326,299) | (131,973,576,912) | (125,430,841,065) | (122,304,078,470) | (118,904,858,590) | (114,168,875,462) |
| (売買損益相当額) | (△120,257,020,289) | (△115,905,120,062) | (△110,295,112,727) | (△107,737,848,153) | (△105,077,294,015) | (△101,148,421,049) |
| 分配準備積立金 | 34,082,330,831 | 33,178,568,046 | 31,866,221,656 | 31,387,635,276 | 30,757,202,696 | 29,793,114,261 |
| 繰越損益金 | △111,180,783,390 | △ 99,102,688,106 | △102,507,309,751 | △102,350,242,499 | △100,226,799,214 | △ 97,559,471,139 |

* 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(2017年11月18日～2018年5月17日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第72期 | 第73期 | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77期 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2017年11月18日～ 2017年12月18日 | 2017年12月19日～ 2018年1月17日 | 2018年1月18日～ 2018年2月19日 | 2018年2月20日～ 2018年3月19日 | 2018年3月20日～ 2018年4月17日 | 2018年4月18日～ 2018年5月17日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 1,529,644,167円 | 1,509,235,548円 | 1,332,733,638円 | 1,326,540,387円 | 1,293,400,074円 | 1,237,800,736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 | 137,218,326,299円 | 131,973,576,912円 | 125,430,841,065円 | 122,304,078,470円 | 118,904,858,590円 | 114,168,875,462円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 33,584,193,173円 | 32,660,594,764円 | 31,475,125,793円 | 30,978,636,110円 | 30,354,811,828円 | 29,410,014,203円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 172,332,163,639円 | 166,143,407,224円 | 158,238,700,496円 | 154,609,254,967円 | 150,553,070,492円 | 144,816,690,401円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 8,353円 | 8,380円 | 8,402円 | 8,425円 | 8,448円 | 8,471円 |
| g. 分配金 | 1,031,506,509円 | 991,262,266円 | 941,637,775円 | 917,541,221円 | 891,009,206円 | 854,700,678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72期 | 第73期 | 第74期 | 第75期 | 第76期 | 第77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

（2018年5月17日現在）

<野村マネー マザーファンド>

下記は、野村マネー マザーファンド全体（15,574,560千口）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77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 | 1,246,000 (1,246,000) | 1,247,766 (1,247,766) | 7.8 (7.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 7.8 (7.8) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 1,683,000 (1,683,000) | 1,684,568 (1,684,568) | 10.6 (10.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 10.6 (10.6) |
| 金融債券 | 1,340,000 (1,340,000) | 1,340,264 (1,340,264) | 8.4 (8.4) | — (—) | — (—) | — (—) | 8.4 (8.4) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 2,900,000 (2,900,000) | 2,905,841 (2,905,841) | 18.3 (18.3) | — (—) | — (—) | — (—) | 18.3 (18.3) |
| 合 計 | 7,169,000 (7,169,000) | 7,178,440 (7,178,440) | 45.2 (45.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 45.2 (45.2) |

*（ ）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 | 柄 | 第77期末 | | | |
|-------------------------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 大阪府 公募第315回 | | 1.95 | 450,000 | 450,940 | 2018/6/27 |
| 大阪府 公募（5年）第96回 | | 0.318 | 500,000 | 500,317 | 2018/7/30 |
| 大阪市 公募平成20年度第2回 | | 1.95 | 296,000 | 296,508 | 2018/6/20 |
| 小計 | | | 1,246,000 | 1,247,766 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 公営企業債券 政府保証第885回 | | 1.7 | 33,000 | 33,008 | 2018/5/22 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第35回 | | 0.265 | 100,000 | 100,026 | 2018/6/20 |
| 日本政策投資銀行債券 財投機関債第51回 | | 1.84 | 100,000 | 100,174 | 2018/6/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第40回 | | 1.69 | 500,000 | 500,797 | 2018/6/20 |
| 地方公共団体金融機構債券 F39回 | | 0.808 | 100,000 | 100,228 | 2018/8/28 |
| 公営企業債券 第30回財投機関債 | | 1.97 | 100,000 | 100,178 | 2018/6/20 |
| 日本政策金融公庫社債 第55回財投機関債 | | 0.001 | 400,000 | 400,004 | 2018/8/9 |
| 東日本高速道路 第21回 | | 0.58 | 100,000 | 100,053 | 2018/6/20 |
| 東日本高速道路 第22回 | | 0.401 | 250,000 | 250,098 | 2018/6/20 |
| 小計 | | | 1,683,000 | 1,684,568 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 利付第756回い号 | | 0.3 | 400,000 | 400,046 | 2018/5/25 |
| 商工債券 利付第758回い号 | | 0.4 | 100,000 | 100,076 | 2018/7/27 |
| 農林債券 利付第756回い号 | | 0.3 | 590,000 | 590,059 | 2018/5/25 |
| 農林債券 利付第757回い号 | | 0.35 | 100,000 | 100,041 | 2018/6/27 |
| しんきん中金債券 利付第282回 | | 0.3 | 50,000 | 50,006 | 2018/5/25 |
| 商工債券 利付（3年）第186回 | | 0.16 | 100,000 | 100,033 | 2018/7/27 |
| 小計 | | | 1,340,000 | 1,340,264 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| 中部電力 第476回 | | 2.12 | 100,000 | 100,220 | 2018/6/25 |
| 関西電力 第448回 | | 2.16 | 100,000 | 100,197 | 2018/6/20 |
| 関西電力 第469回 | | 1.7 | 300,000 | 302,217 | 2018/10/25 |
| 中国電力 第354回 | | 1.905 | 100,000 | 100,046 | 2018/5/25 |
| 九州電力 第343回 | | 2.825 | 100,000 | 100,066 | 2018/5/25 |
| 北海道電力 第264回 | | 2.6 | 100,000 | 100,273 | 2018/6/25 |
| 北海道電力 第296回 | | 2.027 | 100,000 | 100,214 | 2018/6/25 |
| 三菱商事 第69回担保提供制限等財務上特約無 | | 1.99 | 200,000 | 200,062 | 2018/5/22 |
| 三菱東京UFJ銀行 第146回特定社債間限定同順位特約付 | | 0.355 | 300,000 | 300,200 | 2018/7/24 |
| 日産フィナンシャルサービス 第34回社債間限定同順位特約付 | | 0.165 | 100,000 | 100,014 | 2018/6/20 |
| ホンダファイナンス 第25回社債間限定同順位特約付 | | 0.554 | 100,000 | 100,049 | 2018/6/20 |
| 日立キャピタル 第46回社債間限定同順位特約付 | | 0.447 | 200,000 | 200,083 | 2018/6/20 |
| 三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付 | | 0.442 | 300,000 | 300,291 | 2018/8/6 |
| 京浜急行電鉄 第36回社債間限定同順位特約付 | | 0.453 | 100,000 | 100,032 | 2018/6/12 |
| N T T ドコモ 第15回社債間限定同順位特約付 | | 1.96 | 200,000 | 200,352 | 2018/6/20 |
| N T T ドコモ 第17回社債間限定同順位特約付 | | 1.77 | 200,000 | 201,206 | 2018/9/20 |
| 電源開発 第36回社債間限定同順位特約付 | | 0.717 | 100,000 | 100,010 | 2018/5/18 |
| 東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付 | | 2.625 | 200,000 | 200,300 | 2018/6/11 |
| 小計 | | | 2,900,000 | 2,905,841 | |
| 合計 | | | 7,169,000 | 7,178,440 | |

*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77期末 | |
|-------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 3,399,999 | % 21.4 |

*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

2017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"> ◆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。 ◆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。 | | | | | | | | | | |
| 投 資 態 度 | <ul style="list-style-type: none"> ●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。 ●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。 <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 25%;">地域名</td> <td style="width: 25%;">米州</td> <td style="width: 25%;">欧州</td> <td style="width: 25%;">アジア・太平洋</td> </tr> <tr> <td>投資比率</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> </tr> </table> | | | 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% | | | | | | | | |
| <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"> ●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。 ●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。 ※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。 ●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。 ●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、原則として当該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。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、米ドルを売り、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)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。 <p><通貨セレクトクラスにおける通貨運用方針></p> <ul style="list-style-type: none"> ●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。 ●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。 ●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。 ●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。 ●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。 ●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。 ●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。 | | | | | | | | | | | |
| 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
2017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 (取得原価 : 1,487,745,969米ドル) | 1,614,718,170 |
| 現金預金等 | 213,180,019 |
| 先物契約に係る評価差益 | 389,025 |
| デリバティブに係る委託証拠金 | 428,055 |
| ブローカーからの未収金 | 5,399,752 |
| 未収収益 | 3,086,589 |
| 現金および現金等価物に係る利息 | 5,463 |
| | 1,837,207,073 |
| 資産合計 | |
| | 1,837,207,073 |
| 負債 | |
| 投資オプション契約時価(売り) (取得原価 : 9,170,326米ドル) | 13,365,328 |
| 銀行借越金 | 1,849,483 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損 | 26,374,712 |
| 受益証券買戻支払金 | 10,567,303 |
| ブローカーへの未払金 | 2,736,177 |
| 未払費用 | 5,032,121 |
| | 59,925,124 |
| 負債合計 | |
| | 59,925,124 |
| 純資産総額 | 1,777,281,949 |

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) | 10,129 | 510,042 | 5,166,277,871 |
| 通貨セレクトクラス(円) | 4,725 | 37,294,220 | 176,198,062,233 |

運用計算書
2017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 | 1,481,216 |
| 受取配当金等 | 57,245,989 |
| 雑収益 | 360,408 |
| | 59,087,613 |
| 収益合計 | 59,087,613 |
| 費用 | |
| 投資顧問報酬 | 18,849,218 |
| 事務管理代行報酬 | 2,094,863 |
| 保管費用 | 629,382 |
| 当座借越利息 | 111,630 |
| 取引銀行報酬 | 430,530 |
| 銀行手数料 | 134,949 |
| 受託報酬 | 419,391 |
| 法務報酬 | 10,638 |
| 立替費用 | 418,889 |
| 専門家報酬 | 49,332 |
| 雑費用 | 344,724 |
| | 23,493,546 |
| 費用合計 | 23,493,546 |
| 純投資損益 | 35,594,067 |
| 投資有価証券売買に係る損益 | (13,236,486) |
| 先物契約に係る損益 | 4,853,176 |
| オプション契約に係る損益 | (19,467,814) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | 136,106,864 |
| | 108,255,740 |
| 当期実現純損益 | 108,255,740 |
| 投資有価証券評価損益の増減 | 229,649,263 |
| 先物契約に係る評価損益の増減 | (257,828) |
| オプション契約に係る評価損益の増減 | (1,723,231) |
| 外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減 | 14,612,066 |
| | 242,280,270 |
| 当期評価差損益 | 242,280,270 |
| 運用の結果による純資産の増減額 | 386,130,077 |

純資産変動計算書
2017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 | 2,468,069,953 |
| 純投資損益 | 35,594,067 |
| 当期実現純損益 | 108,255,740 |
| 当期評価差損益 | 242,280,270 |
| 運用の結果による純資産の増減額 | 386,130,077 |
| 受益証券の発行手取金 | 46,674,248 |
| 受益証券の買戻支払金 | (834,025,032) |
| | (787,350,784) |
| 受益者への支払分配金 | (289,567,297) |
| 期末純資産総額 | 1,777,281,949 |

発行済受益証券数の変動表
2017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 | 652,143 |
| 発行受益証券数 | 74,906 |
| 買戻受益証券数 | (217,007) |
| | |
| 期末発行済受益証券数 | 510,042 |

通貨セレクトクラス

| | |
|------------|--------------|
| 期首受益証券数 | 55,345,590 |
| 発行受益証券数 | 270,378 |
| 買戻受益証券数 | (18,321,748) |
| | |
| 期末発行済受益証券数 | 37,294,220 |

統計情報
2017年9月30日現在
(未監査)

| | 2017 | 2016 | 2015 |
|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 期末純資産総額(米ドル) | 1,777,281,949 | 2,468,069,953 | 3,076,169,466 |
| 日本円クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 5,166,277,871 | 6,374,743,758 | 7,436,449,560 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 10,129 | 9,775 | 10,082 |
| 通貨セレクトクラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 176,198,062,233 | 220,175,129,656 | 334,146,275,354 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 4,725 | 3,978 | 6,216 |

組入資産明細
2017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(%) |
|------|-----------|-----------------------------------|-------------|-------------|---------|
| | | オーストラリア | | | |
| 普通株式 | | | | | |
| | 339,533 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA * | 21,270,386 | 20,046,420 | 1.13 |
| | 795,487 | WESTPAC BANKING CORP | 19,807,078 | 19,922,521 | 1.12 |
| | 734,433 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING * | 16,365,554 | 17,056,590 | 0.96 |
| | 5,930,637 | SOUTH32 LTD | 12,888,080 | 15,283,913 | 0.86 |
| | 191,115 | RIO TINTO LTD | 8,419,443 | 9,976,097 | 0.56 |
| | 590,110 | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 6,936,685 | 9,723,008 | 0.55 |
| | 462,212 | WOOLWORTHS LTD | 8,704,648 | 9,142,446 | 0.51 |
| | 423,582 | BHP BILLITON (AUD) * | 8,465,222 | 8,567,789 | 0.48 |
| | 780,442 | TRANSURBAN GROUP | 6,656,251 | 7,274,538 | 0.41 |
| | 2,103,582 | SCENTRE GROUP | 6,950,973 | 6,486,350 | 0.36 |
| | 642,662 | CHALLENGER LTD | 5,605,341 | 6,277,697 | 0.35 |
| | 791,400 | QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 6,976,007 | 6,215,534 | 0.35 |
| | 248,892 | NTL AUSTRALIA BANK LTD * | 5,981,902 | 6,151,342 | 0.35 |
| | 84,265 | MACQUARIE GROUP LTD | 5,230,719 | 6,011,115 | 0.34 |
| | 855,888 | GOODMAN GROUP STAPLED | 4,885,165 | 5,533,406 | 0.31 |
| | 3,027,663 | MIRVAC GROUP | 5,030,617 | 5,439,906 | 0.31 |
| | 447,122 | AMCOR LTD | 5,099,754 | 5,335,850 | 0.30 |
| | 872,862 | ORIGIN ENERGY LTD | 4,945,495 | 5,122,660 | 0.29 |
| | 288,057 | NEWCREST MINING LTD | 4,645,394 | 4,750,721 | 0.27 |
| | 470,157 | BLUESCOPE STEEL LTD | 4,249,756 | 4,046,671 | 0.23 |
| | 354,318 | TREASURY WINE ESTATES LTD | 3,077,102 | 3,805,792 | 0.21 |
| | 160,047 | WOODSIDE PETROLEUM LIMITED | 3,814,342 | 3,654,171 | 0.21 |
| | 687,898 | BORAL LIMITED | 3,310,387 | 3,653,937 | 0.21 |
| | 67,395 | REA GROUP LTD | 3,164,336 | 3,542,834 | 0.20 |
| | 1,348,232 | ORORA LTD | 3,028,676 | 3,279,251 | 0.18 |
| | 590,149 | DOWNER EDI LIMITED | 2,817,865 | 3,134,720 | 0.18 |
| | 29,663 | CSL LTD | 2,342,020 | 3,117,730 | 0.18 |
| | 1,295,094 | MEDIBANK PRIVATE LTD | 2,893,175 | 2,967,102 | 0.17 |
| | 82,887 | JANUS HENDER CDI | 2,768,475 | 2,857,557 | 0.16 |
| | 754,417 | SANTOS LTD | 2,309,769 | 2,379,501 | 0.13 |
| | 48,013 | WESFARMERS LIMITED | 1,565,505 | 1,556,943 | 0.09 |
| | 29,956 | RAMSAY HEALTH CARE LIMITED | 1,621,003 | 1,463,797 | 0.08 |
| | 516,218 | SOUTH32 LTD | 1,074,455 | 1,324,431 | 0.07 |
| | 404,853 | TELSTRA CORPORATION LIMITED | 1,826,639 | 1,108,590 | 0.06 |
| | 151,112 | ALS LTD | 812,807 | 927,159 | 0.05 |
| | 87,332 | BANK OF QUEENSLAND LTD | 816,373 | 889,399 | 0.05 |
| | | | 206,357,399 | 218,027,488 | 12.27 |
| | | 合計：オーストラリア | 206,357,399 | 218,027,488 | 12.27 |

| | 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|------|------------|---------------------------------|------------|------------|---------|
| | | ベルギー | | | |
| 普通株式 | 503,271 | AGEAS NV | 17,676,426 | 23,579,105 | 1.33 |
| | | | 17,676,426 | 23,579,105 | 1.33 |
| | | 合計：ベルギー | 17,676,426 | 23,579,105 | 1.33 |
| | | バミューダ諸島 | | | |
| 普通株式 | 64,350 | XL GROUP LTD | 2,204,297 | 2,549,546 | 0.14 |
| | 357,000 | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG LTD | 1,242,781 | 1,357,438 | 0.08 |
| | 335,000 | LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD | 991,765 | 1,353,130 | 0.08 |
| | 454,000 | YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE | 306,284 | 341,185 | 0.02 |
| | | | 4,745,127 | 5,601,299 | 0.32 |
| | | 合計：バミューダ諸島 | 4,745,127 | 5,601,299 | 0.32 |
| | | ブラジル | | | |
| 普通株式 | 521,060 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA SP ADR | 4,400,807 | 7,128,100 | 0.41 |
| | 550,300 | PETROLEO BRASILEIRO S.A ADR | 4,770,103 | 5,571,788 | 0.31 |
| | 183,718 | BANCO BRADESCO SPONSORED ADR | 1,110,795 | 2,022,735 | 0.11 |
| | | | 10,281,705 | 14,722,623 | 0.83 |
| | | 合計：ブラジル | 10,281,705 | 14,722,623 | 0.83 |
| | | カナダ | | | |
| 普通株式 | 20,000 | SUNCOR ENERGY INC | 615,648 | 697,500 | 0.04 |
| | | | 615,648 | 697,500 | 0.04 |
| | | 合計：カナダ | 615,648 | 697,500 | 0.04 |
| | | ケイマン諸島 | | | |
| 普通株式 | 468,000 | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 5,687,519 | 5,982,591 | 0.33 |
| | 712,000 | SANDS CHINA LTD | 3,455,653 | 3,705,407 | 0.21 |
| | 1,400,000 | SHIMAO PROPERTY HOLDING LTD | 2,989,978 | 3,036,245 | 0.17 |
| | 1,929,000 | LEE & MAN MANUFACT LTD (HKD) | 1,503,524 | 2,469,605 | 0.14 |
| | 7,030,000 | CHINA DONGXIANG GROUP CO | 1,462,354 | 1,224,023 | 0.07 |
| | 830,000 | PACIFIC TEXTILES HOLDINGS LTD | 1,091,433 | 852,212 | 0.05 |
| | 936,000 | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 522,344 | 848,407 | 0.05 |
| | | | 16,712,805 | 18,118,490 | 1.02 |
| | | 合計：ケイマン諸島 | 16,712,805 | 18,118,490 | 1.02 |
| | | 中国 | | | |
| 普通株式 | 12,423,000 | CHINA CONSTRUCTION BANK H | 9,585,290 | 10,306,159 | 0.57 |
| | 17,229,000 | BANK OF CHINA LTD H | 7,995,824 | 8,492,120 | 0.48 |

