

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90期(決算日2019年6月17日) 第91期(決算日2019年7月17日) 第92期(決算日2019年8月19日)
第93期(決算日2019年9月17日) 第94期(決算日2019年10月17日) 第95期(決算日2019年11月18日)

作成対象期間(2019年5月18日～2019年11月18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。
なお、当ファンドは、2019年8月9日に信託期間を延長する約款変更を行い、信託期間終了日は2026年11月17日となりましたので、ご留意下さい。
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	追加型投信ノ内外ノ株式	
信託期間	2011年11月18日から2026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	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。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	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	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	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。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として、配当等収益等を中心に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 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 込 配	み 金 騰 落	中 率				
	円		円	%	%	%	%	百万円
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
78期(2018年6月18日)	6,424		50	△ 4.8	0.0	—	99.2	104,909
79期(2018年7月17日)	6,641		50	4.2	0.0	—	99.3	103,989
80期(2018年8月17日)	6,067		50	△ 7.9	0.0	—	99.3	90,857
81期(2018年9月18日)	6,013		50	△ 0.1	0.0	—	99.1	86,494
82期(2018年10月17日)	5,934		50	△ 0.5	0.0	—	99.1	82,198
83期(2018年11月19日)	5,873		50	△ 0.2	0.0	—	99.0	79,050
84期(2018年12月17日)	5,654		50	△ 2.9	0.0	—	98.9	73,649
85期(2019年1月17日)	5,662		50	1.0	0.0	—	98.9	72,779
86期(2019年2月18日)	5,840		50	4.0	0.0	—	98.9	73,504
87期(2019年3月18日)	5,890		50	1.7	0.0	—	99.2	72,371
88期(2019年4月17日)	6,065		50	3.8	0.0	—	99.1	72,725
89期(2019年5月17日)	5,683		50	△ 5.5	0.0	—	99.2	66,832
90期(2019年6月17日)	5,580		50	△ 0.9	0.0	—	99.3	64,321
91期(2019年7月17日)	5,876		50	6.2	0.0	—	99.0	65,944
92期(2019年8月19日)	5,140		50	△ 11.7	0.0	—	98.9	56,522
93期(2019年9月17日)	5,596		50	9.8	0.0	—	99.1	60,262
94期(2019年10月17日)	5,493		50	△ 0.9	0.0	—	99.2	57,802
95期(2019年11月18日)	5,622		50	3.3	0.0	—	99.0	57,432

*基準価額の騰落率は分配金込み。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	信 託 券 率
		円	騰 落 率				
第90期	(期 首) 2019年 5月17日	5,683	—	0.0	—	—	99.2
	5月末	5,496	△ 3.3	0.0	—	—	99.0
	(期 末) 2019年 6月17日	5,630	△ 0.9	0.0	—	—	99.3
第91期	(期 首) 2019年 6月17日	5,580	—	0.0	—	—	99.3
	6月末	5,748	3.0	0.0	—	—	99.2
	(期 末) 2019年 7月17日	5,926	6.2	0.0	—	—	99.0
第92期	(期 首) 2019年 7月17日	5,876	—	0.0	—	—	99.0
	7月末	5,852	△ 0.4	0.0	—	—	99.0
	(期 末) 2019年 8月19日	5,190	△11.7	0.0	—	—	98.9
第93期	(期 首) 2019年 8月19日	5,140	—	0.0	—	—	98.9
	8月末	5,121	△ 0.4	0.0	—	—	98.7
	(期 末) 2019年 9月17日	5,646	9.8	0.0	—	—	99.1
第94期	(期 首) 2019年 9月17日	5,596	—	0.0	—	—	99.1
	9月末	5,451	△ 2.6	0.0	—	—	99.0
	(期 末) 2019年10月17日	5,543	△ 0.9	0.0	—	—	99.2
第95期	(期 首) 2019年10月17日	5,493	—	0.0	—	—	99.2
	10月末	5,695	3.7	0.0	—	—	98.9
	(期 末) 2019年11月18日	5,672	3.3	0.0	—	—	99.0

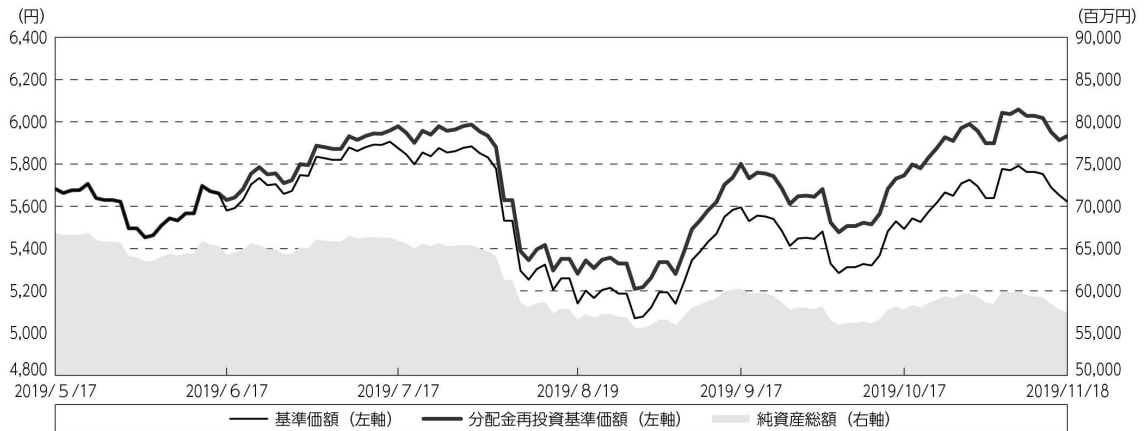
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第90期首：5,683円

第95期末：5,622円（既払分配金（税込み）：300円）

騰落率：4.4%（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（2019年5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5,683円から当作成期末には5,622円となりました。