| | 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|------|-----------|------------------------------------|------------|------------|---------|
| | 9,060,000 | IND & COMM BANK OF CHINA LTD H | 5,875,551 | 6,727,466 | 0.38 |
| | 4,959,000 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA H | 2,271,322 | 2,222,069 | 0.13 |
| | 2,118,000 | CHINA PETROL & CHEM CORP SINOPEC H | 1,536,357 | 1,586,270 | 0.09 |
| | 386,000 | JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H | 429,296 | 591,036 | 0.03 |
| | | | 27,693,640 | 29,925,120 | 1.68 |
| | | 合計：中国 | 27,693,640 | 29,925,120 | 1.68 |
| | | チェコ | | | |
| 普通株式 | 23,477 | PHILIP MORRIS CR AS | 11,589,036 | 17,631,668 | 0.99 |
| | | | 11,589,036 | 17,631,668 | 0.99 |
| | | 合計：チェコ | 11,589,036 | 17,631,668 | 0.99 |
| | | デンマーク | | | |
| 普通株式 | 328,533 | D/S NORDEN AS | 7,194,218 | 7,012,062 | 0.39 |
| | | | 7,194,218 | 7,012,062 | 0.39 |
| | | 合計：デンマーク | 7,194,218 | 7,012,062 | 0.39 |
| | | フィンランド | | | |
| 普通株式 | 1,175,998 | FORTUM OYJ | 18,302,605 | 23,356,630 | 1.31 |
| | | | 18,302,605 | 23,356,630 | 1.31 |
| | | 合計：フィンランド | 18,302,605 | 23,356,630 | 1.31 |
| | | フランス | | | |
| 普通株式 | 258,710 | SANOFI | 21,882,684 | 25,529,629 | 1.43 |
| | 232,117 | BNP PARIBAS | 13,333,186 | 18,610,139 | 1.05 |
| | 1,404,835 | COFACE SA | 11,912,159 | 15,094,030 | 0.85 |
| | 348,755 | ALSTOM | 10,964,083 | 14,663,630 | 0.83 |
| | 103,261 | CIE DE SAINT GOBAIN | 4,534,516 | 6,083,217 | 0.34 |
| | 759,092 | VALLOUREC | 6,342,247 | 4,470,998 | 0.25 |
| | 20,669 | VINCI SA | 1,316,844 | 1,958,451 | 0.11 |
| | | | 70,285,719 | 86,410,094 | 4.86 |
| | | 合計：フランス | 70,285,719 | 86,410,094 | 4.86 |
| | | ドイツ | | | |
| 普通株式 | 448,278 | BILFINGER BERGER AG | 22,257,870 | 18,771,477 | 1.06 |
| | | | 22,257,870 | 18,771,477 | 1.06 |
| | | 合計：ドイツ | 22,257,870 | 18,771,477 | 1.06 |

| | 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|-----------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| | | 香港 | | | |
| 普通株式 | | | | | |
| | 439,000 | SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | 6,077,197 | 7,132,166 | 0.41 |
| | 553,400 | AIA GROUP LTD | 3,122,223 | 4,080,910 | 0.23 |
| | 819,000 | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 2,629,076 | 3,979,157 | 0.22 |
| | 1,098,000 | CHINA OVERSEAS LAND&INVEST LTD | 3,446,731 | 3,570,519 | 0.20 |
| | 267,000 | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 2,403,577 | 2,297,079 | 0.13 |
| | 1,297,000 | CNOOC LTD | 1,473,891 | 1,673,770 | 0.09 |
| | | | <u>19,152,695</u> | <u>22,733,601</u> | <u>1.28</u> |
| | | 合計：香港 | <u>19,152,695</u> | <u>22,733,601</u> | <u>1.28</u> |
| | | アイルランド | | | |
| 普通株式 | | | | | |
| | 75,480 | MEDTRONIC PLC | 4,847,187 | 5,864,796 | 0.33 |
| | 262,547 | JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI | 4,077,922 | 3,650,221 | 0.21 |
| | | | <u>8,925,109</u> | <u>9,515,017</u> | <u>0.54</u> |
| | | 合計：アイルランド | <u>8,925,109</u> | <u>9,515,017</u> | <u>0.54</u> |
| | | イタリア | | | |
| 普通株式 | | | | | |
| | 1,319,404 | ENI SPA | 21,306,063 | 21,754,368 | 1.23 |
| | 4,960,040 | INTESA SANPAOLO RSP | 12,674,716 | 16,426,453 | 0.92 |
| | | | <u>33,980,779</u> | <u>38,180,821</u> | <u>2.15</u> |
| | | 合計：イタリア | <u>33,980,779</u> | <u>38,180,821</u> | <u>2.15</u> |
| | | 日本 | | | |
| 普通株式 | | | | | |
| | 471,000 | NISSAN MOTOR CO LTD | 4,566,871 | 4,668,533 | 0.25 |
| | 114,000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | 3,916,905 | 4,379,939 | 0.24 |
| | 658,000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP | 3,677,046 | 4,276,067 | 0.23 |
| | 250,000 | MITSUMI & CO LTD | 3,455,048 | 3,697,531 | 0.20 |
| | 104,000 | JAPAN TOBACCO INC | 3,497,365 | 3,411,173 | 0.18 |
| | 148,000 | NTT DOCOMO | 2,994,098 | 3,383,443 | 0.19 |
| | 615,000 | JXTG HOLDINGS | 2,720,251 | 3,166,345 | 0.18 |
| | 55,000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | 2,582,451 | 3,039,579 | 0.17 |
| | 86,000 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | 1,900,979 | 2,971,454 | 0.17 |
| | 78,000 | SUBARU CORP | 2,737,929 | 2,816,438 | 0.16 |
| | 114,000 | MITSUBISHI CORP | 2,312,700 | 2,651,790 | 0.15 |
| | 157,000 | ITOCHEU CORP | 2,023,299 | 2,573,383 | 0.14 |
| | 43,000 | TOYOTA MOTOR CORP | 2,635,421 | 2,566,082 | 0.14 |
| | 65,000 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | 2,151,957 | 2,544,737 | 0.14 |
| | 65,000 | SOMPO HOLDINGS INC | 2,002,843 | 2,530,863 | 0.14 |
| | 53,000 | NIPPON TELG & TEL CORP NTT | 1,830,615 | 2,430,818 | 0.14 |
| | 75,000 | KOMATSU LTD | 1,648,446 | 2,135,140 | 0.12 |
| | 150,000 | ISUZU MOTORS LTD | 1,865,455 | 1,989,062 | 0.11 |
| | 360,000 | YAMADA DENKI CO LTD | 1,841,431 | 1,969,052 | 0.11 |
| | 10,500 | DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD | 1,322,882 | 1,914,356 | 0.11 |
| | 117,000 | MITSUBISHI ELECTRIC CORP | 1,407,058 | 1,829,297 | 0.10 |

| 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------|------------------------------|-----------|-----------|---------|
| 36,000 | OTSUKA HOLDINGS CO LTD | 1,290,979 | 1,431,485 | 0.08 |
| 101,000 | HITACHI METALS LTD | 1,276,786 | 1,406,671 | 0.08 |
| 52,000 | LIXIL GROUP CORPORATION | 944,106 | 1,380,933 | 0.08 |
| 125,000 | AMADA HOLDINGS CO LTD | 1,413,286 | 1,372,956 | 0.08 |
| 23,000 | KAO CORP | 1,173,356 | 1,354,146 | 0.08 |
| 105,000 | TOHOKU ELEC POWER CO INC | 1,343,596 | 1,336,314 | 0.08 |
| 160,000 | KONICA MINOLTA INC | 1,777,206 | 1,314,836 | 0.07 |
| 33,000 | MITSUBISHI HEAVY IND LTD | 1,676,061 | 1,305,737 | 0.07 |
| 95,000 | ASTELLAS PHARMA INC | 1,260,495 | 1,209,468 | 0.07 |
| 50,000 | HITACHI CAPITAL | 1,042,087 | 1,189,080 | 0.07 |
| 167,000 | HITACHI LTD | 1,061,087 | 1,177,645 | 0.07 |
| 7,800 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | 1,022,637 | 1,147,386 | 0.06 |
| 120,000 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS | 648,279 | 1,144,078 | 0.06 |
| 78,000 | PANASONIC CORP | 693,927 | 1,131,084 | 0.06 |
| 67,000 | SEKISUI HOUSE LTD | 930,703 | 1,130,075 | 0.06 |
| 60,000 | NGK INSULATORS LTD | 1,223,223 | 1,124,867 | 0.06 |
| 155,000 | LEOPALACE21 CORPORATION | 835,108 | 1,080,755 | 0.06 |
| 62,000 | SUMITOMO ELECTRIC IND LTD | 840,846 | 1,013,484 | 0.06 |
| 44,000 | DAIICHI SANKYO CO LTD | 971,316 | 993,170 | 0.06 |
| 125,000 | MITSUBISHI MOTORS CORP | 884,191 | 989,417 | 0.06 |
| 23,000 | AZBIL CORP | 759,146 | 986,972 | 0.06 |
| 73,000 | NSK LIMITED | 952,877 | 984,891 | 0.06 |
| 190,000 | RESONA HOLDINGS INC | 909,855 | 976,699 | 0.05 |
| 135,000 | CHIBA BANK LTD | 907,032 | 966,516 | 0.05 |
| 6,200 | TOKYO ELECTRON LTD | 436,630 | 952,829 | 0.05 |
| 28,000 | JAPAN AIRLINES | 887,646 | 948,275 | 0.05 |
| 44,000 | NGK SPARK PLUG CO LTD | 863,095 | 937,212 | 0.05 |
| 65,000 | SUMITOMO CORP | 863,399 | 935,633 | 0.05 |
| 37,000 | CAPCOM CO LTD | 759,002 | 910,193 | 0.05 |
| 59,000 | SBI HOLDINGS INC | 839,533 | 888,884 | 0.05 |
| 53,000 | SONY FINANCIAL HOLDING INC | 879,086 | 870,136 | 0.05 |
| 24,000 | DIC CORP | 863,786 | 869,798 | 0.05 |
| 24,000 | AOYAMA TRADING CO LTD | 878,963 | 859,126 | 0.05 |
| 10,000 | ROHM CO LTD | 778,597 | 857,347 | 0.05 |
| 26,500 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD | 667,415 | 851,753 | 0.05 |
| 16,000 | AISIN SEIKI CO LTD | 714,797 | 843,828 | 0.05 |
| 58,000 | T&D HOLDINGS INC | 815,987 | 842,610 | 0.05 |
| 138,000 | TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP | 783,334 | 833,352 | 0.05 |
| 48,000 | STAR MICRONICS CO LTD | 750,239 | 827,322 | 0.05 |
| 51,000 | ORIX CORP | 730,841 | 823,013 | 0.05 |
| 175,000 | FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC | 839,192 | 809,321 | 0.05 |
| 15,000 | ABC-MART INC | 872,531 | 792,423 | 0.04 |
| 16,000 | TECHNOPRO HOLDINGS INC | 606,192 | 758,450 | 0.04 |
| 35,000 | TSUBAKI NAKASHIMA CO LTD | 607,191 | 734,615 | 0.04 |
| 23,000 | EXEDY CORP | 646,166 | 700,596 | 0.04 |
| 58,000 | DAICEL CORP | 705,407 | 699,467 | 0.04 |

| 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------|------------------------------------|---------|---------|---------|
| 87,000 | TSUBAKIMOTO CHAIN CO | 759,686 | 695,598 | 0.04 |
| 12,000 | TOYOTA INDUSTRIES CORP | 667,148 | 690,502 | 0.04 |
| 20,000 | CANON INC | 606,366 | 683,921 | 0.04 |
| 38,000 | RESORTTRUST INC | 699,181 | 680,310 | 0.04 |
| 53,000 | KAKAKU.COM INC | 746,939 | 675,934 | 0.04 |
| 43,000 | JAC RECRUITMENT CO LTD | 648,040 | 670,776 | 0.04 |
| 62,000 | CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD | 824,827 | 658,930 | 0.04 |
| 22,000 | HONDA MOTOR CO LTD | 706,407 | 651,939 | 0.04 |
| 18,000 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | 678,046 | 650,107 | 0.04 |
| 65,000 | NTT URBAN DEVELOPMENT CORP | 582,953 | 647,457 | 0.04 |
| 18,000 | TOKYO OHKA KOGYO CO LTD | 623,081 | 640,342 | 0.04 |
| 27,000 | SATO HOLDINGS CORP | 593,024 | 639,221 | 0.04 |
| 20,000 | SANKYO CO LTD, GUNMA | 716,959 | 638,563 | 0.04 |
| 5,000 | HIKARI TSUSHIN INC | 491,189 | 627,002 | 0.04 |
| 21,000 | KYUSHU RAILWAY COMPANY | 627,405 | 624,734 | 0.04 |
| 87,000 | SENKO GROUP HOLDING | 574,042 | 620,545 | 0.03 |
| 50,000 | OBAYASHI CORP | 504,575 | 599,876 | 0.03 |
| 22,000 | NEC CORP | 599,790 | 596,763 | 0.03 |
| 8,500 | WEST JAPAN RAILWAY COMPANY | 525,161 | 591,311 | 0.03 |
| 31,000 | JSR CORPORATION | 538,250 | 589,453 | 0.03 |
| 46,000 | KANSAI ELECTRIC POWER CO INC | 601,355 | 588,910 | 0.03 |
| 14,000 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | 437,590 | 581,466 | 0.03 |
| 24,000 | SEIKO EPSON CORP | 411,753 | 581,217 | 0.03 |
| 40,000 | MARUI GROUP CO LTD | 560,209 | 573,106 | 0.03 |
| 15,000 | AOZORA BANK LTD | 556,715 | 570,972 | 0.03 |
| 33,000 | KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD | 516,899 | 561,740 | 0.03 |
| 28,000 | TV ASAHI HOLDINGS CORP | 570,121 | 558,058 | 0.03 |
| 11,000 | TREND MICRO INC | 438,793 | 541,978 | 0.03 |
| 22,500 | DAI NIPPON PRINTING CO LTD | 432,144 | 538,888 | 0.03 |
| 38,000 | CASIO COMPUTER CO LTD | 584,264 | 535,326 | 0.03 |
| 100,000 | CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD | 498,494 | 494,575 | 0.03 |
| 6,500 | SECOM CO LTD | 390,725 | 474,147 | 0.03 |
| 130,000 | SEVEN BANK LTD | 449,098 | 469,406 | 0.03 |
| 12,600 | HANWA CO LTD | 441,338 | 452,162 | 0.03 |
| 17,000 | KDDI CORP | 368,860 | 448,586 | 0.03 |
| 39,000 | SANWA HOLDINGS CORP | 360,159 | 447,786 | 0.03 |
| 8,500 | KAKEN PHARMACEUTICAL CO LTD | 447,126 | 432,409 | 0.02 |
| 8,000 | MEITEC CORPORATION | 312,839 | 401,281 | 0.02 |
| 140,000 | NIPPON LIGHT METAL HLDG CO LTD | 337,598 | 398,435 | 0.02 |
| 12,000 | DENKA CO LTD | 321,073 | 395,411 | 0.02 |
| 15,000 | STARTS CORP INC | 332,002 | 385,939 | 0.02 |
| 85,000 | SKY PERFECT JSAT HOLDINGS INC | 371,733 | 380,248 | 0.02 |
| 19,000 | KYOWA EXEO CORP | 266,950 | 377,668 | 0.02 |
| 59,000 | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD | 267,004 | 368,881 | 0.02 |
| 30,000 | JAPAN POST HOLDINGS CO LTD | 454,854 | 354,589 | 0.02 |
| 9,000 | ITOCHEU TECHNO-SOLUTIONS CORP | 246,169 | 336,180 | 0.02 |

| 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|-------------------------------------|-------------|-------------|---------|
| 6,000 | NIPPON STEEL & SUMIKIN BUISSAN CORP | 238,789 | 330,843 | 0.02 |
| 16,000 | ASAHI HOLDINGS INC | 289,786 | 329,420 | 0.02 |
| 16,000 | USS CO LTD | 273,964 | 323,017 | 0.02 |
| 5,000 | OTSUKA CORP | 231,228 | 320,616 | 0.02 |
| 9,000 | AICA KOGYO CO LTD | 243,713 | 302,562 | 0.02 |
| 14,000 | JAPAN POST INSURANCE CO LTD | 322,610 | 300,196 | 0.02 |
| 45,000 | SUMITOMO WAREHOUSE CO LTD | 272,014 | 298,960 | 0.02 |
| 24,000 | ASAHI KASEI CORPORATION | 152,811 | 295,625 | 0.02 |
| 14,000 | TECMO KOEI HOLDINGS CO LTD | 285,281 | 294,219 | 0.02 |
| 4,400 | LAWSON INC | 322,524 | 291,533 | 0.02 |
| 18,000 | NIHON UNISYS LTD | 246,454 | 287,994 | 0.02 |
| 6,000 | TAIYO HOLDINGS CO LTD | 255,248 | 279,616 | 0.02 |
| 15,000 | NIPPON PAPER INDUSTRIES CO LTD | 269,045 | 279,082 | 0.02 |
| 8,000 | MITSUBISHI MATERIAL CORP | 242,753 | 276,770 | 0.02 |
| 7,000 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | 262,471 | 270,500 | 0.02 |
| 11,000 | PARK24 CO LTD | 286,347 | 268,054 | 0.02 |
| 6,000 | DENTSU | 262,792 | 263,607 | 0.01 |
| 22,000 | RELIA INC | 217,687 | 253,967 | 0.01 |
| 8,000 | POLA ORBIS HOLDINGS INC | 169,695 | 242,263 | 0.01 |
| 14,000 | KONOIKE TRANSPORT CO LTD | 191,213 | 213,412 | 0.01 |
| 8,000 | TOKAI RIKA CO LTD | 147,867 | 158,378 | 0.01 |
| 6,000 | ELECTRIC POWER DEVELOPMENT CO | 178,933 | 150,801 | 0.01 |
| 4,000 | OSAKA GAS CO LTD | 79,915 | 74,422 | 0.00 |
| 2,000 | ASAHI GLASS CO LTD | 59,457 | 74,262 | 0.00 |
| 2,000 | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS | 51,678 | 64,443 | 0.00 |
| | | 124,961,473 | 139,007,140 | 7.82 |
| | 合計：日本 | 124,961,473 | 139,007,140 | 7.82 |
| | ルクセンブルグ | | | |
| 普通株式 | | | | |
| 154,763 | RTL GROUP | 11,584,140 | 11,694,547 | 0.66 |
| 404,856 | TENARIS SA | 5,828,830 | 5,758,500 | 0.32 |
| | | 17,412,970 | 17,453,047 | 0.98 |
| | 合計：ルクセンブルグ | 17,412,970 | 17,453,047 | 0.98 |
| | オランダ | | | |
| 普通株式 | | | | |
| 891,456 | ING GROEP NV - CVA | 12,897,995 | 16,338,509 | 0.92 |
| 144,080 | KONINKLIJKE P-NY | 5,331,801 | 5,923,129 | 0.33 |
| 145,090 | AKZO NOBEL NV SPON ADR | 3,469,300 | 4,445,558 | 0.25 |
| 54,570 | UNILEVER NV NY SHS | 2,437,490 | 3,212,536 | 0.18 |
| | | 24,136,586 | 29,919,732 | 1.68 |
| | 合計：オランダ | 24,136,586 | 29,919,732 | 1.68 |

| | 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|------|------------|-----------------------------------|------------|------------|---------|
| | | ノルウェー | | | |
| 普通株式 | 718,674 | DNB ASA | 10,745,429 | 14,535,933 | 0.82 |
| | 317,833 | STATOIL ASA | 6,320,976 | 6,388,502 | 0.36 |
| | | 合計：ノルウェー | 17,066,405 | 20,924,435 | 1.18 |
| | | | 17,066,405 | 20,924,435 | 1.18 |
| | | ポーランド | | | |
| 普通株式 | 15,579,929 | ORANGE POLSKA SA | 37,782,457 | 22,696,444 | 1.28 |
| | 1,763,127 | PGE POLSKA GRUPA ENERGA SA | 8,556,241 | 6,397,056 | 0.36 |
| | | 合計：ポーランド | 46,338,698 | 29,093,500 | 1.64 |
| | | | 46,338,698 | 29,093,500 | 1.64 |
| | | 韓国 | | | |
| 普通株式 | 417,646 | MACQUARIE KOREA INFRA FUND | 2,862,235 | 3,105,102 | 0.18 |
| | 64,870 | SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 2,327,467 | 2,854,044 | 0.16 |
| | 11,022 | LG CHEM LTD PREFERENCE | 2,144,112 | 2,443,921 | 0.14 |
| | 7,965 | POSCO | 1,492,885 | 2,208,482 | 0.12 |
| | 22,641 | WOONG JIN COWAY CO LTD | 1,866,583 | 1,861,540 | 0.10 |
| | 26,970 | DONGBU INSURANCE CO LTD | 1,299,726 | 1,722,077 | 0.10 |
| | 15,400 | HYUNDAI MOTOR CO LTD PREFERENCE | 1,403,919 | 1,260,798 | 0.07 |
| | 3,350 | SK TELECOM CO LTD | 848,011 | 747,195 | 0.04 |
| | 5,100 | S-OIL CORP | 558,760 | 568,760 | 0.03 |
| | | 合計：韓国 | 14,803,698 | 16,771,919 | 0.94 |
| | | | 14,803,698 | 16,771,919 | 0.94 |
| | | ルーマニア | | | |
| 投資信託 | 72,550,736 | SC FONDUL PROPRIETATEA SA ETF | 13,744,060 | 15,696,450 | 0.88 |
| | | 合計：ルーマニア | 13,744,060 | 15,696,450 | 0.88 |
| | | | 13,744,060 | 15,696,450 | 0.88 |
| | | ロシア | | | |
| 普通株式 | 114,556 | LUKOIL PJSC-SPON ADR | 5,888,083 | 6,065,740 | 0.34 |
| | | 合計：ロシア | 5,888,083 | 6,065,740 | 0.34 |
| | | | 5,888,083 | 6,065,740 | 0.34 |
| | | シンガポール | | | |
| 普通株式 | 357,951 | DBS GROUP HOLDING LTD | 4,649,474 | 5,488,685 | 0.32 |
| | 1,489,400 | SINGAPORE TELECOM 1000 | 4,503,337 | 4,036,670 | 0.23 |
| | 198,708 | UTD OVERSEAS BANK LTD UOB | 3,176,104 | 3,439,119 | 0.19 |
| | 331,488 | OVERSEAS CHINESE BANKING CORP LTD | 1,973,035 | 2,724,558 | 0.15 |
| | 794,100 | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 2,147,516 | 2,011,860 | 0.11 |

| | 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|-----------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| | 1,158,000 | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 1,280,336 | 1,296,332 | 0.07 |
| | 574,000 | GUOCOLAND LTD | 945,417 | 959,626 | 0.05 |
| | | | 18,675,219 | 19,956,850 | 1.12 |
| | | 合計：シンガポール | 18,675,219 | 19,956,850 | 1.12 |
| | | スイス | | | |
| 普通株式 | 149,710 | NOVARTIS AG-SPONSORED ADR | 11,442,366 | 12,743,315 | 0.71 |
| | 96,423 | SWISS RE AG | 8,192,722 | 8,682,640 | 0.49 |
| | 252,460 | ABB LTD SPON ADR | 6,031,424 | 6,192,844 | 0.35 |
| | | | 25,666,512 | 27,618,799 | 1.55 |
| | | 合計：スイス | 25,666,512 | 27,618,799 | 1.55 |
| | | 台湾 | | | |
| 普通株式 | 2,147,000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD | 9,407,895 | 15,327,563 | 0.85 |
| | 2,451,000 | HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD | 7,309,417 | 8,486,249 | 0.47 |
| | 3,539,000 | CATHAY FINANCIAL HOLDINGS | 5,670,529 | 5,624,847 | 0.32 |
| | 1,587,000 | PRIMAX ELECTRONICS LTD | 1,903,380 | 3,924,834 | 0.22 |
| | 841,000 | TONG HSING ELECTRONIC INDUSTRIES LT | 2,268,170 | 3,466,484 | 0.20 |
| | 2,231,645 | ADVANCED SEMICONDUCTOR ENG INC | 2,771,228 | 2,730,123 | 0.15 |
| | 763,000 | TAIWAN SECOM | 2,182,141 | 2,239,225 | 0.13 |
| | 1,572,000 | WPG HOLDINGS CO LTD | 1,880,016 | 2,091,603 | 0.12 |
| | 1,196,000 | CTCI CORP | 1,788,018 | 1,920,628 | 0.11 |
| | 204,000 | MEDIATEK INCORPORATION | 1,890,821 | 1,913,796 | 0.11 |
| | 1,955,000 | INVENTEC CORPORATION | 1,447,501 | 1,444,036 | 0.08 |
| | 460,000 | NANYA TECHNOLOGY | 983,343 | 1,301,452 | 0.07 |
| | 59,000 | ST SHINE OPTICAL CO LTD | 910,254 | 1,249,022 | 0.07 |
| | 250,000 | ELITE MATERIAL | 1,054,413 | 1,187,095 | 0.07 |
| | 300,000 | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 968,566 | 1,033,762 | 0.06 |
| | 60,000 | ADVANCED CERAMIC X CORP | 619,724 | 834,924 | 0.05 |
| | 350,000 | KINSUS | 952,653 | 822,888 | 0.05 |
| | | | 44,008,069 | 55,598,531 | 3.13 |
| | | 合計：台湾 | 44,008,069 | 55,598,531 | 3.13 |
| | | タイ | | | |
| 普通株式 | 7,265,200 | DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F | 2,541,991 | 3,161,525 | 0.17 |
| | 8,180,000 | LAND AND HOUSE PLC NVDR | 2,028,982 | 2,430,354 | 0.13 |
| | 8,241,600 | TPI POLENE POWER F | 1,802,901 | 1,879,776 | 0.11 |
| | 739,200 | PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC CO LTD F | 1,264,814 | 1,708,180 | 0.10 |
| | 667,000 | TISCO FINANCIAL GROUP PUB CO NVDR | 1,270,833 | 1,541,337 | 0.09 |
| | | | 8,909,521 | 10,721,172 | 0.60 |
| | | 合計：タイ | 8,909,521 | 10,721,172 | 0.60 |

| | 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------|------------|----------------------------------|-------------|-------------|---------|
| | | トルコ | | | |
| 普通株式 | 3,022,222 | TURK TELEKOMUNIKASYON AS | 8,009,219 | 5,721,783 | 0.32 |
| | | 合計：トルコ | 8,009,219 | 5,721,783 | 0.32 |
| | | イギリス | | | |
| 普通株式 | 8,456,100 | MORRISON WM SUPERMARKETS PLC | 24,505,255 | 26,649,534 | 1.50 |
| | 10,379,560 | TESCO PLC | 31,333,200 | 25,914,456 | 1.46 |
| | 2,579,054 | HSBC HOLDINGS PLC | 22,889,886 | 25,566,159 | 1.44 |
| | 3,487,232 | BP PLC | 22,769,300 | 22,358,779 | 1.26 |
| | 2,314,954 | PEARSON PLC | 23,745,331 | 19,038,109 | 1.07 |
| | 7,336,507 | CENTRICA PLC | 28,536,476 | 18,413,301 | 1.04 |
| | 2,133,153 | BAE SYSTEMS PLC | 15,594,974 | 18,043,394 | 1.02 |
| | 4,714,636 | RBS GROUP | 16,916,972 | 17,057,600 | 0.96 |
| | 16,485,872 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 13,060,919 | 15,014,274 | 0.84 |
| | 186,020 | ROYAL DUTCH SHELL PLC SPON ADR A | 10,291,297 | 11,228,167 | 0.63 |
| | 3,066,568 | VODAFONE GROUP PLC (NEW) | 10,123,951 | 8,560,605 | 0.48 |
| | 184,750 | NIELSEN HOLDINGS PLC | 8,487,427 | 7,680,058 | 0.43 |
| | 1,788,424 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 6,145,169 | 6,249,977 | 0.35 |
| | 787,571 | ASHMORE GROUP PLC | 2,956,345 | 3,576,844 | 0.20 |
| | | 合計：イギリス | 237,356,502 | 225,351,257 | 12.68 |
| | | アメリカ | | | |
| 投資信託 | 86,290 | ISHARES MSCI CANADA ETF | 2,420,640 | 2,497,233 | 0.14 |
| | | | 2,420,640 | 2,497,233 | 0.14 |
| 普通株式 | 807,010 | PFIZER INC * | 24,838,789 | 28,600,435 | 1.62 |
| | 295,381 | JPMORGAN CHASE & CO * | 17,094,888 | 28,167,533 | 1.59 |
| | 821,710 | CISCO SYSTEMS INC * | 21,089,436 | 27,367,053 | 1.55 |
| | 358,030 | CITIGROUP INC * | 18,614,052 | 26,043,102 | 1.48 |
| | 170,010 | APPLE INC * | 18,801,848 | 25,872,122 | 1.47 |
| | 159,720 | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 16,382,888 | 18,444,466 | 1.04 |
| | 338,620 | QUALCOMM INC * | 21,340,256 | 17,493,109 | 0.98 |
| | 268,640 | BAXTER INTL INC * | 10,560,391 | 16,744,331 | 0.94 |
| | 419,350 | EXELON CORP | 13,847,822 | 15,801,108 | 0.89 |
| | 193,240 | GILEAD SCIENCES INC | 17,042,393 | 15,337,459 | 0.86 |
| | 272,430 | CONOCOPHILLIPS * | 12,305,266 | 13,567,014 | 0.76 |
| | 249,420 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 12,123,678 | 12,301,394 | 0.69 |
| | 152,370 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC * | 12,518,279 | 11,709,635 | 0.66 |
| | 1,034,570 | AES CORP * | 13,072,421 | 11,442,344 | 0.64 |
| | 203,030 | ORACLE CORP | 8,060,774 | 9,855,076 | 0.55 |

| 数量 | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------|
| 352,380 | TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC | 8,874,484 | 9,806,735 | 0.55 |
| 254,310 | COMCAST CORP A | 8,176,585 | 9,597,659 | 0.54 |
| 112,650 | NASDAQ INC | 5,459,513 | 8,743,893 | 0.49 |
| 168,930 | MORGAN STANLEY | 8,037,047 | 8,149,183 | 0.46 |
| 398,120 | KROGER CO | 11,692,419 | 8,073,874 | 0.45 |
| 346,930 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 7,441,873 | 7,150,227 | 0.40 |
| 133,360 | GENERAL MILLS INC | 7,550,428 | 7,001,400 | 0.39 |
| 78,470 | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP * | 6,169,199 | 6,636,208 | 0.37 |
| 217,340 | FIRSTENERGY CORP | 6,775,878 | 6,598,442 | 0.37 |
| 171,070 | DEVON ENERGY CORP | 5,207,218 | 6,216,684 | 0.35 |
| 34,580 | LEAR CORP | 3,157,755 | 6,005,509 | 0.34 |
| 97,840 | MARATHON PETROLEUM CORP | 3,954,857 | 5,471,213 | 0.31 |
| 428,980 | SLM CORP | 3,690,245 | 4,941,850 | 0.28 |
| 85,860 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP | 3,326,950 | 4,749,775 | 0.27 |
| 64,060 | OMNICOM GROUP INC | 4,729,829 | 4,730,190 | 0.27 |
| 35,580 | NORFOLK SOUTHERN CORP | 4,079,590 | 4,709,725 | 0.26 |
| 71,540 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES * | 4,215,340 | 4,625,776 | 0.26 |
| 74,420 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 4,697,185 | 4,595,435 | 0.26 |
| 39,400 | JM SMUCKER CO | 4,852,305 | 4,143,304 | 0.23 |
| 53,200 | VALERO ENERGY CORP | 2,721,236 | 4,105,444 | 0.23 |
| 516,284 | RESMED INC CDI | 3,629,006 | 3,945,445 | 0.22 |
| 35,600 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 2,834,753 | 3,787,840 | 0.21 |
| 61,000 | CROWN HOLDINGS | 3,171,778 | 3,637,430 | 0.20 |
| 57,880 | KELLOGG CO | 3,970,747 | 3,620,394 | 0.20 |
| 81,075 | NEWELL BRANDS INC | 3,434,406 | 3,411,636 | 0.19 |
| 77,920 | E*TRADE FINANCIAL CORP | 3,074,659 | 3,373,936 | 0.19 |
| 38,730 | RELIANCE STEEL & ALUMINIUM | 2,525,211 | 2,947,353 | 0.17 |
| 184,680 | REGIONS FINANCIAL CORP | 1,911,923 | 2,823,757 | 0.16 |
| 169,090 | MARATHON OIL CORP | 4,087,309 | 2,264,115 | 0.13 |
| 26,870 | CVS HEALTH CORPORATION * | 2,176,172 | 2,183,188 | 0.12 |
| 17,160 | UNITED PARCEL SERVICE INC B | 1,671,369 | 2,057,312 | 0.12 |
| 17,000 | PEPSICO INC | 1,858,091 | 1,898,390 | 0.11 |
| 23,120 | LOWE'S COMPANIES INC | 1,593,955 | 1,841,970 | 0.10 |
| 18,290 | AVERY DENNISON CORP | 1,140,708 | 1,807,601 | 0.10 |
| 42,880 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,953,543 | 1,736,640 | 0.10 |
| 17,980 | DOLLAR GENERAL CORP | 1,252,892 | 1,457,279 | 0.08 |
| 75,740 | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 1,928,330 | 1,434,137 | 0.08 |
| 12,470 | PACKAGING CORP OF AMERICA | 897,151 | 1,428,563 | 0.08 |
| 10,120 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 971,990 | 1,423,479 | 0.08 |
| 20,180 | PG&E CORP | 1,418,461 | 1,371,231 | 0.08 |
| 11,460 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | 1,038,296 | 1,277,102 | 0.07 |
| 32,590 | HOLOGIC INC | 1,339,664 | 1,186,928 | 0.07 |
| 8,680 | PPG INDUSTRIES INC | 924,902 | 947,769 | 0.05 |
| 20,618 | EBAY INC | 695,998 | 784,721 | 0.04 |
| 23,570 | OWENS ILLINOIS INC | 573,102 | 590,664 | 0.03 |
| | 合計：アメリカ | 402,577,533 | 458,037,587 | 25.78 |
| | | 404,998,173 | 460,534,820 | 25.92 |
| | 組入資産合計 | 1,487,745,969 | 1,614,718,170 | 90.85 |

* 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有価証券

財務書類に関する注記

2017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ー外国為替先渡し契約

2017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) |
|------|----------------|------|---------------|-------------|----------------|
| JPY | 3,185,411 | USD | 29,258 | 2017年10月10日 | (912) |
| JPY | 4,074,132 | USD | 37,420 | 2017年10月10日 | (1,167) |
| TRY | 632,200,000 | USD | 174,662,596 | 2017年10月27日 | 1,683,151 |
| USD | 11,759,303 | MXN | 210,000,000 | 2017年10月27日 | 243,562 |
| ZAR | 1,515,000,000 | USD | 111,742,969 | 2017年10月27日 | 88,677 |
| MXN | 230,000,000 | USD | 12,558,973 | 2017年11月22日 | (322) |
| BRL | 27,000,000 | USD | 8,449,381 | 2017年11月3日 | (6,366) |
| ZAR | 134,000,000 | USD | 9,867,051 | 2017年11月22日 | (17,724) |
| TRY | 42,000,000 | USD | 11,681,999 | 2017年11月22日 | (58,913) |
| MXN | 2,920,000,000 | USD | 160,242,339 | 2017年10月27日 | (118,692) |
| TRY | 64,000,000 | USD | 18,298,837 | 2017年10月27日 | (446,689) |
| INR | 4,010,000,000 | USD | 62,195,613 | 2017年10月27日 | (1,022,654) |
| INR | 13,403,000,000 | USD | 208,448,031 | 2017年11月22日 | (4,568,536) |
| MXN | 3,680,000,000 | USD | 205,653,228 | 2017年11月22日 | (4,714,801) |
| TRY | 451,200,000 | USD | 129,640,271 | 2017年11月22日 | (4,775,114) |
| BRL | 1,032,400,000 | USD | 328,627,588 | 2017年11月3日 | (5,791,694) |
| ZAR | 2,258,000,000 | USD | 174,225,706 | 2017年11月22日 | (8,257,174) |
| USD | 430,207 | JPY | 47,276,106 | 2017年10月10日 | 9,517 |
| USD | 89,490 | JPY | 9,717,603 | 2017年10月10日 | 3,018 |
| USD | 52,472 | JPY | 5,697,889 | 2017年10月10日 | 1,769 |
| USD | 112,662 | JPY | 12,619,344 | 2017年10月10日 | 369 |
| USD | 112,662 | JPY | 12,610,781 | 2017年10月25日 | 360 |
| USD | 35,708 | JPY | 3,972,772 | 2017年10月10日 | 356 |
| USD | 35,708 | JPY | 3,970,147 | 2017年10月25日 | 353 |
| USD | 63,582 | JPY | 7,121,808 | 2017年10月10日 | 208 |
| USD | 63,582 | JPY | 7,116,975 | 2017年10月25日 | 203 |
| USD | 51,977 | JPY | 5,859,497 | 2017年10月10日 | (163) |
| USD | 51,977 | JPY | 5,855,582 | 2017年10月25日 | (168) |
| JPY | 2,368,484,585 | USD | 21,304,378 | 2017年10月25日 | (212,296) |
| JPY | 2,394,221,607 | USD | 21,786,168 | 2017年10月10日 | (481,011) |
| USD | 219,248,655 | EUR | 181,840,440 | 2017年10月17日 | 4,576,465 |
| USD | 47,522,194 | JPY | 5,180,000,000 | 2017年10月6日 | 1,436,863 |

| 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 | 48,845,913 | JPY | 5,390,000,000 | 2017年10月13日 | 875,362 |
| USD | 59,143,916 | TWD | 1,770,000,000 | 2017年10月13日 | 738,273 |
| RUB | 518,606,479 | USD | 8,557,862 | 2017年10月18日 | 359,249 |
| USD | 17,372,960 | KRW | 19,600,000,000 | 2017年10月13日 | 225,953 |
| JPY | 5,180,000,000 | USD | 45,918,130 | 2017年10月6日 | 167,200 |
| USD | 54,278,505 | AUD | 69,000,000 | 2017年10月31日 | 163,796 |
| USD | 54,268,845 | AUD | 69,000,000 | 2017年10月31日 | 154,136 |
| USD | 54,972,470 | AUD | 69,900,000 | 2017年10月31日 | 151,917 |
| USD | 48,045,250 | JPY | 5,380,000,000 | 2017年10月20日 | 146,700 |
| USD | 54,239,589 | AUD | 69,000,000 | 2017年10月31日 | 124,880 |
| USD | 20,716,532 | SGD | 27,950,000 | 2017年10月31日 | 124,674 |
| USD | 9,368,185 | CHF | 8,983,598 | 2017年10月18日 | 100,798 |
| USD | 12,085,724 | THB | 400,000,000 | 2017年10月16日 | 83,462 |
| NOK | 15,763,949 | USD | 1,906,937 | 2017年10月18日 | 78,001 |
| RON | 3,867,156 | USD | 974,653 | 2017年10月18日 | 16,645 |
| USD | 40,358,796 | HKD | 315,000,000 | 2017年10月13日 | 14,392 |
| USD | 1,491,684 | PLN | 5,400,500 | 2017年10月18日 | 12,911 |
| USD | 1,480,358 | PLN | 5,374,664 | 2017年10月18日 | 8,659 |
| CZK | 32,755,419 | EUR | 1,255,988 | 2017年10月18日 | 3,154 |
| USD | 1,195,177 | NOK | 9,476,271 | 2017年10月18日 | 1,960 |
| CZK | 41,310,501 | USD | 1,872,728 | 2017年10月18日 | 1,379 |
| USD | 438,634 | KRW | 500,000,000 | 2017年10月13日 | 1,211 |
| HKD | 25,000,000 | USD | 3,200,766 | 2017年10月13日 | 1,171 |
| NOK | 7,633,088 | USD | 960,278 | 2017年10月18日 | 852 |
| KRW | 200,000,000 | USD | 174,497 | 2017年10月13日 | 472 |
| THB | 4,000,000 | USD | 119,621 | 2017年10月16日 | 401 |
| SGD | 500,000 | USD | 368,042 | 2017年10月31日 | 327 |
| HKD | 8,000,000 | USD | 1,024,393 | 2017年10月13日 | 226 |
| THB | 5,500,000 | USD | 164,880 | 2017年10月16日 | 150 |
| CZK | 19,126,000 | USD | 867,757 | 2017年10月18日 | (81) |
| HKD | 12,000,000 | USD | 1,537,204 | 2017年10月13日 | (274) |
| THB | 8,000,000 | USD | 241,757 | 2017年10月16日 | (1,712) |
| USD | 2,350,832 | AUD | 3,000,000 | 2017年10月31日 | (1,981) |
| KRW | 383,000,000 | USD | 337,058 | 2017年10月13日 | (1,992) |
| THB | 10,000,000 | USD | 302,159 | 2017年10月16日 | (2,103) |
| THB | 17,500,000 | USD | 527,686 | 2017年10月16日 | (2,588) |
| TWD | 42,000,000 | USD | 1,389,440 | 2017年10月13日 | (3,544) |
| CHF | 845,808 | EUR | 742,847 | 2017年10月18日 | (4,491) |
| KRW | 450,000,000 | USD | 398,476 | 2017年10月13日 | (4,796) |
| RON | 9,617,549 | USD | 2,471,610 | 2017年10月18日 | (6,269) |
| RON | 4,285,651 | USD | 1,106,745 | 2017年10月18日 | (8,171) |

| 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) |
|------|-------------|------|---------------|-------------|----------------|
| TWD | 50,000,000 | USD | 1,659,751 | 2017年10月13日 | (9,874) |
| USD | 545,973 | TRY | 1,987,332 | 2017年10月18日 | (9,890) |
| CZK | 24,785,118 | USD | 1,140,148 | 2017年10月18日 | (15,738) |
| CZK | 48,560,082 | USD | 2,234,393 | 2017年10月18日 | (31,399) |
| PLN | 5,815,167 | USD | 1,644,787 | 2017年10月18日 | (52,469) |
| USD | 42,980,712 | HKD | 336,000,000 | 2017年10月13日 | (53,319) |
| USD | 45,960,583 | JPY | 5,180,000,000 | 2017年10月27日 | (173,613) |
| USD | 6,329,210 | DKK | 41,120,300 | 2017年10月18日 | (193,654) |
| USD | 5,095,854 | TRY | 19,019,349 | 2017年10月18日 | (223,923) |
| USD | 8,396,948 | RUB | 518,606,479 | 2017年10月18日 | (520,163) |
| USD | 27,848,693 | PLN | 103,760,557 | 2017年10月18日 | (563,188) |
| USD | 20,567,372 | RON | 82,465,907 | 2017年10月18日 | (571,761) |
| USD | 24,667,836 | CZK | 561,129,120 | 2017年10月18日 | (788,557) |
| USD | 20,568,940 | NOK | 171,928,283 | 2017年10月18日 | (1,079,634) |
| USD | 216,486,605 | GBP | 163,760,356 | 2017年10月19日 | (3,178,207) |
| HKD | 17,000,000 | USD | 2,177,424 | 2017年10月13日 | (107) |
| | | | | | (26,374,712) |