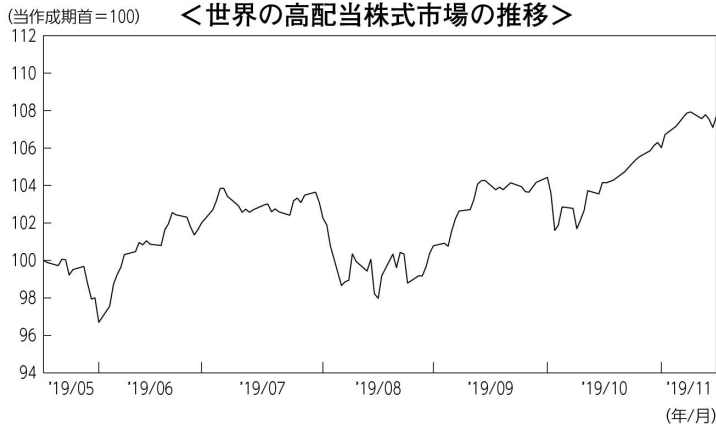
- ・実質的に投資している世界の高配当利回り株式（以下、「高配当株」といいます。）からのインカムゲイン（配当等収益）
- ・実質的に投資している世界の高配当株からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・実質的に保有する高配当株式の銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す『株式プレミアム戦略』による、オプションのプレミアム収入（またはオプションにおける支払い）
- ・円／選定通貨※の為替変動

※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、米中通商協議の先行き不透明感が高まったことなどから下落する場面がありましたが、FRB（米連邦準備制度理事会）が3回連続して政策金利を引き下げたことや、好調な米企業決算が発表されたことなどから堅調に推移し、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。

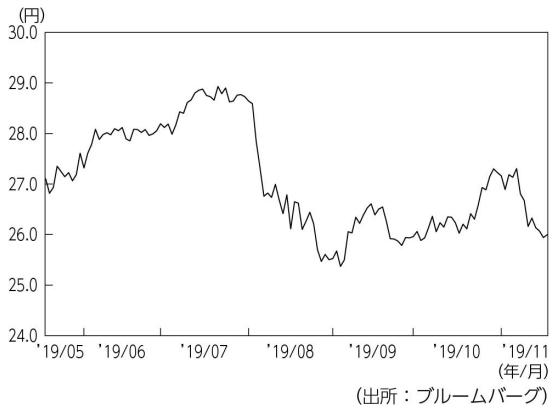
＜為替レート＞

ブラジルでは、年金改革を巡る議会の動きが通貨に影響を与えました。財政健全化が急務となっている中で、年金改革法案が法案内容の過度な希薄化なしに議会で可決されたことを市場は好感しましたが、米中の貿易摩擦問題に端を発する世界的な成長減速懸念の高まりから、通貨は対円で軟調に推移しました。

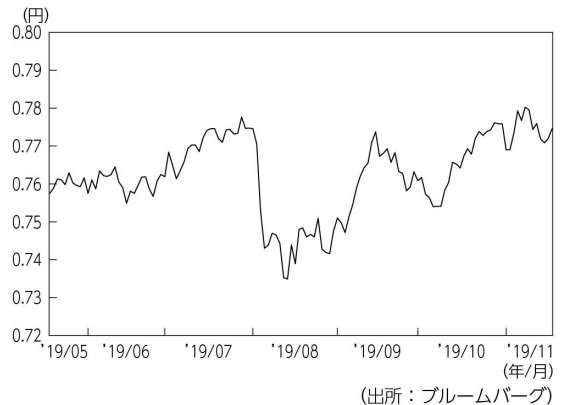
南アフリカでは、財政計画や大手格付会社による格付け見直しの動向が市場の注目を集めました。10月に発表された中期財政計画において、税収の低迷や国営電力会社エスコムへの支援などにより今後財政赤字が拡大する見通しが示されました。大手格付会社による格付けの引き下げを懸念する見方が強まり、通貨は対円で軟調に推移しました。

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

＜円/ブラジルレアル レートの推移＞

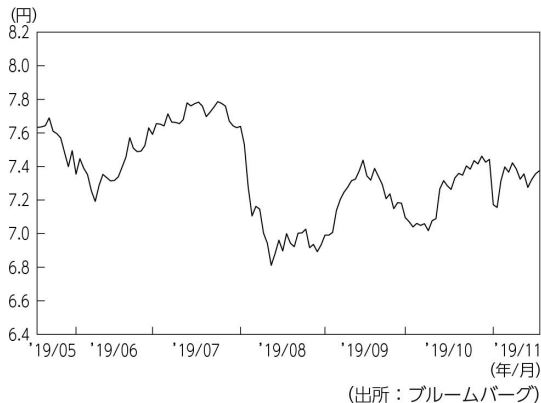


＜円/インドネシアルピア レートの推移＞

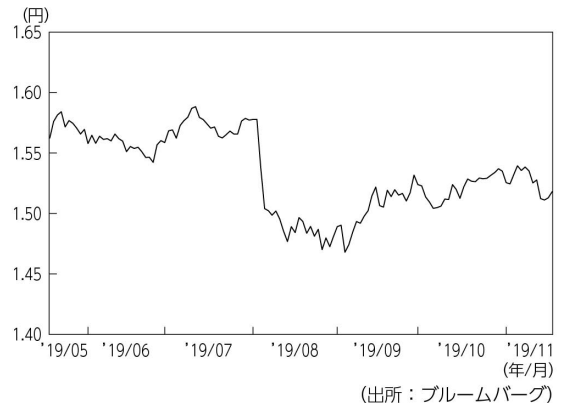


※インドネシアルピアは100ルピアあたりの円価格を表示しています。

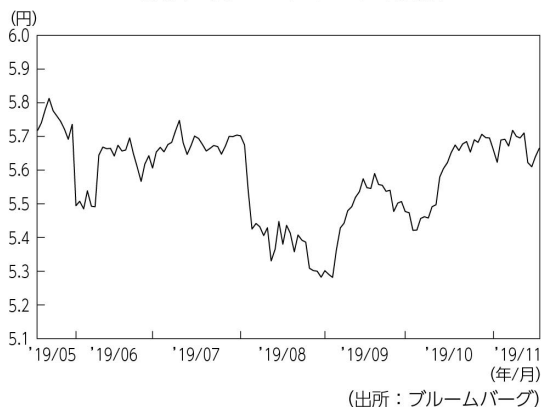
＜円/南アフリカランド レートの推移＞



＜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	93.0%
カバー率	41.0%
平均行使価格	104.4%
平均行使期間	31.2日
配当利回り(年率、米ドル為替取引後ベース)※	4.3%
プレミアム(年率)	3.5%