注記2－先物契約

2017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 | 182 | FUT S&P 500 EMINI | 2017年12月 | 22,809,150 | 389,025 |
| | | | | <u>22,809,150</u> | <u>389,025</u> |
| | | | | | <u>389,025</u> |

注記3－オプション契約

2017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> | | | | | | |
| AUD | (74,888) | C AMC AT 16.6572 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (12,606) | 0 | 12,606 |
| GBP | (101,310) | C ASHM LN 3.76495 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (1,684) | 0 | 1,684 |
| AUD | (21,716) | C CBA AT 86.3051 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (11,715) | 0 | 11,715 |
| USD | (2,600) | C CMCSA UQ 41.087 29/09/17 OTC | 2017年9月29日 | (2,295) | 0 | 2,295 |
| USD | (12,500) | C FE UN 32.48 29/09/17 OTC | 2017年9月29日 | (7,120) | 0 | 7,120 |
| USD | (12) | C HON UN 141 29/09/17 FLEX | 2017年9月29日 | (2,121) | 0 | 2,121 |
| AUD | (45,941) | C JHX AT 20.3876 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (11,484) | 0 | 11,484 |
| USD | (56,700) | C NVS UN 85.4 29/09/17 OTC | 2017年9月29日 | (111,977) | 0 | 111,977 |
| USD | (26,600) | C NWL UN 50.152 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (28,135) | 0 | 28,135 |
| AUD | (124,928) | C QBE AT 13.1052 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (8,851) | 0 | 8,851 |
| AUD | (96,919) | C QBE AT 13.1491 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (10,601) | 0 | 10,601 |
| AUD | (12,405) | C RHC AT 74.2737 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (9,320) | 0 | 9,320 |
| TWD | (800,000) | C 2317 TT 122.96 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (16,960) | 0 | 16,960 |
| USD | (71) | C AAPL UQ 157.5 10/11/17 | 2017年11月10日 | (23,412) | (23,785) | (373) |
| USD | (253) | C AAPL UQ 160 03/11/17 | 2017年11月3日 | (69,259) | (50,600) | 18,659 |
| USD | (72) | C AAPL UQ 160 10/11/17 | 2017年11月10日 | (17,838) | (18,072) | (234) |
| USD | (65) | C AAPL UQ 160 13/10/17 | 2017年10月13日 | (20,816) | (2,340) | 18,476 |
| USD | (132) | C AAPL UQ 162.5 13/10/17 | 2017年10月13日 | (31,119) | (2,508) | 28,611 |
| USD | (131) | C AAPL UQ 165 27/10/17 | 2017年10月27日 | (27,414) | (6,681) | 20,733 |
| USD | (66) | C AAPL UQ 170 17/11/17 | 2017年11月17日 | (16,789) | (5,346) | 11,443 |

| 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 | (31,000) | C ABB UN 23.236 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (13,547) | (40,253) | (26,706) |
| USD | (38,650) | C ABB UN 24.522 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (14,880) | (11,841) | 3,039 |
| USD | (38,650) | C ABB UN 24.522 30/10/17 OTC | 2017年10月30日 | (20,098) | (14,580) | 5,518 |
| USD | (178,500) | C AES UN 11.306 01/11/17 OTC | 2017年11月1日 | (57,227) | (23,594) | 33,633 |
| USD | (62,000) | C AES UN 11.326 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (16,783) | (7,953) | 8,830 |
| USD | (225,000) | C AES UN 11.353 27/11/17 OTC | 2017年11月27日 | (53,505) | (48,220) | 5,285 |
| EUR | (79,633) | C AGS BB 40.3237 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (44,514) | (32,411) | 12,103 |
| EUR | (110,719) | C AGS BB 40.3988 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (66,804) | (105,321) | (38,517) |
| EUR | (80,523) | C AGS BB 40.4389 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (13,214) | (17,987) | (4,773) |
| EUR | (57,106) | C AGS BB 41.6883 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (31,930) | (20,946) | 10,984 |
| USD | (110) | C AIG UN 58 27/10/17 | 2017年10月27日 | (23,917) | (26,180) | (2,263) |
| USD | (73) | C AIG UN 60.90 20/10/17 FLEX | 2017年10月20日 | (6,187) | (10,250) | (4,063) |
| USD | (151) | C AIG UN 62.5 17/11/17 | 2017年11月17日 | (14,459) | (18,875) | (4,416) |
| USD | (21,000) | C AKZOY UN 31.345 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (9,645) | (4,848) | 4,797 |
| USD | (21,000) | C AKZOY UN 31.655 31/10/17 OTC | 2017年10月31日 | (8,474) | (5,019) | 3,455 |
| AUD | (54,316) | C ALL AT 22.8039 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (7,114) | (1,040) | 6,074 |
| AUD | (54,713) | C ALL AT 23.2766 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (7,193) | 0 | 7,193 |
| EUR | (69,751) | C ALO FP 31.9464 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (11,445) | (302,383) | (290,938) |
| EUR | (66,378) | C ALO FP 32.0467 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (41,090) | (297,699) | (256,609) |
| EUR | (72,443) | C ALO FP 32.5588 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (36,103) | (281,526) | (245,423) |
| EUR | (78,265) | C ALO FP 32.8153 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (40,529) | (267,243) | (226,714) |
| AUD | (73,245) | C AMC AT 16.1983 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (4,435) | (2,586) | 1,849 |
| AUD | (73,648) | C AMC AT 16.3303 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (14,420) | (3,899) | 10,521 |
| AUD | (72,146) | C AMC AT 16.6096 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (10,885) | (4,395) | 6,490 |
| AUD | (72,378) | C AMC AT 16.7856 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (10,527) | (1,522) | 9,005 |
| AUD | (59,129) | C ANZ AT 30.674 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (22,677) | (139) | 22,538 |
| AUD | (56,079) | C ANZ AT 30.7868 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (11,027) | (5,177) | 5,850 |
| AUD | (59,417) | C ANZ AT 30.8564 01/11/17 OTC | 2017年11月1日 | (13,390) | (5,745) | 7,645 |
| AUD | (56,644) | C ANZ AT 31.3948 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (15,097) | (4,861) | 10,236 |
| AUD | (49,629) | C ANZ AT 31.5635 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (13,218) | (91) | 13,127 |
| GBP | (133,291) | C ASHM LN 3.62032 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (7,735) | (452) | 7,283 |
| GBP | (152,648) | C ASHM LN 3.88437 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (8,804) | (2) | 8,802 |
| GBP | (133,336) | C ASHM LN 3.95703 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (6,319) | (2) | 6,317 |
| USD | (42) | C AVY UN 95 20/10/17 | 2017年10月20日 | (4,578) | (18,270) | (13,692) |
| USD | (4,000) | C AVY UN 98.8 20/11/17 OTC | 2017年11月20日 | (11,314) | (12,367) | (1,053) |
| GBP | (475,642) | C BA/ LN 6.23755 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (47,027) | (73,184) | (26,157) |
| GBP | (437,142) | C BA/ LN 6.23859 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (33,540) | (96,419) | (62,879) |
| GBP | (272,330) | C BA/ LN 6.30674 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (19,307) | (55,854) | (36,547) |
| GBP | (426,630) | C BA/ LN 6.50824 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (12,571) | (17,277) | (4,706) |
| USD | (275) | C BAX UN 61.5 29/09/17 | 2017年9月29日 | (22,794) | (45,375) | (22,581) |
| USD | (135) | C BAX UN 62.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (20,019) | (11,745) | 8,274 |
| USD | (236) | C BAX UN 64 03/11/17 | 2017年11月3日 | (31,146) | (20,296) | 10,850 |

| 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) | C BAX UN 64 27/10/17 | 2017年10月27日 | (12,776) | (15,800) | (3,024) |
| USD | (502) | C BAX UN 65 17/11/17 | 2017年11月17日 | (56,603) | (27,108) | 29,495 |
| USD | (716) | C BBD UN 11 20/10/17 | 2017年10月20日 | (22,637) | (20,764) | 1,873 |
| USD | (11,000) | C BBD UN 11.632 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (3,770) | (1,630) | 2,140 |
| AUD | (57,588) | C BHP AT 27.669 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (9,670) | (274) | 9,396 |
| AUD | (64,266) | C BHP AT 27.8092 13/12/17 OTC | 2017年12月13日 | (23,000) | (15,900) | 7,100 |
| AUD | (53,527) | C BHP AT 28.039 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (13,104) | (8,027) | 5,077 |
| AUD | (43,368) | C BHP AT 28.3988 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (4,852) | (405) | 4,447 |
| AUD | (12,958) | C BHP AT 28.5171 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (4,531) | (966) | 3,565 |
| AUD | (62,937) | C BHP AT 29.5145 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (14,018) | (413) | 13,605 |
| AUD | (132,584) | C BLD AT 6.8654 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (7,968) | (8,929) | (961) |
| AUD | (170,787) | C BLD AT 6.9714 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (10,889) | (19,776) | (8,887) |
| AUD | (90,670) | C BLD AT 7.0778 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (4,667) | (6,120) | (1,453) |
| AUD | (147,977) | C BLD AT 7.192 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (11,281) | (28) | 11,253 |
| AUD | (116,604) | C BLD AT 7.3223 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (7,496) | (504) | 6,992 |
| EUR | (51,065) | C BNP FP 68.4512 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (50,442) | (128,002) | (77,560) |
| EUR | (46,423) | C BNP FP 68.9756 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (12,869) | (26,159) | (13,290) |
| EUR | (51,065) | C BNP FP 69.4347 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (54,158) | (82,971) | (28,813) |
| EUR | (41,930) | C BNP FP 71.3021 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (34,013) | (11,330) | 22,683 |
| AUD | (67,856) | C BOQ AT 13.3325 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (7,326) | (3,759) | 3,567 |
| GBP | (714,638) | C BP/ LN 4.64434 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (40,826) | (151,436) | (110,610) |
| GBP | (777,567) | C BP/ LN 4.6774 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (47,388) | (147,594) | (100,206) |
| GBP | (445,197) | C BP/ LN 4.70636 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (23,438) | (82,983) | (59,545) |
| GBP | (697,446) | C BP/ LN 4.74344 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (10,747) | (76,514) | (65,767) |
| USD | (11,700) | C BRX UN 19.45 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (8,256) | (701) | 7,555 |
| USD | (22,300) | C BRX UN 19.625 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (10,254) | (5,842) | 4,412 |
| AUD | (108,572) | C BSL AT 12.272 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (17,815) | (37,252) | (19,437) |
| AUD | (90,038) | C BSL AT 13.4243 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (6,927) | (819) | 6,108 |
| USD | (166) | C C UN 67.5 06/10/17 | 2017年10月6日 | (32,329) | (81,340) | (49,011) |
| USD | (166) | C C UN 67.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (39,965) | (89,640) | (49,675) |
| USD | (360) | C C UN 69 27/10/17 | 2017年10月27日 | (40,629) | (156,600) | (115,971) |
| USD | (616) | C C UN 69.35 09/11/17 FLEX | 2017年11月9日 | (111,344) | (248,723) | (137,379) |
| USD | (133) | C C UN 70 17/11/17 | 2017年11月17日 | (20,449) | (47,880) | (27,431) |
| USD | (170) | C C UN 70 20/10/17 | 2017年10月20日 | (28,656) | (51,000) | (22,344) |
| AUD | (23,291) | C CBA AT 78.4855 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (12,404) | (6,319) | 6,085 |
| AUD | (22,953) | C CBA AT 79.5591 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (16,343) | (4,839) | 11,504 |
| AUD | (21,873) | C CBA AT 80.5225 06/12/17 OTC | 2017年12月6日 | (13,560) | (5,722) | 7,838 |
| AUD | (18,488) | C CBA AT 80.6128 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (11,619) | (3,784) | 7,835 |
| AUD | (14,617) | C CBA AT 82.3538 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (10,650) | (86) | 10,564 |
| AUD | (22,780) | C CBA AT 83.3571 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (18,563) | (776) | 17,787 |
| AUD | (20,783) | C CBA AT 86.2429 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (13,961) | 0 | 13,961 |

| 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 | (274) | C CCK UN 60 20/10/17 | 2017年10月20日 | (18,413) | (36,990) | (18,577) |
| AUD | (119,087) | C CGF AT 12.6523 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (7,861) | (14,034) | (6,173) |
| AUD | (94,089) | C CGF AT 12.871 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (10,542) | (2,178) | 8,364 |
| AUD | (91,110) | C CGF AT 13.0904 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (7,596) | (8,141) | (545) |
| AUD | (92,487) | C CGF AT 13.154 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (13,598) | (10,540) | 3,058 |
| AUD | (69,781) | C CGF AT 13.2379 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (5,753) | (234) | 5,519 |
| AUD | (104,940) | C CGF AT 13.5594 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (15,758) | (2,641) | 13,117 |
| USD | (181) | C CMCSA UQ 38.5 03/11/17 | 2017年11月3日 | (13,712) | (21,177) | (7,465) |
| USD | (243) | C CMCSA UQ 39 27/10/17 | 2017年10月27日 | (14,548) | (18,225) | (3,677) |
| USD | (188) | C CMCSA UQ 40 17/11/17 | 2017年11月17日 | (11,515) | (6,580) | 4,935 |
| USD | (66) | C CMCSA UQ 41 06/10/17 | 2017年10月6日 | (4,441) | (66) | 4,375 |
| USD | (248) | C CMCSA UQ 41 13/10/17 | 2017年10月13日 | (23,567) | (248) | 23,319 |
| USD | (192) | C CMCSA UQ 41 29/09/17 | 2017年9月29日 | (15,553) | (192) | 15,361 |
| GBP | (1,210,523) | C CNA LN 2.04617 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (46,247) | (15,854) | 30,393 |
| GBP | (1,210,523) | C CNA LN 2.04885 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (42,795) | (10,548) | 32,247 |
| GBP | (1,243,594) | C CNA LN 2.11148 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (34,316) | (650) | 33,666 |
| USD | (33) | C COF UN 82 27/10/17 | 2017年10月27日 | (5,303) | (9,240) | (3,937) |
| USD | (320) | C COF UN 83.5 06/10/17 | 2017年10月6日 | (47,922) | (34,880) | 13,042 |
| USD | (175) | C COP UN 46 13/10/17 | 2017年10月13日 | (8,533) | (70,000) | (61,467) |
| USD | (152) | C COP UN 47 20/10/17 | 2017年10月20日 | (11,958) | (48,336) | (36,378) |
| USD | (153) | C COP UN 47 27/10/17 | 2017年10月27日 | (11,224) | (48,960) | (37,736) |
| USD | (219) | C COP UN 50 20/10/17 | 2017年10月20日 | (11,116) | (18,177) | (7,061) |
| USD | (219) | C COP UN 50 27/10/17 | 2017年10月27日 | (14,182) | (21,681) | (7,499) |
| USD | (307) | C COP UN 51 03/11/17 | 2017年11月3日 | (24,792) | (23,332) | 1,460 |
| USD | (445) | C CSCO UQ 31 20/10/17 | 2017年10月20日 | (23,032) | (102,795) | (79,763) |
| USD | (361) | C CSCO UQ 32 06/10/17 | 2017年10月6日 | (12,056) | (51,623) | (39,567) |
| USD | (506) | C CSCO UQ 32 13/10/17 | 2017年10月13日 | (17,781) | (70,334) | (52,553) |
| USD | (1,659) | C CSCO UQ 32.5 27/10/17 | 2017年10月27日 | (76,771) | (179,172) | (102,401) |
| USD | (73) | C CSCO UQ 33 03/11/17 | 2017年11月3日 | (2,264) | (4,745) | (2,481) |
| USD | (290) | C CSCO UQ 33.5 03/11/17 | 2017年11月3日 | (12,400) | (12,180) | 220 |
| USD | (363) | C CSCO UQ 34 17/11/17 | 2017年11月17日 | (21,478) | (18,150) | 3,328 |
| AUD | (9,324) | C CSL AT 133.5339 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (11,765) | (16,186) | (4,421) |
| AUD | (9,081) | C CSL AT 134.9606 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (10,660) | (17,805) | (7,145) |
| AUD | (8,794) | C CSL AT 137.3134 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (11,948) | (14,343) | (2,395) |
| USD | (40) | C CVS UN 78 06/10/17 | 2017年10月6日 | (3,160) | (13,800) | (10,640) |
| USD | (43) | C CVS UN 78 29/09/17 | 2017年9月29日 | (6,224) | (12,126) | (5,902) |
| USD | (37) | C CVS UN 83 27/10/17 | 2017年10月27日 | (7,373) | (2,109) | 5,264 |
| SGD | (150,000) | C DBS SP 21.4799 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (3,405) | (11,393) | (7,988) |
| SGD | (120,000) | C DBS SP 21.6388 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (4,728) | (11,142) | (6,414) |
| USD | (272) | C DFS UN 59 13/10/17 | 2017年10月13日 | (38,829) | (68,816) | (29,987) |
| USD | (49) | C DFS UN 65 10/11/17 | 2017年11月10日 | (6,321) | (6,370) | (49) |

| 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) |
|-----|------------|----------------------------------|-------------|---------------|---------------|----------------|
| EUR | (15, 993) | C DG FP 80.7688 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (14, 785) | (24, 157) | (9, 372) |
| USD | (40) | C DG UN 80 17/11/17 | 2017年11月17日 | (5, 110) | (11, 600) | (6, 490) |
| USD | (40) | C DG UN 81 10/11/17 | 2017年11月10日 | (6, 657) | (6, 720) | (63) |
| NOK | (166, 429) | C DNB NO 157.7261 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (41, 727) | (151, 779) | (110, 052) |
| NOK | (166, 429) | C DNB NO 157.9996 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (44, 265) | (137, 570) | (93, 305) |
| NOK | (116, 328) | C DNB NO 158.631 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (7, 907) | (49, 127) | (41, 220) |
| NOK | (171, 339) | C DNB NO 163.0706 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (41, 472) | (36, 313) | 5, 159 |
| DKK | (13, 375) | C DNORD DC 139.86 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (3, 207) | (8, 387) | (5, 180) |
| AUD | (151, 053) | C DOW AT 7.0221 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (12, 938) | (19, 650) | (6, 712) |
| AUD | (126, 938) | C DOW AT 7.2935 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (10, 367) | (6, 173) | 4, 194 |
| AUD | (127, 826) | C DOW AT 7.3396 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (8, 907) | (1, 938) | 6, 969 |
| AUD | (122, 905) | C DOW AT 7.6105 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (9, 356) | (1, 530) | 7, 826 |
| USD | (12) | C DVN UN 34 27/10/17 | 2017年10月27日 | (948) | (1, 800) | (852) |
| USD | (32, 300) | C DVN UN 34.65 27/11/17 OTC | 2017年11月27日 | (61, 499) | (91, 330) | (29, 831) |
| USD | (29) | C DVN UN 35 03/11/17 | 2017年11月3日 | (4, 874) | (6, 873) | (1, 999) |
| USD | (82) | C DVN UN 35 17/11/17 | 2017年11月17日 | (8, 672) | (19, 680) | (11, 008) |
| USD | (32, 300) | C DVN UN 36.5 11/12/17 OTC | 2017年12月11日 | (71, 916) | (63, 791) | 8, 125 |
| USD | (88) | C EBAY UQ 37 20/10/17 | 2017年10月20日 | (7, 221) | (14, 520) | (7, 299) |
| USD | (4) | C EBAY UQ 38 03/11/17 | 2017年11月3日 | (520) | (540) | (20) |
| EUR | (145, 134) | C ENI IM 13.4981 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (22, 444) | (112, 516) | (90, 072) |
| EUR | (149, 099) | C ENI IM 13.5888 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (28, 891) | (85, 441) | (56, 550) |
| EUR | (145, 134) | C ENI IM 13.7965 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (25, 928) | (87, 912) | (61, 984) |
| EUR | (131, 940) | C ENI IM 14.1118 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (5, 338) | (19, 397) | (14, 059) |
| USD | (233) | C ETFC UQ 41.5 13/10/17 | 2017年10月13日 | (24, 384) | (21, 902) | 2, 482 |
| USD | (117) | C ETFC UQ 41.5 29/09/17 | 2017年9月29日 | (9, 049) | (18, 135) | (9, 086) |
| USD | (388) | C EWC UP 28.5 15/11/17 FLEX | 2017年11月15日 | (22, 798) | (31, 799) | (9, 001) |
| USD | (94) | C EXC UN 37.5 31/10/17 FLEX | 2017年10月31日 | (5, 241) | (7, 694) | (2, 453) |
| USD | (277) | C EXC UN 38 17/11/17 | 2017年11月17日 | (16, 330) | (16, 620) | (290) |
| USD | (922) | C EXC UN 38 20/10/17 | 2017年10月20日 | (62, 652) | (36, 880) | 25, 772 |
| USD | (594) | C EXC UN 38.01 06/11/17 FLEX | 2017年11月6日 | (44, 406) | (36, 159) | 8, 247 |
| USD | (159) | C FE UN 32 20/10/17 | 2017年10月20日 | (7, 156) | (795) | 6, 361 |
| USD | (159) | C FE UN 32.01 31/10/17 FLEX | 2017年10月31日 | (8, 865) | (1, 837) | 7, 028 |
| USD | (240) | C FE UN 32.55 13/11/17 FLEX | 2017年11月13日 | (16, 982) | (1, 628) | 15, 354 |
| USD | (295) | C FE UN 33 20/10/17 | 2017年10月20日 | (15, 924) | (295) | 15, 629 |
| EUR | (265, 787) | C FORTUM FH 14.6732 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (54, 141) | (679, 750) | (625, 609) |
| EUR | (258, 719) | C FORTUM FH 15.8988 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (55, 268) | (331, 529) | (276, 261) |
| EUR | (58, 691) | C FORTUM FH 16.329 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (16, 687) | (55, 705) | (39, 018) |
| EUR | (235, 199) | C FORTUM FH 17.1364 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (11, 430) | (38, 142) | (26, 712) |
| EUR | (44, 827) | C GBF GY 35.8292 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (6, 358) | (8, 951) | (2, 593) |
| EUR | (33, 202) | C GBF GY 36.4515 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (17, 722) | (18, 084) | (362) |
| EUR | (23, 235) | C GBF GY 37.23 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (11, 369) | (5, 276) | 6, 093 |

| 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) |
|-----|-----------|--------------------------------|-------------|---------------|---------------|----------------|
| EUR | (24,004) | C GBF GY 37.6608 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (12,262) | (499) | 11,763 |
| USD | (460) | C GILD UQ 82.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (134,666) | (39,560) | 95,106 |
| USD | (500) | C GILD UQ 84 13/10/17 | 2017年10月13日 | (100,642) | (17,500) | 83,142 |
| USD | (235) | C GIS UN 56.25 20/10/17 FLEX | 2017年10月20日 | (24,147) | (1,897) | 22,250 |
| USD | (316) | C GIS UN 57.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (19,706) | (4,108) | 15,598 |
| AUD | (138,276) | C GMG AT 8.441 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (10,082) | (13,819) | (3,737) |
| AUD | (105,356) | C GMG AT 8.5641 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (6,938) | (4,352) | 2,586 |
| AUD | (143,718) | C GMG AT 8.63 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (10,208) | (5,590) | 4,618 |
| AUD | (136,372) | C GMG AT 8.7925 06/12/17 OTC | 2017年12月6日 | (10,999) | (5,006) | 5,993 |
| AUD | (138,390) | C GMG AT 8.8311 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (5,548) | (31) | 5,517 |
| USD | (201) | C HIG UN 55 06/10/17 | 2017年10月6日 | (18,125) | (12,864) | 5,261 |
| USD | (185) | C HIG UN 57 29/09/17 | 2017年9月29日 | (12,581) | (555) | 12,026 |
| USD | (146) | C HOLX UQ 39 20/10/17 | 2017年10月20日 | (6,024) | (3,650) | 2,374 |
| USD | (17) | C HON UN 140 20/10/17 | 2017年10月20日 | (2,886) | (4,080) | (1,194) |
| USD | (16) | C HON UN 140.01 25/10/17 FLEX | 2017年10月25日 | (3,004) | (4,383) | (1,379) |
| GBP | (545,669) | C HSBA LN 7.49246 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (18,734) | (20,086) | (1,352) |
| GBP | (600,236) | C HSBA LN 7.60472 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (74,704) | (78,394) | (3,690) |
| GBP | (600,236) | C HSBA LN 7.86551 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (51,436) | (22,835) | 28,601 |
| EUR | (178,291) | C INGA NA 15.7607 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (8,088) | (20,325) | (12,237) |
| EUR | (113,810) | C INGA NA 15.8358 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (22,185) | (44,773) | (22,588) |
| EUR | (182,683) | C INGA NA 16.1777 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (32,238) | (34,331) | (2,093) |
| EUR | (198,773) | C INGA NA 16.9072 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (38,563) | (1,167) | 37,396 |
| USD | (60,550) | C IPG UN 20.706 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (23,851) | (37,196) | (13,345) |
| USD | (60,550) | C IPG UN 20.706 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (29,355) | (44,518) | (15,163) |
| USD | (350) | C IPG UN 23 20/10/17 | 2017年10月20日 | (7,528) | (5,250) | 2,278 |
| EUR | (337,764) | C ISPR IM 2.7992 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (13,975) | (39,274) | (25,299) |
| EUR | (384,853) | C ISPR IM 2.831 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (14,482) | (31,174) | (16,692) |
| EUR | (327,362) | C ISPR IM 2.8606 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (3,762) | (6,591) | (2,829) |
| EUR | (560,509) | C ISPR IM 2.8643 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (22,076) | (16,421) | 5,655 |
| USD | (151,800) | C ITUB UN 12.86 07/11/17 OTC | 2017年11月7日 | (85,008) | (161,310) | (76,302) |
| USD | (826) | C ITUB UN 13 20/10/17 | 2017年10月20日 | (33,045) | (61,950) | (28,905) |
| AUD | (19,823) | C JHG AT 45.2443 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (10,630) | (14,540) | (3,910) |
| AUD | (20,147) | C JHG AT 46.93 01/11/17 OTC | 2017年11月1日 | (9,726) | (4,173) | 5,553 |
| AUD | (20,148) | C JHG AT 47.7503 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (11,143) | (1,639) | 9,504 |
| AUD | (22,741) | C JHG AT 48.7531 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (11,867) | (73) | 11,794 |
| AUD | (50,344) | C JHX AT 18.6025 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (13,918) | (5,152) | 8,766 |
| AUD | (64,235) | C JHX AT 18.6765 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (12,941) | (18,106) | (5,165) |
| AUD | (66,706) | C JHX AT 19.0329 01/11/17 OTC | 2017年11月1日 | (19,680) | (7,625) | 12,055 |
| USD | (97) | C JPM UN 91 06/10/17 | 2017年10月6日 | (7,470) | (39,770) | (32,300) |
| USD | (96) | C JPM UN 92 13/10/17 | 2017年10月13日 | (10,705) | (33,120) | (22,415) |
| USD | (266) | C JPM UN 93 06/10/17 | 2017年10月6日 | (27,932) | (61,446) | (33,514) |

| 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 | (168) | C JPM UN 93.5 27/10/17 | 2017年10月27日 | (15,492) | (48,384) | (32,892) |
| USD | (168) | C JPM UN 95 17/11/17 | 2017年11月17日 | (15,751) | (38,976) | (23,225) |
| USD | (266) | C JPM UN 95 20/10/17 | 2017年10月20日 | (21,548) | (39,102) | (17,554) |
| USD | (32) | C JPM UN 95.5 10/11/17 | 2017年11月10日 | (6,072) | (6,144) | (72) |
| USD | (76) | C JPM UN 95.5 27/10/17 | 2017年10月27日 | (10,215) | (10,868) | (653) |
| USD | (160) | C JPM UN 96 03/11/17 | 2017年11月3日 | (24,280) | (20,800) | 3,480 |
| USD | (100) | C K UN 67.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (8,626) | (900) | 7,726 |
| USD | (120) | C K UN 70 20/10/17 | 2017年10月20日 | (11,980) | (360) | 11,620 |
| USD | (267) | C KR UN 22 27/10/17 | 2017年10月27日 | (10,084) | (6,675) | 3,409 |
| USD | (1,010) | C KR UN 24 29/09/17 | 2017年9月29日 | (54,295) | (5,050) | 49,245 |
| USD | (110) | C KR UN 24.5 13/10/17 | 2017年10月13日 | (3,603) | (1,100) | 2,503 |
| USD | (404) | C KR UN 24.5 29/09/17 | 2017年9月29日 | (21,314) | (404) | 20,910 |
| USD | (21) | C LEA UN 150 20/10/17 | 2017年10月20日 | (9,361) | (48,720) | (39,359) |
| USD | (134) | C LEA UN 165 20/10/17 | 2017年10月20日 | (68,049) | (123,414) | (55,365) |
| GBP | (393,453) | C LGEN LN 2.63144 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (19,680) | (28,650) | (8,970) |
| GBP | (357,684) | C LGEN LN 2.63809 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (5,560) | (6,641) | (1,081) |
| GBP | (320,426) | C LGEN LN 2.69686 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (13,871) | (2,676) | 11,195 |
| GBP | (314,762) | C LGEN LN 2.78387 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (10,604) | (3,291) | 7,313 |
| USD | (25,890) | C LKOD LI 52.28 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (12,689) | (40,663) | (27,974) |
| USD | (25,202) | C LKOD LI 54.87 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (12,427) | (23,343) | (10,916) |
| USD | (6,292) | C LKOD LI 55.31 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (1,147) | (1,029) | 118 |
| USD | (25,202) | C LKOD LI 56.32 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (11,558) | (18,248) | (6,690) |
| GBP | (1,813,445) | C LLOY LN 0.67596 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (19,760) | (58,658) | (38,898) |
| GBP | (1,648,587) | C LLOY LN 0.68937 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (5,125) | (11,735) | (6,610) |
| GBP | (1,813,445) | C LLOY LN 0.69006 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (18,118) | (36,512) | (18,394) |
| GBP | (1,862,987) | C LLOY LN 0.70583 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (17,055) | (8,016) | 9,039 |
| USD | (30) | C LOW UN 75 20/10/17 | 2017年10月20日 | (4,163) | (14,160) | (9,997) |
| USD | (24) | C LOW UN 76 06/10/17 | 2017年10月6日 | (2,134) | (7,920) | (5,786) |
| USD | (26) | C LOW UN 80 20/10/17 | 2017年10月20日 | (3,692) | (2,600) | 1,092 |
| USD | (24) | C LOW UN 81 27/10/17 | 2017年10月27日 | (2,122) | (1,968) | 154 |
| USD | (256) | C MDLZ UQ 42 06/10/17 | 2017年10月6日 | (24,112) | (1,024) | 23,088 |
| USD | (195) | C MDT UN 80 03/11/17 | 2017年11月3日 | (12,628) | (12,870) | (242) |
| USD | (76) | C MDT UN 80 06/10/17 | 2017年10月6日 | (7,809) | (532) | 7,277 |
| AUD | (499,175) | C MGR AT 2.4113 13/12/17 OTC | 2017年12月13日 | (13,491) | (10,767) | 2,724 |
| AUD | (494,202) | C MGR AT 2.4394 06/12/17 OTC | 2017年12月6日 | (13,406) | (7,115) | 6,291 |
| AUD | (491,512) | C MGR AT 2.472 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (9,545) | (1,724) | 7,821 |
| AUD | (474,840) | C MGR AT 2.491 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (11,390) | (2,615) | 8,775 |
| USD | (72) | C MPC UN 52.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (7,038) | (27,360) | (20,322) |
| USD | (140) | C MPC UN 54.5 06/10/17 | 2017年10月6日 | (14,472) | (13,300) | 1,172 |
| USD | (125) | C MPC UN 55 13/10/17 | 2017年10月13日 | (12,845) | (12,000) | 845 |
| USD | (103) | C MPC UN 56 03/11/17 | 2017年11月3日 | (12,665) | (13,287) | (622) |

| 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 | (288, 149) | C MPL AT 3. 1201 01/11/17 OTC | 2017年11月 1 日 | (7, 115) | (2, 358) | 4, 757 |
| AUD | (380, 155) | C MPL AT 3. 1329 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (11, 838) | (7, 994) | 3, 844 |
| AUD | (276, 399) | C MPL AT 3. 1515 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (5, 473) | (956) | 4, 517 |
| AUD | (13, 656) | C MQG AT 88. 4173 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (9, 558) | (38, 395) | (28, 837) |
| AUD | (13, 366) | C MQG AT 90. 9957 01/11/17 OTC | 2017年11月 1 日 | (9, 797) | (17, 384) | (7, 587) |
| AUD | (13, 555) | C MQG AT 91. 7643 04/10/17 OTC | 2017年10月 4 日 | (10, 359) | (2, 925) | 7, 434 |
| AUD | (13, 477) | C MQG AT 93. 1539 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (8, 512) | (2, 298) | 6, 214 |
| AUD | (16, 679) | C MQG AT 93. 2363 01/11/17 OTC | 2017年11月 1 日 | (12, 156) | (9, 617) | 2, 539 |
| USD | (157) | C MRO UN 11 20/10/17 | 2017年10月20日 | (8, 599) | (37, 680) | (29, 081) |
| USD | (395) | C MRO UN 13 17/11/17 | 2017年11月17日 | (28, 783) | (35, 155) | (6, 372) |
| USD | (209) | C MRO UN 14 17/11/17 | 2017年11月17日 | (7, 744) | (8, 360) | (616) |
| GBP | (1, 148, 236) | C MRW LN 2. 48734 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (12, 727) | (5, 988) | 6, 739 |
| GBP | (2, 086, 399) | C MRW LN 2. 58068 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (95, 228) | (5, 985) | 89, 243 |
| GBP | (1, 215, 302) | C MRW LN 2. 63968 07/12/17 OTC | 2017年12月 7 日 | (59, 353) | (16, 487) | 42, 866 |
| GBP | (1, 395, 256) | C MRW LN 2. 71437 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (53, 973) | (6, 490) | 47, 483 |
| USD | (332) | C MS UN 46. 5 06/10/17 | 2017年10月 6 日 | (22, 115) | (42, 828) | (20, 713) |
| USD | (154) | C MS UN 47. 5 27/10/17 | 2017年10月27日 | (15, 094) | (21, 714) | (6, 620) |
| USD | (154) | C MS UN 48 17/11/17 | 2017年11月17日 | (16, 748) | (25, 102) | (8, 354) |
| USD | (19) | C MS UN 48. 5 10/11/17 | 2017年11月10日 | (2, 237) | (2, 527) | (290) |
| USD | (101) | C MS UN 49 03/11/17 | 2017年11月 3 日 | (10, 883) | (9, 595) | 1, 288 |
| AUD | (57, 153) | C NAB AT 31. 3386 01/11/17 OTC | 2017年11月 1 日 | (15, 963) | (30, 292) | (14, 329) |
| AUD | (57, 541) | C NAB AT 31. 7274 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (7, 482) | (10, 638) | (3, 156) |
| AUD | (65, 098) | C NCM AT 23. 4339 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (6, 519) | (1, 539) | 4, 980 |
| AUD | (76, 491) | C NCM AT 24. 4346 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (19, 816) | (4, 317) | 15, 499 |
| AUD | (11, 170) | C NCM AT 24. 4959 08/11/17 OTC | 2017年11月 8 日 | (2, 610) | (197) | 2, 413 |
| USD | (28, 800) | C NDAQ UQ 76. 027 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (32, 256) | (60, 758) | (28, 502) |
| USD | (218) | C NDAQ UQ 77. 5 17/11/17 | 2017年11月17日 | (41, 366) | (14, 170) | 27, 196 |
| USD | (364) | C NLSN UN 40 17/11/17 | 2017年11月17日 | (57, 547) | (75, 712) | (18, 165) |
| USD | (632) | C NLSN UN 40. 1 20/10/17 FLEX | 2017年10月20日 | (83, 269) | (117, 014) | (33, 745) |
| USD | (28) | C NSC UN 123 13/10/17 | 2017年10月13日 | (7, 497) | (17, 920) | (10, 423) |
| USD | (120) | C NSC UN 127 27/10/17 | 2017年10月27日 | (50, 610) | (77, 160) | (26, 550) |
| USD | (12) | C NSC UN 130 17/11/17 | 2017年11月17日 | (5, 442) | (7, 608) | (2, 166) |
| USD | (91) | C NVS UN 85 20/10/17 | 2017年10月20日 | (9, 920) | (8, 736) | 1, 184 |
| SGD | (120, 000) | C OCBC SP 11. 5232 09/11/17 OTC | 2017年11月 9 日 | (3, 816) | (5, 770) | (1, 954) |
| SGD | (140, 000) | C OCBC SP 11. 5752 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (4, 032) | (3, 076) | 956 |
| USD | (28, 800) | C OMC UN 74. 523 02/11/17 OTC | 2017年11月 2 日 | (31, 933) | (50, 807) | (18, 874) |
| PLN | (330, 601) | C OPL PW 6. 12 07/12/17 OTC | 2017年12月 7 日 | (7, 913) | (3, 719) | 3, 994 |
| AUD | (331, 347) | C ORA AT 3. 2667 01/11/17 OTC | 2017年11月 1 日 | (12, 080) | (7, 251) | 4, 829 |
| AUD | (289, 084) | C ORA AT 3. 2736 04/10/17 OTC | 2017年10月 4 日 | (6, 713) | (132) | 6, 581 |
| AUD | (359, 704) | C ORA AT 3. 4437 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (13, 539) | (5, 805) | 7, 734 |
| USD | (147) | C ORCL UN 49 29/09/17 | 2017年 9 月29日 | (17, 494) | (294) | 17, 200 |