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

主要投資対象である〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム〕のポートフォリオにおける地域別比率は、当作成期末現在で、米州27.6%、欧州34.2%、アジア・太平洋31.2%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26.2%、生活必需品17.2%、通信11.1%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リアル、インドネシアルピア、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。

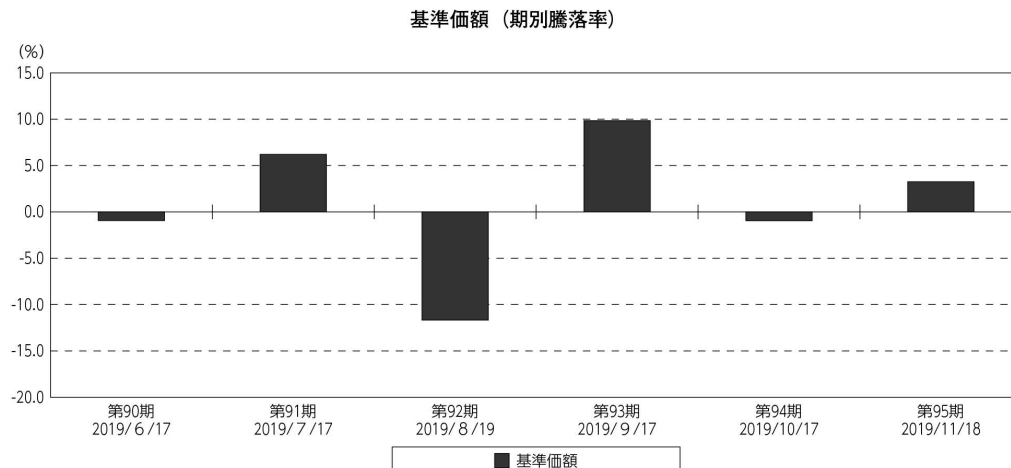
【野村マネー マザーファンド】

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90期	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期
	2019年5月18日～ 2019年6月17日	2019年6月18日～ 2019年7月17日	2019年7月18日～ 2019年8月19日	2019年8月20日～ 2019年9月17日	2019年9月18日～ 2019年10月17日	2019年10月18日～ 2019年11月18日
当期分配金 (対基準価額比率)	50 0.888%	50 0.844%	50 0.963%	50 0.886%	50 0.902%	50 0.882%
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	8,769	8,801	8,830	8,863	8,893	8,926

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

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

◎今後の運用方針

【野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型】

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

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

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

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

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

【野村マネー マザーファンド】

残存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、よろしくお願いいたします。

※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

(2019年5月18日～2019年11月18日)

項 目	第90期～第95期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 27	% 0.489	(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 ）	(11)	(0.195)	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 ）	(15)	(0.278)	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)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	27	0.491	
作成期間の平均基準価額は、5,560円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

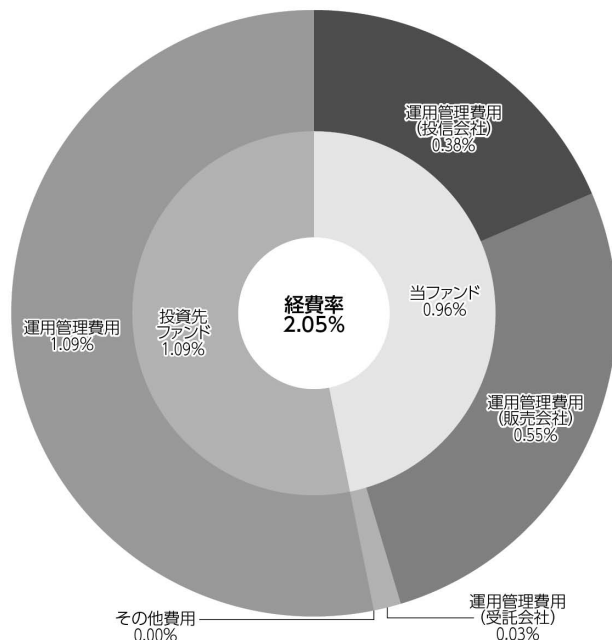
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は2.05%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	2.05
①当ファンドの費用の比率	0.96
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.09

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

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

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

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年5月18日～2019年11月18日)

投資信託証券

銘柄		第90期～第95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Ⅳ- 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 77,005	千円 251,455	口 2,114,406	千円 6,977,371

*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

(2019年5月18日～2019年11月18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90期～第95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 11,329	百万円 100	% 0.9	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証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2019年11月18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89期末	第95期末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 通貨セレクトクラス	19,392,660	17,355,259	56,838,473	99.0
	合計	19,392,660	17,355,259	56,838,473	99.0

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘	柄	第89期末	第95期末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
	野村マネー マザーファンド	983	983	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

(2019年11月18日現在)

項 目	第95期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	56,838,473	97.0
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	1,769,819	3.0
投資信託財産総額	58,609,295	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90期末	第91期末	第92期末	第93期末	第94期末	第95期末
	2019年6月17日現在	2019年7月17日現在	2019年8月19日現在	2019年9月17日現在	2019年10月17日現在	2019年11月18日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	65,176,952,586	66,891,222,050	57,276,431,474	61,153,930,190	58,656,916,189	58,609,295,950
コール・ローン等	1,323,432,542	1,348,081,412	1,144,218,780	1,220,299,026	1,338,695,155	1,280,557,901
投資信託受益証券(評価額)	63,852,516,800	65,261,244,744	55,928,666,664	59,708,246,336	57,317,217,888	56,838,473,225
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,244	1,003,244	1,003,244	1,003,244	1,003,146	1,003,146
未収入金	-	280,892,650	202,542,786	224,381,584	-	489,261,678
(B) 負債	855,860,884	946,780,294	753,850,595	891,121,260	854,598,380	1,176,998,956
未払収益分配金	576,312,325	561,168,421	549,864,730	538,430,610	526,165,466	510,820,594
未払解約金	226,695,955	334,222,537	150,211,661	309,066,490	282,656,896	616,036,932
未払信託報酬	52,670,729	51,212,207	53,589,760	43,473,904	45,618,773	49,969,237
未払利息	2,329	2,548	1,762	2,059	1,738	1,853
その他未払費用	179,546	174,581	182,682	148,197	155,507	170,340
(C) 純資産総額(A-B)	64,321,091,702	65,944,441,756	56,522,580,879	60,262,808,930	57,802,317,809	57,432,296,994
元本	115,262,465,186	112,233,684,333	109,972,946,130	107,686,122,006	105,233,093,236	102,164,118,942
次期繰越損益金	△ 50,941,373,484	△ 46,289,242,577	△ 53,450,365,251	△ 47,423,313,076	△ 47,430,775,427	△ 44,731,821,948
(D) 受益権総口数	115,262,465,186口	112,233,684,333口	109,972,946,130口	107,686,122,006口	105,233,093,236口	102,164,118,942口
1万円当たり基準価額(C/D)	5,580円	5,876円	5,140円	5,596円	5,493円	5,622円