| 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 | (348) | C ORCL UN 50 03/11/17 | 2017年11月3日 | (13,176) | (13,920) | (744) |
| USD | (6) | C ORCL UN 50 20/10/17 | 2017年10月20日 | (597) | (114) | 483 |
| USD | (11) | C ORCL UN 50 29/09/17 | 2017年9月29日 | (974) | (11) | 963 |
| USD | (160) | C ORCL UN 51 27/10/17 | 2017年10月27日 | (6,841) | (1,280) | 5,561 |
| USD | (160) | C ORCL UN 51.1 17/11/17 | FLEX 2017年11月17日 | (9,561) | (3,575) | 5,986 |
| USD | (40) | C ORCL UN 52.5 29/09/17 | 2017年9月29日 | (3,550) | (40) | 3,510 |
| USD | (41) | C ORCL UN 53 13/10/17 | 2017年10月13日 | (3,229) | (82) | 3,147 |
| AUD | (128,902) | C ORG AT 7.3193 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (13,021) | (18,773) | (5,752) |
| AUD | (148,738) | C ORG AT 8.2681 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (22,057) | (5,952) | 16,105 |
| USD | (500) | C PBR UN 11 15/12/17 | 2017年12月15日 | (20,879) | (16,500) | 4,379 |
| USD | (725) | C PBR UN 11 17/11/17 | 2017年11月17日 | (20,124) | (16,675) | 3,449 |
| USD | (750) | C PBR UN 9 20/10/17 | 2017年10月20日 | (29,802) | (90,000) | (60,198) |
| USD | (500) | C PBR UN 9.5 13/10/17 | 2017年10月13日 | (11,832) | (30,000) | (18,168) |
| USD | (90) | C PCG UN 70.91 27/10/17 | FLEX 2017年10月27日 | (6,098) | (1,419) | 4,679 |
| USD | (1) | C PEP UN 115 17/11/17 | 2017年11月17日 | (121) | (107) | 14 |
| USD | (74) | C PEP UN 115 27/10/17 | 2017年10月27日 | (12,580) | (5,032) | 7,548 |
| USD | (1) | C PEP UN 117 06/10/17 | 2017年10月6日 | (102) | (7) | 95 |
| USD | (130) | C PFE UN 33.55 05/10/17 | FLEX 2017年10月5日 | (3,349) | (24,708) | (21,359) |
| USD | (358) | C PFE UN 33.75 12/10/17 | FLEX 2017年10月12日 | (12,801) | (62,275) | (49,474) |
| USD | (219) | C PFE UN 34 06/10/17 | 2017年10月6日 | (6,846) | (33,288) | (26,442) |
| USD | (517) | C PFE UN 34 17/11/17 | 2017年11月17日 | (43,027) | (91,509) | (48,482) |
| USD | (561) | C PFE UN 34 20/10/17 | 2017年10月20日 | (17,422) | (85,272) | (67,850) |
| USD | (701) | C PFE UN 35.4 13/11/17 | FLEX 2017年11月13日 | (44,546) | (41,623) | 2,923 |
| USD | (284) | C PFE UN 35.5 10/11/17 | 2017年11月10日 | (19,811) | (20,164) | (353) |
| USD | (100) | C PFE UN 35.5 27/10/17 | 2017年10月27日 | (4,276) | (5,000) | (724) |
| USD | (135) | C PFE UN 36 03/11/17 | 2017年11月3日 | (5,673) | (7,965) | (2,292) |
| USD | (626) | C PFE UN 36 15/12/17 | 2017年12月15日 | (47,424) | (36,308) | 11,116 |
| PLN | (338,577) | C PGE PW 15.03 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (19,162) | (18,386) | 776 |
| PLN | (193,943) | C PGE PW 15.9 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (10,818) | (3,761) | 7,057 |
| USD | (36,400) | C PHG UN 38.097 20/10/17 | OTC 2017年10月20日 | (30,358) | (111,381) | (81,023) |
| USD | (21,700) | C PHG UN 38.208 11/10/17 | OTC 2017年10月11日 | (18,061) | (63,141) | (45,080) |
| USD | (67) | C PHG UN 40 20/10/17 | 2017年10月20日 | (10,653) | (8,844) | 1,809 |
| USD | (54) | C PKG UN 115 20/10/17 | 2017年10月20日 | (8,596) | (11,340) | (2,744) |
| USD | (200) | C PKG UN 117 16/10/17 | OTC 2017年10月16日 | (286) | (194) | 92 |
| USD | (37) | C PM UN 115 17/11/17 | 2017年11月17日 | (6,026) | (4,736) | 1,290 |
| USD | (14) | C PM UN 115.75 20/10/17 | FLEX 2017年10月20日 | (3,161) | (480) | 2,681 |
| USD | (39) | C PPG UN 110 20/10/17 | 2017年10月20日 | (6,024) | (8,385) | (2,361) |
| USD | (160) | C PRU UN 105 20/10/17 | 2017年10月20日 | (31,001) | (36,800) | (5,799) |
| GBP | (231,495) | C PSON LN 6.24698 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (6,258) | (40,348) | (34,090) |
| GBP | (254,644) | C PSON LN 6.42549 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (29,386) | (55,408) | (26,022) |
| GBP | (254,644) | C PSON LN 6.71904 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (28,377) | (21,515) | 6,862 |

| 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 | (261, 601) | C PSON LN 7. 09088 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (33, 083) | (2, 346) | 30, 737 |
| AUD | (113, 837) | C QBE AT 10. 9104 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (10, 189) | (2, 748) | 7, 441 |
| AUD | (107, 806) | C QBE AT 11. 3491 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (10, 672) | (4, 389) | 6, 283 |
| AUD | (111, 345) | C QBE AT 11. 4868 08/11/17 OTC | 2017年11月 8 日 | (10, 297) | (1, 603) | 8, 694 |
| AUD | (46, 424) | C QBE AT 12. 0866 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (4, 816) | (10) | 4, 806 |
| USD | (540) | C QCOM UQ 50 20/10/17 | 2017年10月20日 | (65, 208) | (109, 080) | (43, 872) |
| USD | (302) | C QCOM UQ 52 29/09/17 | 2017年 9 月29日 | (33, 750) | (906) | 32, 844 |
| USD | (381) | C QCOM UQ 52. 5 17/11/17 | 2017年11月17日 | (55, 152) | (60, 579) | (5, 427) |
| USD | (301) | C QCOM UQ 53 03/11/17 | 2017年11月 3 日 | (34, 464) | (32, 207) | 2, 257 |
| GBP | (518, 609) | C RBS LN 2. 72164 07/12/17 OTC | 2017年12月 7 日 | (21, 651) | (68, 025) | (46, 374) |
| GBP | (471, 463) | C RBS LN 2. 72772 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (5, 672) | (22, 518) | (16, 846) |
| GBP | (532, 778) | C RBS LN 2. 79526 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (18, 046) | (17, 169) | 877 |
| GBP | (518, 609) | C RBS LN 2. 86931 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (17, 006) | (22, 649) | (5, 643) |
| USD | (745) | C RDSA 57. 5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (46, 753) | (236, 165) | (189, 412) |
| USD | (92) | C RDSA 57. 8 17/11/17 FLEX | 2017年11月17日 | (8, 258) | (23, 210) | (14, 952) |
| AUD | (12, 941) | C REA AT 71. 3581 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (6, 560) | (2, 593) | 3, 967 |
| AUD | (16, 404) | C REA AT 74. 38 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (14, 054) | (4, 494) | 9, 560 |
| USD | (39, 700) | C RF UN 14. 352 04/12/17 OTC | 2017年12月 4 日 | (18, 040) | (50, 007) | (31, 967) |
| USD | (12, 800) | C RF UN 14. 549 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (5, 092) | (11, 703) | (6, 611) |
| USD | (306) | C RF UN 15 17/11/17 | 2017年11月17日 | (9, 106) | (18, 054) | (8, 948) |
| AUD | (17, 551) | C RHC AT 69. 9096 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (11, 104) | (1, 197) | 9, 907 |
| AUD | (23, 264) | C RIO AT 67. 8627 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (13, 277) | (8, 974) | 4, 303 |
| AUD | (21, 100) | C RIO AT 70. 6902 13/12/17 OTC | 2017年12月13日 | (19, 997) | (18, 478) | 1, 519 |
| AUD | (22, 455) | C RIO AT 70. 6937 01/11/17 OTC | 2017年11月 1 日 | (13, 217) | (6, 670) | 6, 547 |
| AUD | (21, 347) | C RIO AT 71. 9844 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (16, 558) | (10, 067) | 6, 491 |
| AUD | (25, 047) | C RIO AT 73. 0491 08/11/17 OTC | 2017年11月 8 日 | (22, 070) | (3, 780) | 18, 290 |
| AUD | (19, 360) | C RIO AT 73. 2745 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (6, 957) | (53) | 6, 904 |
| AUD | (120, 919) | C RMD AT 10. 2693 08/11/17 OTC | 2017年11月 8 日 | (10, 179) | (7, 671) | 2, 508 |
| AUD | (94, 889) | C RMD AT 9. 7809 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (13, 774) | (11, 888) | 1, 886 |
| USD | (174) | C RS UN 75 20/10/17 | 2017年10月20日 | (14, 393) | (40, 020) | (25, 627) |
| EUR | (50, 722) | C SAN FP 85. 2933 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (12, 482) | (15, 292) | (2, 810) |
| EUR | (57, 685) | C SAN FP 86. 1264 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (68, 758) | (20, 988) | 47, 770 |
| EUR | (56, 916) | C SAN FP 86. 3692 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (66, 144) | (58, 194) | 7, 950 |
| EUR | (56, 916) | C SAN FP 87. 0193 07/12/17 OTC | 2017年12月 7 日 | (62, 085) | (60, 740) | 1, 345 |
| AUD | (335, 539) | C SCG AT 4. 0589 08/11/17 OTC | 2017年11月 8 日 | (13, 633) | (8, 717) | 4, 916 |
| AUD | (303, 862) | C SCG AT 4. 0841 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (7, 058) | (942) | 6, 116 |
| AUD | (282, 488) | C SCG AT 4. 116 06/12/17 OTC | 2017年12月 6 日 | (12, 615) | (9, 273) | 3, 342 |
| AUD | (286, 359) | C SCG AT 4. 1909 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (15, 401) | (3, 074) | 12, 327 |
| EUR | (22, 717) | C SGO FP 49. 672 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (17, 239) | (50, 805) | (33, 566) |
| EUR | (22, 717) | C SGO FP 50. 5509 07/12/17 OTC | 2017年12月 7 日 | (19, 283) | (44, 200) | (24, 917) |
| EUR | (20, 652) | C SGO FP 51. 6223 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (4, 267) | (6, 602) | (2, 335) |

| 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 | (165) | C SJM UN 110 20/10/17 | 2017年10月20日 | (20,459) | (4,950) | 15,509 |
| USD | (34,500) | C SLM UQ 10.431 06/11/17 OTC | 2017年11月6日 | (14,186) | (41,981) | (27,795) |
| USD | (46,300) | C SLM UQ 10.793 29/09/17 OTC | 2017年9月29日 | (14,117) | (33,656) | (19,539) |
| USD | (33,000) | C SLM UQ 10.887 31/10/17 OTC | 2017年10月31日 | (10,636) | (26,925) | (16,289) |
| USD | (330) | C SLM UQ 11 17/11/17 | 2017年11月17日 | (14,440) | (15,510) | (1,070) |
| USD | (462) | C SLM UQ 11 20/10/17 | 2017年10月20日 | (13,748) | (27,720) | (13,972) |
| CHF | (19,284) | C SREN VX 88.4895 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (5,986) | (15,847) | (9,861) |
| CHF | (21,213) | C SREN VX 89.5846 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (16,826) | (34,602) | (17,776) |
| CHF | (21,213) | C SREN VX 91.5215 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (23,188) | (17,661) | 5,527 |
| CHF | (4,693) | C SREN VX 96.5862 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (4,717) | (156) | 4,561 |
| NOK | (53,036) | C STL NO 153.3438 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (11,847) | (48,070) | (36,223) |
| NOK | (69,923) | C STL NO 153.4 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (20,065) | (67,640) | (47,575) |
| NOK | (71,833) | C STL NO 154.6862 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (16,676) | (56,039) | (39,363) |
| NOK | (45,853) | C STL NO 159.9156 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (3,141) | (12,858) | (9,717) |
| AUD | (278,618) | C STO AT 4.3089 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (15,458) | (12,393) | 3,065 |
| USD | (23) | C SU UN 35 15/12/17 | 2017年12月15日 | (2,363) | (2,760) | (397) |
| USD | (68) | C SU UN 35 17/11/17 | 2017年11月17日 | (5,088) | (7,004) | (1,916) |
| GBP | (179,080) | C S32 LN 2.01942 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (4,886) | (13,076) | (8,190) |
| GBP | (355,838) | C S32 LN 2.02948 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (3,126) | (8,028) | (4,902) |
| AUD | (76,792) | C TCL AT 12.3418 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (6,762) | (2,637) | 4,125 |
| AUD | (120,244) | C TCL AT 12.4128 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (4,361) | (5,051) | (690) |
| AUD | (95,505) | C TCL AT 12.579 22/11/17 OTC | 2017年11月22日 | (9,174) | (7,087) | 2,087 |
| AUD | (96,204) | C TCL AT 12.7518 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (4,525) | (2) | 4,523 |
| AUD | (135,490) | C TCL AT 12.7554 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (13,656) | (4,227) | 9,429 |
| USD | (35,500) | C TDS UN 27.146 30/10/17 OTC | 2017年10月30日 | (30,857) | (44,747) | (13,890) |
| USD | (63,000) | C TDS UN 28.808 01/12/17 OTC | 2017年12月1日 | (44,404) | (44,114) | 288 |
| USD | (37,000) | C TDS UN 29.36 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (24,492) | (3,423) | 21,071 |
| USD | (23,000) | C TDS UN 29.37 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (24,380) | (8,145) | 16,235 |
| EUR | (44,534) | C TEN IM 12.6941 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (5,358) | (12,458) | (7,100) |
| EUR | (44,534) | C TEN IM 12.869 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (8,101) | (13,105) | (5,004) |
| EUR | (40,485) | C TEN IM 13.2047 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (1,473) | (1,178) | 295 |
| EUR | (45,750) | C TEN IM 15.0309 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (9,095) | (218) | 8,877 |
| GBP | (1,759,414) | C TSCO LN 1.88706 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (49,931) | (99,128) | (49,197) |
| GBP | (1,712,627) | C TSCO LN 2.03504 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (40,364) | (20,616) | 19,748 |
| GBP | (1,712,627) | C TSCO LN 2.04835 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (46,542) | (26,585) | 19,957 |
| GBP | (1,556,934) | C TSCO LN 2.0973 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (9,680) | (835) | 8,845 |
| TRY | (211,555) | C TTKOM TI 7.24787 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (1,001) | (1,037) | (36) |
| TRY | (155,487) | C TTKOM TI 7.70137 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (3,765) | (1,695) | 2,070 |
| TRY | (232,711) | C TTKOM TI 7.80364 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (6,206) | (3,024) | 3,182 |
| AUD | (72,267) | C TWE AT 13.3612 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (10,181) | (20,776) | (10,595) |
| AUD | (80,908) | C TWE AT 15.2745 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (11,058) | (15) | 11,043 |

| 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 | (114) | C UN UN 60 20/10/17 | 2017年10月20日 | (12,712) | (5,130) | 7,582 |
| USD | (131) | C UN UN 62.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (4,455) | (1,048) | 3,407 |
| SGD | (80,000) | C UOB SP 24.102 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (5,264) | (8,384) | (3,120) |
| SGD | (80,000) | C UOB SP 24.6926 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (3,920) | (352) | 3,568 |
| USD | (28) | C UPS UN 115 06/10/17 | 2017年10月6日 | (3,920) | (10,780) | (6,860) |
| USD | (24) | C UPS UN 118 27/10/17 | 2017年10月27日 | (4,554) | (5,616) | (1,062) |
| USD | (25) | C UPS UN 119 27/10/17 | 2017年10月27日 | (4,219) | (5,775) | (1,556) |
| EUR | (83,500) | C VK FP 5.7404 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (5,852) | (7,002) | (1,150) |
| EUR | (75,909) | C VK FP 6.3028 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (1,108) | (30) | 1,078 |
| USD | (86) | C VLO UN 69.5 13/10/17 | 2017年10月13日 | (15,522) | (48,848) | (33,326) |
| USD | (30) | C VLO UN 70 06/10/17 | 2017年10月6日 | (3,241) | (15,900) | (12,659) |
| USD | (11) | C VLO UN 70 20/10/17 | 2017年10月20日 | (1,607) | (7,535) | (5,928) |
| USD | (36) | C VLO UN 70.5 27/10/17 | 2017年10月27日 | (7,263) | (22,860) | (15,597) |
| USD | (76) | C VLO UN 75 17/11/17 | 2017年11月17日 | (12,158) | (26,904) | (14,746) |
| GBP | (613,313) | C VOD LN 2.22613 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (6,134) | (1,348) | 4,786 |
| GBP | (674,644) | C VOD LN 2.22621 07/12/17 OTC | 2017年12月7日 | (24,623) | (11,178) | 13,445 |
| GBP | (674,644) | C VOD LN 2.32293 23/11/17 OTC | 2017年11月23日 | (22,814) | (2,487) | 20,327 |
| GBP | (149,205) | C VOD LN 2.33915 26/10/17 OTC | 2017年10月26日 | (4,508) | (140) | 4,368 |
| USD | (228) | C VZ UN 47 17/11/17 | 2017年11月17日 | (21,604) | (51,300) | (29,696) |
| USD | (79) | C VZ UN 47 27/10/17 | 2017年10月27日 | (4,563) | (19,671) | (15,108) |
| USD | (471) | C VZ UN 48.9 29/09/17 FLEX | 2017年9月29日 | (33,797) | (16,483) | 17,314 |
| USD | (344) | C VZ UN 49 06/10/17 | 2017年10月6日 | (16,773) | (14,104) | 2,669 |
| USD | (225) | C WBA UQ 79 03/11/17 | 2017年11月3日 | (44,495) | (51,750) | (7,255) |
| USD | (460) | C WBA UQ 82.5 20/10/17 | 2017年10月20日 | (83,147) | (3,220) | 79,927 |
| AUD | (53,390) | C WBC AT 32.2199 06/12/17 OTC | 2017年12月6日 | (15,237) | (14,093) | 1,144 |
| AUD | (45,630) | C WBC AT 32.4786 13/12/17 OTC | 2017年12月13日 | (14,466) | (17,151) | (2,685) |
| AUD | (64,794) | C WBC AT 32.5414 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (12,515) | (12,123) | 392 |
| AUD | (44,779) | C WBC AT 32.9758 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (12,420) | (9,814) | 2,606 |
| AUD | (53,463) | C WBC AT 33.1968 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (10,070) | (7,230) | 2,840 |
| AUD | (46,223) | C WBC AT 34.2808 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (9,931) | (16) | 9,915 |
| AUD | (56,095) | C WOW AT 26.4553 13/12/17 OTC | 2017年12月13日 | (12,565) | (12,412) | 153 |
| AUD | (67,482) | C WOW AT 26.5896 15/11/17 OTC | 2017年11月15日 | (14,064) | (6,643) | 7,421 |
| AUD | (44,558) | C WOW AT 26.5983 29/11/17 OTC | 2017年11月29日 | (10,056) | (6,654) | 3,402 |
| AUD | (30,540) | C WPL AT 30.8503 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (7,651) | (156) | 7,495 |
| AUD | (34,697) | C WPL AT 31.4648 08/11/17 OTC | 2017年11月8日 | (9,835) | (1,539) | 8,296 |
| AUD | (40,935) | C WPL AT 31.4801 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (10,337) | (562) | 9,775 |
| USD | (357) | C ZBH UN 115 20/10/17 | 2017年10月20日 | (72,224) | (85,680) | (13,456) |
| USD | (31,700) | C ZBH UN 118.21 20/11/17 OTC | 2017年11月20日 | (72,761) | (86,232) | (13,471) |
| KRW | (20,000) | C 005830 KP 79602.6 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (3,336) | (585) | 2,751 |
| HKD | (3,000,000) | C 1288 HK 3.6788 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (6,600) | (7,029) | (429) |
| HKD | (350,000) | C 1299 HK 62.7328 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (24,360) | (2,764) | 21,596 |