(注) 第90期首元本額は117,602,068,782円、第90～95期中追加設定元本額は2,788,832,949円、第90～95期中一部解約元本額は18,226,782,789円、1口当たり純資産額は、第90期0.5580円、第91期0.5876円、第92期0.5140円、第93期0.5596円、第94期0.5493円、第95期0.5622円です。

○損益の状況

項 目	第90期	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期
	2019年5月18日～ 2019年6月17日	2019年6月18日～ 2019年7月17日	2019年7月18日～ 2019年8月19日	2019年8月20日～ 2019年9月17日	2019年9月18日～ 2019年10月17日	2019年10月18日～ 2019年11月18日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	948,396,105	930,233,834	916,483,029	901,799,409	883,863,899	861,587,809
受取配当金	948,440,091	930,287,029	916,524,932	901,832,526	883,888,392	861,623,607
支払利息	△ 43,986	△ 53,195	△ 41,903	△ 33,117	△ 24,493	△ 35,798
(B) 有価証券売買損益	△ 1,504,421,023	2,986,516,078	△ 8,407,915,344	4,591,295,302	△ 1,396,960,641	997,778,865
売買益	24,979,763	3,036,946,670	61,505,070	4,622,528,025	51,151,560	1,056,940,855
売買損	△ 1,529,400,786	△ 50,430,592	△ 8,469,420,414	△ 31,232,723	△ 1,448,112,201	△ 59,161,990
(C) 信託報酬等	△ 52,850,275	△ 51,386,788	△ 53,772,442	△ 43,622,101	△ 45,774,280	△ 50,139,577
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 608,875,193	3,865,363,124	△ 7,545,204,757	5,449,472,610	△ 558,871,022	1,809,227,097
(E) 前期繰越損益金	△57,010,363,932	△56,446,433,304	△51,934,756,026	△58,643,341,519	△52,210,132,819	△51,257,558,937
(F) 追加信託差損益金	7,254,177,966	6,852,996,024	6,579,460,262	6,308,986,443	5,864,393,880	5,227,330,486
(配当等相当額)	(77,596,751,606)	(75,644,589,256)	(74,179,067,774)	(72,688,106,181)	(71,159,449,997)	(69,287,354,166)
(売買損益相当額)	(△70,342,573,640)	(△68,791,593,232)	(△67,599,607,512)	(△66,379,119,738)	(△65,295,056,117)	(△64,060,023,680)
(G) 計(D+E+F)	△50,365,061,159	△45,728,074,156	△52,900,500,521	△46,884,882,466	△46,904,609,961	△44,221,001,354
(H) 収益分配金	△ 576,312,325	△ 561,168,421	△ 549,864,730	△ 538,430,610	△ 526,165,466	△ 510,820,594
(I) 次期繰越損益金(G+H)	△50,941,373,484	△46,289,242,577	△53,450,365,251	△47,423,313,076	△47,430,775,427	△44,731,821,948
追加信託差損益金	7,254,177,966	6,852,996,024	6,579,460,262	6,308,986,443	5,864,393,880	5,227,330,486
(配当等相当額)	(77,596,751,606)	(75,644,589,256)	(74,179,067,776)	(72,688,106,182)	(71,159,449,998)	(69,287,354,170)
(売買損益相当額)	(△70,342,573,640)	(△68,791,593,232)	(△67,599,607,514)	(△66,379,119,739)	(△65,295,056,118)	(△64,060,023,684)
分配準備積立金	23,477,737,678	23,136,415,139	22,929,401,911	22,761,049,669	22,434,846,392	21,913,227,214
繰越損益金	△81,673,289,128	△76,278,653,740	△82,959,227,424	△76,493,349,188	△75,730,015,699	△71,872,379,648

* 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(2019年5月18日～2019年11月18日)は以下の通りです。

項 目	第90期	第91期	第92期	第93期	第94期	第95期
	2019年5月18日～ 2019年6月17日	2019年6月18日～ 2019年7月17日	2019年7月18日～ 2019年8月19日	2019年8月20日～ 2019年9月17日	2019年9月18日～ 2019年10月17日	2019年10月18日～ 2019年11月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	895,546,172円	918,029,843円	862,711,194円	894,637,190円	838,090,160円	838,353,579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	77,596,751,606円	75,644,589,256円	74,179,067,776円	72,688,106,182円	71,159,449,998円	69,287,354,170円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	23,158,503,831円	22,779,553,717円	22,616,555,447円	22,404,843,089円	22,122,921,698円	21,585,694,229円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	101,650,801,609円	99,342,172,816円	97,658,334,417円	95,987,586,461円	94,120,461,856円	91,711,401,978円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	8,819円	8,851円	8,880円	8,913円	8,943円	8,976円
g. 分配金	576,312,325円	561,168,421円	549,864,730円	538,430,610円	526,165,466円	510,820,594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90期	第91期	第92期	第93期	第94期	第95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

信託期間を5年更新し、信託期間終了日を2026年11月17日とする所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2019年8月9日>

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2019年11月18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（7,851,790千口）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95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	1,060,000 (1,060,000)	1,060,852 (1,060,852)	13.2 (13.2)	— (—)	— (—)	— (—)	13.2 (13.2)
特殊債券 (除く金融債)	2,289,400 (2,289,400)	2,290,369 (2,290,369)	28.6 (28.6)	— (—)	— (—)	— (—)	28.6 (28.6)
金融債券	600,000 (600,000)	600,263 (600,263)	7.5 (7.5)	— (—)	— (—)	— (—)	7.5 (7.5)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,100,000 (1,100,000)	1,100,616 (1,100,616)	13.7 (13.7)	— (—)	— (—)	— (—)	13.7 (13.7)
合 計	5,049,400 (5,049,400)	5,052,102 (5,052,102)	63.1 (63.1)	— (—)	— (—)	— (—)	63.1 (63.1)

* ()内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	第95期末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
神奈川県 公募第169回	1.43	90,000	90,115	2019/12/20
愛知県 公募平成21年度第12回	1.32	50,000	50,063	2019/12/25
共同発行市場地方債 公募第80回	1.54	200,000	200,054	2019/11/25
横浜市 公募平成21年度第6回	1.36	250,000	250,284	2019/12/20
横浜市 公募（5年）第41回	0.101	270,000	270,060	2020/1/24
さいたま市 公募第7回	1.34	200,000	200,273	2019/12/25
小 計		1,060,000	1,060,852	
特殊債券(除く金融債)				
政保 地方公共団体金融機構債券 第8回	1.3	144,000	144,317	2020/1/20
日本政策金融公庫債券 政府保証第32回	0.16	120,000	120,200	2020/9/16
日本政策投資銀行社債 財投機関債第49回	0.204	100,000	100,020	2019/12/20
地方公共団体金融機構債券 第6回	1.518	460,000	460,221	2019/11/28
首都高速道路 第14回	0.273	420,000	420,104	2019/12/20
阪神高速道路 第15回	0.01	460,000	460,025	2019/12/20
福祉医療機構債券 第47回財投機関債	0.001	200,000	200,004	2019/12/20
国際協力機構債券 第28回財投機関債	0.15	105,400	105,415	2019/12/20
東日本高速道路 第28回	0.248	50,000	50,012	2019/12/20
中日本高速道路社債 第58回	0.182	230,000	230,049	2019/12/20
小 計		2,289,400	2,290,369	
金融債券				
農林債券 利付第775回い号	0.23	200,000	200,053	2019/12/27
しんきん中金債券 利付第301回	0.225	100,000	100,027	2019/12/27
しんきん中金債券 利付第302回	0.2	100,000	100,041	2020/1/27
しんきん中金債券 利付第303回	0.25	200,000	200,140	2020/2/27
小 計		600,000	600,263	
普通社債券(含む投資法人債券)				
関西電力 第477回	1.405	200,000	200,245	2019/12/20
東北電力 第452回	1.405	100,000	100,147	2019/12/25
四国電力 第290回	0.14	100,000	100,019	2019/12/25
ホンダファイナンス 第35回社債間限定同順位特約付	0.001	300,000	300,001	2019/12/20
日立キャピタル 第45回社債間限定同順位特約付	0.666	100,000	100,054	2019/12/20
三菱UFJリース 第26回社債間限定同順位特約付	0.441	200,000	200,020	2019/11/21
三井不動産 第37回社債間限定同順位特約付	1.493	100,000	100,128	2019/12/20
小 計		1,100,000	1,100,616	
合 計		5,049,400	5,052,102	

* 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95期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 499,996	% 6.2

* 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・ディビデンド・エクイティ・プレミアム

2018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"> <thead> <tr> <th>地域名</th> <th>米州</th> <th>欧州</th> <th>アジア・太平洋</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>投資比率</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> </tr> </tbody> </table> <p>※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●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。 	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋	投資比率	25～50%	25～50%	25～50%
	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋					
投資比率	25～50%	25～50%	25～50%						
受託会社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー								
投資顧問会社	野村アセットマネジメント株式会社								
通貨運用会社	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド								
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・ディビデンド・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
2018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		904,721,578
(取得原価: 824,176,827米ドル)		
現金預金等		100,063,184
ブローカーからの未収金		86,583
未収収益		1,843,591
現金および現金等価物に係る利息		4,081
		1,006,719,017
資産合計		1,006,719,017
負債		
投資オプション契約時価(売り)		7,042,415
(取得原価: 5,798,208米ドル)		
銀行借越金		1,114,107
外国為替先渡し契約に係る評価差損		6,526,122
受益証券買戻支払金		3,112,972
ブローカーへの未払金		518,266
未払費用		3,078,308
		21,392,190
負債合計		21,392,190
純資産総額		985,326,827

受益証券一口当たり情報:

	期末1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス(円)	9,992	390,075	3,897,801,215
通貨セレクトクラス(円)	3,915	23,904,528	93,578,949,254

運用計算書
2018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	2,005,454
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	36,188,820
雑収益	9
	9
収益合計	38,194,283
費用	
投資顧問報酬	12,491,803
事務管理代行報酬	1,380,824
保管費用	414,686
当座借越利息	291,538
取引銀行報酬	313,655
銀行手数料	131,328
受託報酬	276,445
法務報酬	9,636
立替費用	276,108
専門家報酬	56,664
譲渡益税	283,381
雑費用	365,886
	365,886
費用合計	16,291,954
純投資損益	21,902,329
投資有価証券売買に係る損益	123,926,911
先物契約に係る損益	694,855
オプション契約に係る損益	(22,862,875)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	(130,374,954)
	(130,374,954)
当期実現純損益	(28,616,063)
投資有価証券評価損益の増減	(46,427,450)
先物契約に係る評価損益の増減	(389,025)
オプション契約に係る評価損益の増減	2,950,795
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	19,848,590
	19,848,590
当期評価差損益	(24,017,090)
運用の結果による純資産の増減額	(30,730,824)

純資産変動計算書
2018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	1,777,281,949
純投資損益	21,902,329
当期実現純損益	(28,616,063)
当期評価差損益	(24,017,090)
運用の結果による純資産の増減額	(30,730,824)
受益証券の発行手取金	13,704,197
受益証券の買戻支払金	(607,605,689)
	(593,901,492)
受益者への支払分配金	(167,322,806)
期末純資産総額	985,326,827

発行済受益証券数の変動表
2018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	510,042
発行受益証券数	52,591
買戻受益証券数	(172,558)
期末発行済受益証券数	390,075

通貨セレクトクラス

期首受益証券数	37,294,220
発行受益証券数	93,291
買戻受益証券数	(13,482,983)
期末発行済受益証券数	23,904,528

統計情報
2018年9月30日現在
(未監査)

	2018	2017	2016
期末純資産総額(米ドル)	985,326,827	1,777,281,949	2,468,069,953
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	3,897,801,215	5,166,277,871	6,374,743,758
期末1口当たり純資産価格	9,992	10,129	9,775
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	93,578,949,254	176,198,062,233	220,175,129,656
期末1口当たり純資産価格	3,915	4,725	3,978