| 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) |
|-----|-------------|-----------------------------------|-------------|---------------|---------------|----------------|
| HKD | (1,500,000) | C 1398 HK 6.1632 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (7,500) | (8,966) | (1,466) |
| HKD | (1,900,000) | C 1398 HK 6.1632 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (7,030) | (6,616) | 414 |
| HKD | (2,000,000) | C 1398 HK 6.2169 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (10,800) | (1,091) | 9,709 |
| JPY | (20,000) | C 1802 JT 1374.5025 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (749) | (820) | (71) |
| JPY | (1,500) | C 1878 JT 19790.317 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (693) | (9,523) | (8,830) |
| JPY | (2,000) | C 1878 JT 19831.5685 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (636) | (11,939) | (11,303) |
| JPY | (10,000) | C 1925 JT 3867.4847 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (756) | (3,090) | (2,334) |
| JPY | (11,000) | C 1925 JT 3895.892 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (570) | (2,315) | (1,745) |
| JPY | (10,000) | C 1925 JT 3945.6113 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (481) | (2,237) | (1,756) |
| JPY | (9,000) | C 1925 JT 3948.7864 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (490) | (2,078) | (1,588) |
| JPY | (9,000) | C 1925 JT 4055.9264 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (749) | (834) | (85) |
| JPY | (10,000) | C 1925 JT 4060.16 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (700) | (1,477) | (777) |
| JPY | (10,000) | C 1925 JT 4061.5875 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (1,061) | (1,542) | (481) |
| JPY | (18,000) | C 1928 JT 1934.563 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (788) | (555) | 233 |
| JPY | (16,000) | C 1928 JT 1939.686 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (430) | (1,086) | (656) |
| JPY | (16,000) | C 1928 JT 1963.4536 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (402) | (1,343) | (941) |
| JPY | (15,000) | C 1928 JT 1973.62 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (599) | (1,068) | (469) |
| TWD | (500,000) | C 2317 TT 112.32 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (9,600) | (3,454) | 6,146 |
| TWD | (800,000) | C 2330 TT 225.9124 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (20,240) | (199) | 20,041 |
| TWD | (500,000) | C 2330 TT 227.9461 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (6,500) | (681) | 5,819 |
| TWD | (800,000) | C 2330 TT 232.05 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (4,720) | (887) | 3,833 |
| TWD | (1,000,000) | C 2882 TT 50.1096 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (3,700) | (905) | 2,795 |
| TWD | (1,000,000) | C 2882 TT 50.2584 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (3,500) | (45) | 3,455 |
| TWD | (1,500,000) | C 2882 TT 50.2725 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (3,900) | (2,653) | 1,247 |
| JPY | (13,000) | C 2914 JT 3849.552 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (440) | (3) | 437 |
| JPY | (10,000) | C 2914 JT 3865.05 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (500) | (222) | 278 |
| JPY | (10,000) | C 2914 JT 3866.1 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (495) | (641) | (146) |
| JPY | (12,000) | C 2914 JT 3874.8549 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (607) | (41) | 566 |
| JPY | (8,000) | C 2914 JT 3886.05 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (372) | (139) | 233 |
| JPY | (13,000) | C 2914 JT 3903.9 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (966) | (92) | 874 |
| JPY | (10,000) | C 2914 JT 3906 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (333) | (141) | 192 |
| JPY | (6,000) | C 3382 JT 4559.36 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (613) | (259) | 354 |
| HKD | (1,900,000) | C 386 HK 6.2265 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (8,170) | (3,432) | 4,738 |
| HKD | (2,400,000) | C 3988 HK 4.0916 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (6,960) | (7,399) | (439) |
| HKD | (3,700,000) | C 3988 HK 4.134 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (9,250) | (4,751) | 4,499 |
| JPY | (30,000) | C 4188 JT 1069.8502 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (633) | (3,571) | (2,938) |
| JPY | (35,000) | C 4188 JT 1098.5262 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (1,061) | (1,255) | (194) |
| JPY | (30,000) | C 4188 JT 1103.2056 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (709) | (1,021) | (312) |
| JPY | (25,000) | C 4188 JT 1142.225 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (431) | (642) | (211) |
| JPY | (4,000) | C 4452 JT 6833.4 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (714) | (1,620) | (906) |
| JPY | (4,500) | C 4452 JT 7061.25 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (511) | (156) | 355 |

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) |
|-----|----------|----------------------------------|-------------|---------------|---------------|----------------|
| JPY | (4,000) | C 4452 JT 7129.85 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (548) | (1) | 547 |
| JPY | (6,000) | C 4452 JT 7181.286 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (522) | (7) | 515 |
| JPY | (5,000) | C 4502 JT 6204.1273 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (356) | (2,407) | (2,051) |
| JPY | (6,000) | C 4502 JT 6258.353 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (534) | (1,766) | (1,232) |
| JPY | (7,000) | C 4502 JT 6297.4303 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (900) | (2,135) | (1,235) |
| JPY | (6,000) | C 4502 JT 6326.775 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (529) | (1,612) | (1,083) |
| JPY | (8,000) | C 4502 JT 6358.2584 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (767) | (1,180) | (413) |
| JPY | (5,000) | C 4502 JT 6374.16 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (275) | (1,095) | (820) |
| JPY | (6,000) | C 4502 JT 6378.1016 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (568) | (888) | (320) |
| JPY | (25,000) | C 4503 JT 1454.4816 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (871) | (1,716) | (845) |
| JPY | (21,000) | C 4503 JT 1464.4968 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (676) | (1,063) | (387) |
| JPY | (20,000) | C 4503 JT 1488.9 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (903) | (1,331) | (428) |
| JPY | (7,000) | C 4519 JT 4968.8874 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (699) | (407) | 292 |
| JPY | (14,000) | C 4568 JT 2616.0105 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (716) | (71) | 645 |
| JPY | (15,000) | C 4568 JT 2679.5199 20/10/17 OTC | 2017年10月20日 | (658) | (464) | 194 |
| JPY | (12,000) | C 4568 JT 2705.3332 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (396) | (50) | 346 |
| JPY | (5,000) | C 4578 JT 4549.184 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (529) | (1,069) | (540) |
| JPY | (9,000) | C 4578 JT 4566.282 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (716) | (911) | (195) |
| JPY | (8,000) | C 4578 JT 4615.8105 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (681) | (38) | 643 |
| JPY | (6,000) | C 4578 JT 4697.9279 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (573) | (474) | 99 |
| JPY | (7,000) | C 4578 JT 4741.0304 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (850) | (374) | 476 |
| JPY | (30,000) | C 4902 JT 1009.01 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (507) | (341) | 166 |
| JPY | (28,000) | C 4902 JT 906.4 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (351) | (5,708) | (5,357) |
| JPY | (40,000) | C 4902 JT 907.943 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (1,131) | (7,438) | (6,307) |
| JPY | (35,000) | C 4902 JT 909.6496 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (554) | (5,475) | (4,921) |
| JPY | (60,000) | C 5020 JT 566.748 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (657) | (7,583) | (6,926) |
| JPY | (70,000) | C 5020 JT 568.3496 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (451) | (7,524) | (7,073) |
| JPY | (70,000) | C 5020 JT 568.4595 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (485) | (8,287) | (7,802) |
| JPY | (60,000) | C 5020 JT 568.743 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (413) | (7,800) | (7,387) |
| JPY | (60,000) | C 5020 JT 570.5874 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (474) | (5,797) | (5,323) |
| JPY | (18,000) | C 5802 JT 1779.051 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (499) | (10,056) | (9,557) |
| JPY | (19,000) | C 5802 JT 1815.5389 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (892) | (7,591) | (6,699) |
| JPY | (14,000) | C 5938 JT 3014.4975 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (1,040) | (1,426) | (386) |
| JPY | (11,000) | C 5938 JT 3127.1166 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (796) | (671) | 125 |
| JPY | (9,000) | C 5938 JT 3208.4369 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (666) | (154) | 512 |
| JPY | (10,000) | C 6301 JT 3359.7535 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (668) | (35) | 633 |
| JPY | (12,000) | C 6301 JT 3378.1046 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (658) | (137) | 521 |
| JPY | (13,000) | C 6301 JT 3393.7297 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (787) | (338) | 449 |
| JPY | (9,000) | C 6301 JT 3437.91 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (946) | (783) | 163 |
| JPY | (45,000) | C 6501 JT 782.1952 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (609) | (5,366) | (4,757) |
| JPY | (50,000) | C 6501 JT 795.4982 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (515) | (3,079) | (2,564) |

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) |
|-----|----------|-----------------------------------|-------------|---------------|---------------|----------------|
| JPY | (20,000) | C 6503 JT 1750.378 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (999) | (3,625) | (2,626) |
| JPY | (25,000) | C 6503 JT 1816.1966 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (1,086) | (1,747) | (661) |
| JPY | (20,000) | C 6503 JT 1819.8453 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (680) | (1,410) | (730) |
| JPY | (15,000) | C 6503 JT 1848.96 23/10/17 OTC | 2017年10月23日 | (780) | (1,308) | (528) |
| JPY | (14,000) | C 6503 JT 1865.07 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (508) | (667) | (159) |
| JPY | (21,000) | C 6503 JT 1888.39 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (939) | (255) | 684 |
| JPY | (28,000) | C 6752 JT 1568.2488 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (573) | (15,673) | (15,100) |
| JPY | (18,000) | C 6752 JT 1571.4924 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (857) | (9,977) | (9,120) |
| JPY | (25,000) | C 6752 JT 1715.21 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (719) | (1,921) | (1,202) |
| JPY | (1,500) | C 6981 JT 17530.4413 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (541) | (30) | 511 |
| JPY | (2,000) | C 6981 JT 18168.6 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (815) | (303) | 512 |
| JPY | (2,000) | C 6981 JT 18355.85 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (584) | (44) | 540 |
| JPY | (2,000) | C 6981 JT 18484.25 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (650) | (74) | 576 |
| JPY | (6,000) | C 7011 JT 4402.9610 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (336) | (3,870) | (3,534) |
| JPY | (8,000) | C 7011 JT 4573.8000 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (465) | (1,708) | (1,243) |
| JPY | (7,000) | C 7011 JT 4722.8046 23/10/17 OTC | 2017年10月23日 | (519) | (1,041) | (522) |
| JPY | (35,000) | C 7201 JT 1125.8 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (523) | (1,395) | (872) |
| JPY | (40,000) | C 7201 JT 1127.815 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (810) | (1,641) | (831) |
| JPY | (35,000) | C 7201 JT 1158.2584 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (356) | (169) | 187 |
| JPY | (30,000) | C 7201 JT 1170.75 23/10/17 OTC | 2017年10月23日 | (799) | (856) | (57) |
| JPY | (38,000) | C 7201 JT 1173.12 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (545) | (324) | 221 |
| JPY | (35,000) | C 7201 JT 1175.2 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (537) | (141) | 396 |
| JPY | (40,000) | C 7201 JT 1190.165 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (414) | (92) | 322 |
| JPY | (40,000) | C 7201 JT 1194.44 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (453) | (51) | 402 |
| JPY | (30,000) | C 7201 JT 1195.83 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (344) | (161) | 183 |
| JPY | (25,000) | C 7201 JT 1196.8483 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (309) | (108) | 201 |
| JPY | (30,000) | C 7201 JT 1208.48 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (372) | (56) | 316 |
| JPY | (18,000) | C 7202 JT 1534.505 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (762) | (647) | 115 |
| JPY | (20,000) | C 7202 JT 1569.1796 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (531) | (455) | 76 |
| JPY | (24,000) | C 7202 JT 1575.9923 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (450) | (582) | (132) |
| JPY | (27,000) | C 7202 JT 1612.3402 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (584) | (374) | 210 |
| JPY | (20,000) | C 7202 JT 1624.204 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (407) | (259) | 148 |
| JPY | (22,000) | C 7202 JT 1630.5868 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (1,053) | (206) | 847 |
| JPY | (5,000) | C 7203 JT 6416.8 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (539) | (13,096) | (12,557) |
| JPY | (7,000) | C 7203 JT 6666.4 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (693) | (6,726) | (6,033) |
| JPY | (5,000) | C 7203 JT 6908.72 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (417) | (868) | (451) |
| JPY | (5,000) | C 7203 JT 7022.7973 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (483) | (599) | (116) |
| JPY | (6,000) | C 7203 JT 7058.1 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (362) | (480) | (118) |
| JPY | (5,000) | C 7203 JT 7090.65 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (747) | (601) | 146 |
| JPY | (6,000) | C 7203 JT 7103.2 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (625) | (410) | 215 |
| JPY | (40,000) | C 7211 JT 845.3713 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (428) | (16,136) | (15,708) |

| 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 | (35,000) | C 7211 JT 855.6148 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (590) | (11,358) | (10,768) |
| JPY | (45,000) | C 7211 JT 872.6734 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (997) | (9,463) | (8,466) |
| JPY | (8,000) | C 7259 JT 5863.6 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (438) | (8,999) | (8,561) |
| JPY | (10,000) | C 7267 JT 3233.5398 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (541) | (8,936) | (8,395) |
| JPY | (9,000) | C 7270 JT 4062.45 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (631) | (3,965) | (3,334) |
| JPY | (10,000) | C 7270 JT 4134.9 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (706) | (3,504) | (2,798) |
| JPY | (9,000) | C 7270 JT 4227.3 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (422) | (890) | (468) |
| JPY | (8,000) | C 7270 JT 4277.5638 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (491) | (1,072) | (581) |
| JPY | (10,000) | C 7270 JT 4280.85 20/10/17 OTC | 2017年10月20日 | (622) | (1,520) | (898) |
| JPY | (10,000) | C 7270 JT 4318.44 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (580) | (725) | (145) |
| JPY | (8,000) | C 7270 JT 4404.24 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (606) | (601) | 5 |
| JPY | (6,000) | C 7751 JT 3907.0304 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (457) | (1,031) | (574) |
| JPY | (7,000) | C 7751 JT 3969 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (487) | (44) | 443 |
| JPY | (7,000) | C 7751 JT 3969.0564 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (510) | (179) | 331 |
| JPY | (20,000) | C 8001 JT 1809.6889 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (844) | (6,830) | (5,986) |
| JPY | (20,000) | C 8001 JT 1849.174 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (805) | (4,512) | (3,707) |
| JPY | (25,000) | C 8001 JT 1852.0736 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (896) | (4,565) | (3,669) |
| JPY | (24,000) | C 8001 JT 1852.5624 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (907) | (3,948) | (3,041) |
| JPY | (20,000) | C 8001 JT 1852.8536 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (583) | (3,431) | (2,848) |
| JPY | (18,000) | C 8001 JT 1900.5376 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (324) | (653) | (329) |
| JPY | (25,000) | C 8031 JT 1670.6324 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (974) | (2,401) | (1,427) |
| JPY | (27,000) | C 8031 JT 1707.6592 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (695) | (1,056) | (361) |
| JPY | (25,000) | C 8031 JT 1715.8024 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (717) | (1,007) | (290) |
| JPY | (20,000) | C 8031 JT 1716.9528 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (330) | (230) | 100 |
| JPY | (35,000) | C 8031 JT 1723.1968 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (896) | (949) | (53) |
| JPY | (20,000) | C 8031 JT 1746.7969 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (905) | (426) | 479 |
| JPY | (20,000) | C 8031 JT 1757.6 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (303) | (254) | 49 |
| JPY | (2,000) | C 8035 JT 17074.8 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (1,178) | (8,476) | (7,298) |
| JPY | (1,500) | C 8035 JT 18120.45 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (683) | (2,183) | (1,500) |
| JPY | (1,500) | C 8035 JT 18608.4 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (649) | (551) | 98 |
| JPY | (20,000) | C 8053 JT 1614.075 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (488) | (2,633) | (2,145) |
| JPY | (14,000) | C 8053 JT 1631.0565 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (491) | (1,021) | (530) |
| JPY | (15,000) | C 8053 JT 1724.32 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (401) | (286) | 115 |
| JPY | (15,000) | C 8058 JT 2647.9333 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (524) | (1,555) | (1,031) |
| JPY | (15,000) | C 8058 JT 2670.0752 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (986) | (2,154) | (1,168) |
| JPY | (16,000) | C 8058 JT 2707.1835 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (525) | (1,010) | (485) |
| JPY | (13,000) | C 8058 JT 2714.3896 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (456) | (615) | (159) |
| JPY | (15,000) | C 8058 JT 2717.925 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (984) | (1,244) | (260) |
| JPY | (50,000) | C 8306 JT 692.286 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (907) | (17,122) | (16,215) |
| JPY | (50,000) | C 8306 JT 694.088 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (633) | (16,299) | (15,666) |
| JPY | (55,000) | C 8306 JT 716.205 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (849) | (8,780) | (7,931) |

| 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 | (60,000) | C 8306 JT 743.06 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (943) | (3,508) | (2,565) |
| JPY | (55,000) | C 8306 JT 752.6 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (630) | (2,049) | (1,419) |
| JPY | (50,000) | C 8306 JT 764.26 20/10/17 OTC | 2017年10月20日 | (550) | (1,676) | (1,126) |
| JPY | (55,000) | C 8306 JT 765.0189 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (852) | (1,424) | (572) |
| JPY | (60,000) | C 8306 JT 765.32 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (1,079) | (1,402) | (323) |
| JPY | (50,000) | C 8306 JT 778.96 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (1,159) | (1,082) | 77 |
| JPY | (70,000) | C 8308 JT 583.9622 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (657) | (4,278) | (3,621) |
| JPY | (60,000) | C 8308 JT 595.5477 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (454) | (2,020) | (1,566) |
| JPY | (55,000) | C 8308 JT 598.0096 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (388) | (1,966) | (1,578) |
| JPY | (10,000) | C 8309 JT 4073.44 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (632) | (3,720) | (3,088) |
| JPY | (6,000) | C 8309 JT 4330.1952 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (298) | (659) | (361) |
| JPY | (9,000) | C 8316 JT 4176.484 02/10/17 OTC | 2017年10月2日 | (829) | (11,577) | (10,748) |
| JPY | (9,000) | C 8316 JT 4209.45 03/10/17 OTC | 2017年10月3日 | (697) | (9,238) | (8,541) |
| JPY | (10,000) | C 8316 JT 4338.88 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (567) | (2,996) | (2,429) |
| JPY | (10,000) | C 8316 JT 4462.5 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (762) | (1,322) | (560) |
| JPY | (8,000) | C 8316 JT 4514.3208 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (523) | (1,051) | (528) |
| JPY | (9,000) | C 8316 JT 4544.22 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (415) | (710) | (295) |
| JPY | (10,000) | C 8316 JT 4565.42 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (386) | (856) | (470) |
| JPY | (10,000) | C 8316 JT 4578.14 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (576) | (605) | (29) |
| JPY | (9,000) | C 8316 JT 4596.72 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (821) | (942) | (121) |
| JPY | (15,000) | C 8591 JT 1792.96 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (379) | (3,882) | (3,503) |
| JPY | (20,000) | C 8591 JT 1881.0064 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (746) | (622) | 124 |
| JPY | (15,000) | C 8591 JT 1926.0401 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (382) | (627) | (245) |
| JPY | (8,000) | C 8630 JT 4565.9671 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (1,404) | (369) | 1,035 |
| JPY | (8,000) | C 8630 JT 4736.26 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (1,366) | (994) | 372 |
| JPY | (7,000) | C 8630 JT 4823.9131 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (734) | (237) | 497 |
| JPY | (8,000) | C 8630 JT 4909.16 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (526) | (42) | 484 |
| JPY | (9,000) | C 8630 JT 4982.5692 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (1,491) | (48) | 1,443 |
| JPY | (8,000) | C 8766 JT 4625.25 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (638) | (178) | 460 |
| JPY | (8,000) | C 8766 JT 4689.3 20/10/17 OTC | 2017年10月20日 | (481) | (855) | (374) |
| JPY | (9,000) | C 8766 JT 4741.8 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (583) | (113) | 470 |
| JPY | (8,000) | C 8766 JT 4761.5 24/10/17 OTC | 2017年10月24日 | (850) | (665) | 185 |
| JPY | (8,000) | C 8766 JT 4769.1 16/10/17 OTC | 2017年10月16日 | (554) | (254) | 300 |
| JPY | (9,000) | C 8766 JT 4888.306 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (664) | (99) | 565 |
| HKD | (800,000) | C 883 HK 10.0244 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (7,120) | (23,234) | (16,114) |
| JPY | (4,000) | C 9021 JT 8158.592 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (502) | (589) | (87) |
| JPY | (4,000) | C 9021 JT 8390.55 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (501) | (24) | 477 |
| JPY | (9,000) | C 9142 JT 3486 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (487) | (724) | (237) |
| JPY | (11,000) | C 9142 JT 3550.6074 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (505) | (80) | 425 |
| JPY | (10,000) | C 9201 JT 3893.8407 04/10/17 OTC | 2017年10月4日 | (583) | (564) | 19 |
| JPY | (9,000) | C 9201 JT 3974.0036 11/10/17 OTC | 2017年10月11日 | (405) | (471) | (66) |

| 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 | (8,000) | C 9201 JT 3986.556 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (717) | (460) | 257 |
| HKD | (1,800,000) | C 939 HK 6.8476 09/11/17 OTC | 2017年11月9日 | (9,720) | (11,764) | (2,044) |
| HKD | (2,300,000) | C 939 HK 6.9218 27/10/17 OTC | 2017年10月27日 | (10,810) | (6,375) | 4,435 |
| HKD | (2,000,000) | C 939 HK 7.1295 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (13,600) | (210) | 13,390 |
| JPY | (7,000) | C 9432 JT 5324.9558 10/10/17 OTC | 2017年10月10日 | (789) | (369) | 420 |
| JPY | (6,000) | C 9432 JT 5336.24 18/10/17 OTC | 2017年10月18日 | (469) | (697) | (228) |
| JPY | (5,000) | C 9432 JT 5358.08 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (536) | (411) | 125 |
| JPY | (6,000) | C 9432 JT 5422.56 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (576) | (10) | 566 |
| JPY | (8,000) | C 9432 JT 5430.88 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (886) | (131) | 755 |
| JPY | (8,000) | C 9433 JT 3023.539 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (586) | (510) | 76 |
| JPY | (9,000) | C 9433 JT 3092.6639 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (318) | (265) | 53 |
| JPY | (13,000) | C 9437 JT 2589.7129 05/10/17 OTC | 2017年10月5日 | (451) | (947) | (496) |
| JPY | (18,000) | C 9437 JT 2603.6458 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (707) | (2,337) | (1,630) |
| JPY | (18,000) | C 9437 JT 2604.8082 12/10/17 OTC | 2017年10月12日 | (840) | (1,594) | (754) |
| JPY | (15,000) | C 9437 JT 2664.3594 20/10/17 OTC | 2017年10月20日 | (518) | (569) | (51) |
| JPY | (16,000) | C 9437 JT 2669.76 19/10/17 OTC | 2017年10月19日 | (372) | (474) | (102) |
| JPY | (13,000) | C 9437 JT 2687.5471 25/10/17 OTC | 2017年10月25日 | (383) | (480) | (97) |
| JPY | (15,000) | C 9503 JT 1637.8545 17/10/17 OTC | 2017年10月17日 | (832) | (16) | 816 |
| JPY | (3,000) | C 9735 JT 8357.6606 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (379) | (443) | (64) |
| JPY | (3,500) | C 9735 JT 8581.04 20/10/17 OTC | 2017年10月20日 | (518) | (453) | 65 |
| JPY | (50,000) | C 9831 JT 617.5527 06/10/17 OTC | 2017年10月6日 | (347) | (2,148) | (1,801) |
| JPY | (45,000) | C 9831 JT 625.2761 13/10/17 OTC | 2017年10月13日 | (384) | (1,728) | (1,344) |
| | | | | (9,170,326) | (13,365,328) | (4,195,002) |
| | | | | (9,170,326) | (13,365,328) | (4,195,002) |

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2017年8月21日）

作成対象期間（2016年8月20日～2017年8月21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 | | | |
| 11期(2013年8月19日) | 円 10,191 | | % 0.1 | % 80.9 | % — | 百万円 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 |
| 15期(2017年8月21日) | 10,208 | | △0.0 | 64.0 | — | 17,754 |

*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

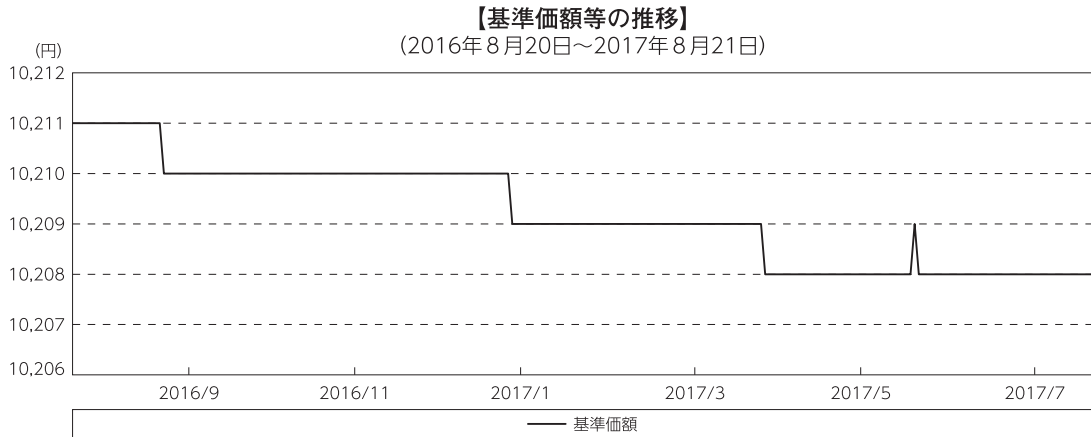
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期首) 2016年8月19日 | 円 10,211 | | % — | % 68.6 | % — |
| 8月末 | 10,211 | | 0.0 | 66.8 | — |
| 9月末 | 10,210 | | △0.0 | 55.4 | — |
| 10月末 | 10,210 | | △0.0 | 67.1 | — |
| 11月末 | 10,210 | | △0.0 | 81.1 | — |
| 12月末 | 10,210 | | △0.0 | 54.1 | — |
| 2017年1月末 | 10,209 | | △0.0 | 49.7 | — |
| 2月末 | 10,209 | | △0.0 | 48.6 | — |
| 3月末 | 10,209 | | △0.0 | 29.2 | — |
| 4月末 | 10,208 | | △0.0 | 75.0 | — |
| 5月末 | 10,208 | | △0.0 | 73.1 | — |
| 6月末 | 10,208 | | △0.0 | 65.4 | — |
| 7月末 | 10,208 | | △0.0 | 60.1 | — |
| (期末) 2017年8月21日 | 10,208 | | △0.0 | 64.0 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

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

○投資環境

国内経済は、高水準にある企業収益や雇用・所得環境の改善継続等を背景に、緩やかな回復基調が続きました。

このような中、日本銀行は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を継続し、2016年9月には、これらの政策枠組みを強化する意味合いから「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入しました。

・無担保コール翌日物金利の推移

マイナス金利政策のもと、-0.05%程度で推移しました。

・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勢を中心とした投資家需要が続く中、3月下旬までの間、利回りは-0.2%~-0.4%程度で推移しました。その後は、投資家の需要減退等を背景に利回りは上昇し、期末には-0.14%となりました。



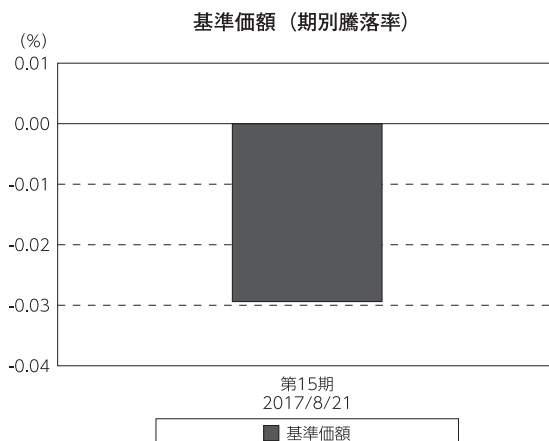
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2016年8月20日～2017年8月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年8月20日～2017年8月21日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|----------------|------------|-------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 26,957,668 | 26,957,639 |
| | 地方債証券 | 7,885,120 | — (6,738,010) |
| | 特殊債券 | 18,040,131 | — (23,825,000) |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 16,069,442 | — (13,490,000) |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分です。

*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 |
|----|-------------|-----------|------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | コマーシャル・ペーパー | 3,599,972 | — (3,900,000) |

*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

(2016年8月20日～2017年8月21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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|---------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | 百万円 | % | | 百万円 | 百万円 |
| 公社債 | 百万円 41,994 | 百万円 4,092 | % 9.7 | 百万円 — | 百万円 — | % — |

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

○組入資産の明細

(2017年8月21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 | 4,020,000 (4,020,000) | 4,031,567 (4,031,567) | 22.7 (22.7) | — (—) | — (—) | — (—) | 22.7 (22.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 1,205,000 (1,205,000) | 1,207,280 (1,207,280) | 6.8 (6.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 6.8 (6.8) |
| 金融債券 | 2,090,000 (2,090,000) | 2,090,748 (2,090,748) | 11.8 (11.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 11.8 (11.8) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 4,030,000 (4,030,000) | 4,034,993 (4,034,993) | 22.7 (22.7) | — (—) | — (—) | — (—) | 22.7 (22.7) |
| 合 計 | 11,345,000 (11,345,000) | 11,364,590 (11,364,590) | 64.0 (64.0) | — (—) | — (—) | — (—) | 64.0 (64.0) |

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 東京都 公募第651回 | 1.62 | 50,000 | 50,062 | 2017/9/20 |
| 神奈川県 公募(5年)第52回 | 0.26 | 360,000 | 360,089 | 2017/9/20 |
| 神奈川県 公募(5年)第53回 | 0.231 | 480,000 | 480,101 | 2017/9/20 |
| 大阪府 公募(5年)第86回 | 0.23 | 100,000 | 100,024 | 2017/9/27 |
| 大阪府 公募(5年)第89回 | 0.2 | 190,000 | 190,132 | 2017/12/27 |
| 京都府 公募平成24年度第9回 | 0.14 | 30,000 | 30,027 | 2018/3/22 |
| 静岡県 公募(5年)平成24年度第8回 | 0.236 | 170,000 | 170,059 | 2017/10/18 |
| 岐阜県 公募平成19年度第1回 | 1.87 | 150,000 | 150,496 | 2017/10/26 |
| 共同発行市場地方債 公募第54回 | 1.7 | 100,000 | 100,161 | 2017/9/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第57回 | 1.65 | 900,000 | 905,079 | 2017/12/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第58回 | 1.59 | 100,000 | 100,666 | 2018/1/25 |
| 大阪市 公募平成19年度第10回 | 1.74 | 800,000 | 804,416 | 2017/12/19 |
| 鹿児島県 公募(5年)平成24年度第1回 | 0.22 | 590,000 | 590,251 | 2017/10/31 |
| 小 計 | | 4,020,000 | 4,031,567 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | |
| 公営企業債券 政府保証第885回 | 1.7 | 33,000 | 33,414 | 2018/5/22 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第1回 | 0.4 | 70,000 | 70,033 | 2017/9/27 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第3回 | 0.4 | 20,000 | 20,034 | 2018/1/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第47回 | 1.5 | 4,000 | 4,020 | 2017/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第49回 | 1.5 | 42,000 | 42,274 | 2018/1/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第52回 | 1.6 | 44,000 | 44,360 | 2018/2/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第56回 | 1.4 | 25,000 | 25,228 | 2018/4/20 |
| 東日本高速道路債券 政府保証第10回 | 1.5 | 77,000 | 77,375 | 2017/12/21 |
| 新関西国際空港社債 財投機関債第10回 | 0.161 | 260,000 | 260,031 | 2017/9/20 |
| 首都高速道路 第11回 | 0.279 | 500,000 | 500,462 | 2017/12/20 |
| 東日本高速道路 第18回 | 0.387 | 130,000 | 130,045 | 2017/9/20 |
| 小 計 | | 1,205,000 | 1,207,280 | |
| 金融債券 | | | | |
| 商工債券 利付第748回い号 | 0.3 | 200,000 | 200,069 | 2017/9/27 |
| 商工債券 利付第751回い号 | 0.25 | 120,000 | 120,100 | 2017/12/27 |
| 農林債券 利付第747回い号 | 0.35 | 370,000 | 370,020 | 2017/8/25 |
| しんきん中金債券 利付第274回 | 0.3 | 1,000,000 | 1,000,317 | 2017/9/27 |
| 商工債券 利付(3年)第179回 | 0.14 | 400,000 | 400,240 | 2017/12/27 |
| 小 計 | | 2,090,000 | 2,090,748 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | |
| 関西電力 第400回 | 3.1 | 100,000 | 100,041 | 2017/8/25 |
| 関西電力 第458回 | 1.83 | 100,000 | 100,145 | 2017/9/20 |
| 北陸電力 第288回 | 1.89 | 240,000 | 240,754 | 2017/10/25 |
| 四国電力 第265回 | 1.79 | 300,000 | 300,065 | 2017/8/25 |
| 四国電力 第276回 | 0.592 | 200,000 | 200,111 | 2017/9/25 |
| 九州電力 第417回 | 0.641 | 340,000 | 340,036 | 2017/8/25 |
| 北海道電力 第293回 | 1.86 | 100,000 | 100,169 | 2017/9/25 |
| 北海道電力 第322回 | 0.3 | 350,000 | 350,348 | 2017/12/25 |
| トヨタ自動車 第12回社債間限定同等特約付 | 0.317 | 500,000 | 500,142 | 2017/9/20 |
| みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 300,000 | 300,177 | 2017/10/25 |
| 三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.442 | 300,000 | 301,250 | 2018/8/6 |

| 銘 | 柄 | 当 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 | |
| 住友不動産 第84回社債間限定同順位特約付 | | 0.388 | 100,000 | 100,196 | 2018/2/28 |
| 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 | 600,236 | 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 | 100,153 | 2017/9/20 |
| 東海旅客鉄道 第3回 | | 2.825 | 200,000 | 201,066 | 2017/10/30 |
| 電源開発 第34回社債間限定同順位特約付 | | 0.592 | 200,000 | 200,095 | 2017/9/20 |
| 小 計 | | | 4,030,000 | 4,034,993 | |
| 合 計 | | | 11,345,000 | 11,364,590 | |

* 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 899,993 | % 5.1 |

* 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

(2017年8月21日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 11,364,590 | % 63.6 |
| その他有価証券 | 899,993 | 5.0 |
| コール・ローン等、その他 | 5,590,335 | 31.4 |
| 投資信託財産総額 | 17,854,918 | 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 (2017年8月21日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 17,854,918,800 |
| コール・ローン等 | 5,549,998,539 |
| 公社債(評価額) | 11,364,590,303 |
| その他有価証券 | 899,993,268 |
| 未収利息 | 18,125,679 |
| 前払費用 | 22,211,011 |
| (B) 負債 | 100,793,362 |
| 未払金 | 100,679,000 |
| 未払解約金 | 106,947 |
| 未払利息 | 7,415 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 17,754,125,438 |
| 元本 | 17,392,173,897 |
| 次期繰越損益金 | 361,951,541 |
| (D) 受益権総口数 | 17,392,173,897口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,208円 |

(注) 期首元本額は19,315,765,955円、期中追加設定元本額は2,507,553,179円、期中一部解約元本額は4,431,145,237円、1口当たり純資産額は1.0208円です。

○損益の状況 (2016年8月20日～2017年8月21日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 95,706,562 |
| 受取利息 | 98,717,375 |
| 支払利息 | △ 3,010,813 |
| (B) 有価証券売買損益 | △100,546,660 |
| 売買損 | △100,546,660 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 4,840,098 |
| (D) 前期繰越損益金 | 406,859,951 |
| (E) 追加信託差損益金 | 52,555,651 |
| (F) 解約差損益金 | △ 92,623,963 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 361,951,541 |
| 次期繰越損益金(G) | 361,951,541 |

*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(E)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(F)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30 (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50 (適格機関投資家転売制限付) | 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) | 3,161,244,481 |
| 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(適格機関投資家転売制限付) | 969,401,962 |
| 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 | 436,168,504 |
| 野村世界高金利通貨投資 | 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 |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド) | 98,153,976 |
| バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09 | 98,039,216 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 85,180,134 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 49,417,625 |
| 野村高金利国際機関債投資(毎月分配型) | 49,354,623 |
| ネクストコア | 19,922,154 |
| 野村新中国株投資 マネーボール・ファンド | 14,424,815 |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド) | 10,258,341 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 7,492,405 |
| 野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド | 6,983,416 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 6,929,426 |
| 野村新興国消費関連株投資 マネーボール・ファンド | 5,350,038 |
| 野村グローバルCB投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 3,826,372 |
| 野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド | 3,459,024 |
| 野村新エマージング債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 3,279,122 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---------------------------------------|------------|
| | 円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 3,123,334 |
| 米国変動好金利ファンド Aコース | 2,952,997 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型 | 1,937,870 |
| 野村・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド | 1,020,305 |
| 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投資(円コース)毎月分配型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,543 |
| 野村グローバルCB投資(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資(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資(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資(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資(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資(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資(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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--------------------------------------|--------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(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 |
| 野村ドイチュ・高配当インフラ関連株投資(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・イールド債券投資(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 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型 | 98,260 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(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資 Bコース | 98,260 |
| 野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)年2回決算型 | 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資(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資(インドネシアルピアコース)年2回決算型 | 82,780 |
| 野村通貨選択日本株投資(インドネシアルピアコース)毎月分配型 | 80,956 |
| 野村通貨選択日本株投資(中国元コース)毎月分配型 | 58,906 |
| 野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース)年2回決算型 | 52,622 |
| 野村通貨選択日本株投資(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資(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・イールド債券投資(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資(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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|-------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 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・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型 | 9,808 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型 | 9,808 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)毎月分配型 | 9,808 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投資(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資(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資(米ドルコース)年2回決算型 | 9,807 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型 | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)毎月分配型 | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型 | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投資(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 ブラジルリアル毎月分配型 | 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PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型 | 9,797 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型 | 9,797 |
| 野村ファンドラップ債券プレミア | 9,795 |
| 野村ファンドラップオルタナティブプレミア | 9,795 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村通貨選択日本株投資(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資(年2回決算型) | 1,967 |
| 野村通貨選択日本株投資(ユーロコース)毎月分配型 | 1,963 |

〇お知らせ

スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

<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。

(2018年5月17日現在)

| 年 月 | 日 |
|---------|---------|
| 2018年5月 | 21、28 |
| 6月 | 11 |
| 7月 | 4 |
| 8月 | 6、15、27 |
| 9月 | 3 |
| 10月 | 1 |
| 11月 | 1、12、22 |
| 12月 | 25、26 |

※2018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。