組入資産明細
2018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				
4,701,814	SOUTH32 LTD	10,217,682	13,166,390	1.34
449,063	BHP BILLITON (AUD) *	9,975,120	11,224,737	1.14
195,322	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA *	11,841,607	10,067,615	1.02
69,119	CSL LTD	8,566,744	10,033,386	1.02
419,511	WESTPAC BANKING CORP	10,091,266	8,457,280	0.86
261,797	ARISTOCRAT LEISURE LTD	3,325,973	5,374,161	0.55
263,519	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING *	5,856,363	5,360,056	0.54
54,987	MACQUARIE GROUP LTD	4,375,210	5,002,474	0.51
83,278	RIO TINTO LTD	4,646,969	4,734,263	0.48
228,313	WOOLWORTHS GROUP	4,613,741	4,627,476	0.47
335,620	SUNCORP GROUP LT	3,588,941	3,502,939	0.36
55,096	REA GROUP LTD	3,305,508	3,417,286	0.35
367,292	TRANSURBAN GROUP	3,127,473	2,974,546	0.30
232,456	BLUESCOPE STEEL LTD	2,633,153	2,849,016	0.29
118,525	NTL AUSTRALIA BANK LTD *	2,618,998	2,379,180	0.24
488,045	QANTAS AIRWAYS LTD	2,296,074	2,078,396	0.21
73,839	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	1,946,672	2,056,196	0.21
139,956	COMPUTERSHARE LIMITED	1,910,538	2,015,352	0.20
329,802	NORTHERN STAR RE	1,598,918	1,975,822	0.20
340,132	ATLAS ARTERIA	1,693,279	1,713,639	0.17
432,654	THE STAR ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,624,004	1,620,782	0.16
861,398	MIRVAC GROUP	1,484,078	1,498,433	0.15
102,011	NEWCREST MINING LTD	1,644,822	1,429,187	0.15
227,951	TPG TELECOM LTD	1,416,086	1,405,128	0.14
252,376	DULUX GROUP LTD	1,465,511	1,397,204	0.14
384,368	TABCORP HLDGS	1,358,745	1,351,116	0.14
31,493	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	1,176,623	1,209,322	0.12
702,086	CLEANAWAY WASTE	944,506	952,718	0.10
167,170	DOWNER EDI LIMITED	842,204	952,032	0.10
119,909	OZ MINERALS LTD	751,398	807,514	0.08
76,985	GOODMAN GROUP STAPLED	513,624	575,682	0.06
59,998	LINK ADMINISTRAT	397,247	336,925	0.03
		111,849,077	116,546,253	11.83
	合計：オーストラリア	111,849,077	116,546,253	11.83

	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	213,333	AGEAS NV	7,492,911	11,533,470	1.17
			7,492,911	11,533,470	1.17
		合計：ベルギー	7,492,911	11,533,470	1.17
		バミューダ諸島			
普通株式	230,000	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	2,042,632	1,822,806	0.18
	17,806	ASSURED GUARANTY LTD	643,903	749,633	0.08
	170,000	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG LTD	583,356	472,638	0.05
	100,000	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE	67,463	79,380	0.01
			3,337,354	3,124,457	0.32
		合計：バミューダ諸島	3,337,354	3,124,457	0.32
		ブラジル			
普通株式	350,157	ITAU UNIBANCO HOLDING SA SP ADR	2,974,972	3,865,733	0.38
	99,888	PETROLEO BRASILEIRO S.A ADR	865,848	1,236,114	0.13
	143,733	BANCO BRADESCO SPONSORED ADR	799,533	1,041,346	0.11
			4,640,353	6,143,193	0.62
		合計：ブラジル	4,640,353	6,143,193	0.62
		カナダ			
普通株式	62,919	SUNCOR ENERGY INC	2,064,825	2,462,650	0.25
			2,064,825	2,462,650	0.25
		合計：カナダ	2,064,825	2,462,650	0.25
		ケイマン諸島			
普通株式	252,000	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,062,510	2,905,547	0.30
	310,000	SANDS CHINA LTD	1,520,097	1,404,749	0.14
	550,000	SHIMAO PROPERTY HOLDING LTD	1,194,859	1,372,345	0.14
	900,000	LEE & MAN MANUFACT LTD (HKD)	701,489	835,218	0.08
	600,000	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	334,836	484,718	0.05
	520,000	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS LTD	683,789	443,353	0.04
	2,100,000	CHINA DONGXIANG GROUP CO	436,834	351,651	0.04
			7,934,414	7,797,581	0.79
		合計：ケイマン諸島	7,934,414	7,797,581	0.79

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		中国			
普通株式	7,300,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	5,669,701	6,382,631	0.66
	4,700,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	3,068,329	3,436,487	0.35
	5,400,000	BANK OF CHINA LTD H	2,506,092	2,402,115	0.24
	3,100,000	AGRICULTURAL BANK OF CHINA H	1,419,862	1,521,646	0.15
	1,100,000	CHINA PETROL & CHEM CORP SINOPEC H	797,919	1,102,375	0.11
	306,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	340,323	392,714	0.04
			<u>13,802,226</u>	<u>15,237,968</u>	<u>1.55</u>
		合計：中国	<u>13,802,226</u>	<u>15,237,968</u>	<u>1.55</u>
		チェコ			
普通株式	7,310	PHILIP MORRIS CR AS	3,608,461	4,927,342	0.50
			<u>3,608,461</u>	<u>4,927,342</u>	<u>0.50</u>
		合計：チェコ	<u>3,608,461</u>	<u>4,927,342</u>	<u>0.50</u>
		デンマーク			
普通株式	203,026	D/S NORDEN AS	4,445,865	3,090,608	0.31
			<u>4,445,865</u>	<u>3,090,608</u>	<u>0.31</u>
		合計：デンマーク	<u>4,445,865</u>	<u>3,090,608</u>	<u>0.31</u>
		フィンランド			
普通株式	30,086	FORTUM OYJ	468,546	757,866	0.08
			<u>468,546</u>	<u>757,866</u>	<u>0.08</u>
		合計：フィンランド	<u>468,546</u>	<u>757,866</u>	<u>0.08</u>
		フランス			
普通株式	198,720	SANOFI	16,808,500	17,741,805	1.80
	152,936	BNP PARIBAS	8,784,898	9,275,752	0.94
	172,908	ALSTOM	5,435,844	7,750,794	0.79
	708,182	COFACE SA	6,004,959	6,500,412	0.66
			<u>37,034,201</u>	<u>41,268,763</u>	<u>4.19</u>
		合計：フランス	<u>37,034,201</u>	<u>41,268,763</u>	<u>4.19</u>
		ドイツ			
普通株式	87,219	BILFINGER BERGER AG	4,330,592	4,359,638	0.44
			<u>4,330,592</u>	<u>4,359,638</u>	<u>0.44</u>
		合計：ドイツ	<u>4,330,592</u>	<u>4,359,638</u>	<u>0.44</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		香港			
普通株式					
	260,000	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	3,615,810	3,788,777	0.39
	800,000	CHINA OVERSEAS LAND&INVEST LTD	2,525,860	2,505,399	0.25
	480,000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,570,545	2,282,469	0.23
	760,000	CNOOC LTD	863,652	1,505,796	0.15
	120,000	AIA GROUP LTD	677,027	1,072,208	0.11
	380,000	GUANGDONG INVESTMENT LTD	565,580	675,179	0.07
	60,000	LINK REAL ESTATE INVEST TRUST	587,257	590,942	0.06
			<u>10,405,731</u>	<u>12,420,770</u>	<u>1.26</u>
		合計：香港	<u>10,405,731</u>	<u>12,420,770</u>	<u>1.26</u>
		アイルランド			
普通株式					
	54,344	MEDTRONIC PLC	3,489,872	5,340,928	0.54
	223,215	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	3,770,028	3,377,000	0.34
			<u>7,259,900</u>	<u>8,717,928</u>	<u>0.88</u>
		合計：アイルランド	<u>7,259,900</u>	<u>8,717,928</u>	<u>0.88</u>
		イタリア			
普通株式					
	929,032	ENI SPA	15,002,239	17,553,896	1.79
	2,771,884	BANCA INTESA SPA	6,810,746	7,140,188	0.72
			<u>21,812,985</u>	<u>24,694,084</u>	<u>2.51</u>
		合計：イタリア	<u>21,812,985</u>	<u>24,694,084</u>	<u>2.51</u>
		日本			
普通株式					
	61,000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	2,147,936	2,466,244	0.26
	73,000	MITSUBISHI CORP	1,742,124	2,253,135	0.24
	355,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	2,027,898	2,219,259	0.23
	215,000	NISSAN MOTOR CO LTD	2,093,992	2,015,803	0.20
	215,000	JXTG HOLDINGS	978,434	1,626,858	0.17
	32,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	1,129,571	1,590,267	0.16
	58,000	NTT DOCOMO	1,207,122	1,562,109	0.16
	85,000	ITOCHU CORP	1,149,022	1,558,671	0.16
	58,000	JAPAN TOBACCO INC	1,920,538	1,516,601	0.15
	49,000	KOMATSU LTD	1,156,460	1,492,939	0.15
	47,000	SUBARU CORP	1,633,930	1,441,947	0.15
	31,000	NIPPON TELG & TEL CORP NTT	1,125,896	1,402,557	0.14
	19,000	TOYOTA MOTOR CORP	1,173,765	1,188,442	0.12
	40,000	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	1,011,838	1,187,693	0.12

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
65,000	SUMITOMO CORP	997,171	1,085,626	0.11
60,000	ASTELLAS PHARMA INC	804,154	1,048,400	0.11
24,000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	1,074,711	1,028,511	0.10
21,000	DENTSU	938,424	975,668	0.10
75,000	HITACHI METALS LTD	947,518	930,310	0.09
58,000	ISUZU MOTORS LTD	748,165	915,790	0.09
26,000	HITACHI LTD	854,244	884,775	0.09
32,000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	780,703	881,601	0.09
42,000	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	829,244	875,880	0.09
31,000	HITACHI CAPITAL	654,107	864,983	0.09
47,000	mitsui & CO LTD	675,854	837,199	0.08
14,000	TOYOTA INDUSTRIES CORP	816,174	829,410	0.08
77,000	AMADA HOLDINGS CO LTD	885,014	823,424	0.08
50,000	ORIX CORP	772,144	811,955	0.08
110,000	mitsubishi MOTORS CORP	812,616	777,749	0.08
28,000	KDDI CORP	701,803	774,857	0.08
5,000	MURATA MANUFACTURING CO LTD	683,918	769,858	0.08
150,000	YAMADA DENKI CO LTD	772,401	760,381	0.08
9,000	KAO CORP	491,646	727,903	0.07
105,000	CHIBA BANK LTD	728,555	718,329	0.07
14,000	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	516,664	706,850	0.07
33,000	SHOWA SHELL SEKIYU KK	495,177	700,265	0.07
24,000	YAMAHA MOTOR CO LTD	741,174	673,896	0.07
36,000	JSR CORPORATION	695,478	673,155	0.07
44,000	SEKISUI HOUSE LTD	645,234	672,045	0.07
21,000	CANON INC	697,054	668,342	0.07
48,000	mitsubishi ELECTRIC CORP	618,506	658,662	0.07
10,000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	539,043	643,569	0.07
13,000	AISIN SEIKI CO LTD	616,865	633,783	0.06
37,000	SEIKO EPSON CORP	737,021	632,161	0.06
15,000	AGC INC	622,051	623,512	0.06
32,000	LIXIL GROUP CORPORATION	586,679	617,262	0.06
8,100	FUJITSU LTD	520,479	578,133	0.06
14,000	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	536,287	577,131	0.06
16,000	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	482,040	562,250	0.06
7,000	NITTO DENKO CORP	545,337	525,540	0.05
45,000	PANASONIC CORP	423,458	525,060	0.05
24,000	AZBIL CORP	396,076	523,036	0.05
11,000	TSUBAKIMOTO CHAIN CO	480,261	510,094	0.05
44,000	NTT URBAN DEVELOPMENT CORP	398,340	505,052	0.05
14,000	DIC CORP	505,660	504,805	0.05
18,000	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT CO	503,901	499,074	0.05
30,000	NGK INSULATORS LTD	608,332	495,636	0.05
88,000	RESONA HOLDINGS INC	429,330	495,199	0.05

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
2,500	HIKARI TSUSHIN INC	260,784	495,019	0.05
2,600	FANUC CORPORATION	722,877	490,981	0.05
51,000	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	314,254	488,958	0.05
45,000	KONICA MINOLTA INC	495,478	479,238	0.05
20,000	JAPAN POST INSURANCE CO LTD	445,601	474,830	0.05
14,000	EXEDY CORP	398,154	464,692	0.05
8,000	PIGEON CORP	284,376	451,380	0.05
22,000	HITACHI CHEMICAL CO LTD	568,594	448,612	0.05
10,000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	446,916	446,090	0.05
17,000	MITSUMI CHEMICALS INC	503,621	425,787	0.04
41,000	KANDENKO CO LTD	459,863	423,988	0.04
18,000	JFE HOLDINGS INC	401,984	413,700	0.04
43,000	OBAYASHI CORP	479,784	407,899	0.04
35,000	DAICEL CORP	425,677	407,300	0.04
14,000	MITSUMI MINING & SMELTING CO LTD	399,740	406,066	0.04
11,000	POLA ORBIS HOLDINGS INC	393,843	402,451	0.04
12,000	HANWA CO LTD	429,790	399,894	0.04
12,000	SATO HOLDINGS CORP	263,566	398,307	0.04
13,000	HONDA MOTOR CO LTD	417,422	394,137	0.04
18,000	ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP	291,366	391,801	0.04
9,000	DAIICHI SANKYO CO LTD	198,678	390,770	0.04
10,000	MITSUBISHI HEAVY IND LTD	507,897	386,758	0.04
8,000	MEITEC CORPORATION	342,961	385,789	0.04
2,800	TOKYO ELECTRON LTD	215,346	385,330	0.04
11,000	HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CORP	464,881	379,662	0.04
54,000	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	306,522	377,043	0.04
10,000	OTSUKA CORP	327,200	373,799	0.04
2,900	DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD	392,369	373,653	0.04
10,000	JAPAN AIRLINES	341,054	360,046	0.04
10,000	AOZORA BANK LTD	371,143	357,930	0.04
12,000	WACOAL HOLDINGS CORP	353,961	344,882	0.04
18,000	USS CO LTD	319,935	334,673	0.03
26,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	342,414	334,656	0.03
19,200	TECMO KOEI HOLDINGS CO LTD	323,969	330,749	0.03
24,000	TOHOKU ELEC POWER CO INC	307,284	326,263	0.03
8,000	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	260,688	311,382	0.03
26,000	SANWA HOLDINGS CORP	240,106	310,130	0.03
25,000	K'S HOLDINGS CORP	294,713	303,050	0.03
6,000	NIPPON STEEL & SUMIKIN BUISSAN CORP	277,329	301,508	0.03
43,000	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	251,480	286,970	0.03
11,000	NIHON UNISYS LTD	172,636	284,334	0.03
4,000	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	266,243	279,327	0.03
8,000	DENKA CO LTD	214,049	279,291	0.03
85,000	SEVEN BANK LTD	293,641	269,021	0.03

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	120,000	NIPPON LIGHT METAL HLDG CO LTD	289,097	268,712	0.03
	17,000	SUMITOMO ELECTRIC IND LTD	243,978	267,072	0.03
	16,000	RESORTTRUST INC	294,392	264,198	0.03
	4,000	NIPPON EXPRESS	255,912	263,070	0.03
	4,000	TREND MICRO INC	175,810	257,780	0.03
	8,000	PARK24 CO LTD	208,253	242,264	0.02
	8,000	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	284,538	237,680	0.02
	2,500	SHIMAMURA CORP	286,827	237,592	0.02
	8,000	KYOWA EXEO CORP	123,557	234,506	0.02
	13,000	STAR MICRONICS CO LTD	203,553	231,508	0.02
	39,000	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	176,494	228,643	0.02
	10,000	STARTS CORP INC	221,335	221,017	0.02
	10,000	SONY FINANCIAL HOLDINGS INC	167,677	220,753	0.02
	16,500	SUMITOMO WAREHOUSE CO LTD	199,477	219,215	0.02
	3,500	TECHNOPRO HOLDINGS INC	145,561	217,535	0.02
	4,000	SAWAI PHARMA	183,267	216,169	0.02
	7,000	AOYAMA TRADING CO LTD	257,003	215,375	0.02
	9,000	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	190,704	209,627	0.02
	6,000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	194,279	200,688	0.02
	5,000	TAIYO HOLDINGS CO LTD	216,961	193,291	0.02
	10,000	NIPPON PAPER INDUSTRIES CO LTD	185,680	184,343	0.02
	22,000	SENKO GROUP HOLDINGS	152,276	183,479	0.02
	14,000	RELIA INC	141,357	172,794	0.02
	10,000	KONOIKE TRANSPORT CO LTD	150,629	171,119	0.02
	4,000	SOMPO HOLDINGS INC	125,940	170,643	0.02
	8,000	DAIKYO INC	160,755	163,061	0.02
	12,000	SHIKOKU ELEC PWR	151,680	156,890	0.02
	23,000	ONWARD HOLDINGS	163,271	154,307	0.02
	29,000	SKY PERFECT JSAT HOLDINGS INC	126,827	140,104	0.01
	9,000	SAKATA INX CORP	131,876	114,335	0.01
	5,500	KYORIN CO LTD	109,424	113,753	0.01
			<u>71,516,118</u>	<u>78,199,315</u>	<u>7.94</u>
		合計：日本	<u>71,516,118</u>	<u>78,199,315</u>	<u>7.94</u>
		ルクセンブルグ			
普通株式	122,703	RTL GROUP	9,184,423	8,796,486	0.89
			<u>9,184,423</u>	<u>8,796,486</u>	<u>0.89</u>
		合計：ルクセンブルグ	<u>9,184,423</u>	<u>8,796,486</u>	<u>0.89</u>
		オランダ			
普通株式	684,719	ING GROEP NV - CVA	9,906,829	8,872,255	0.90
	371,823	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	8,259,468	8,541,925	0.87

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	91,838	KONINKLIJKE P-NY	3,416,211	4,174,037	0.42
	125,010	AKZO NOBEL NV SPON ADR	3,033,139	3,892,374	0.40
		合計：オランダ	24,615,647	25,480,591	2.59
		ニュージーランド			
普通株式	350,026	A2 MILK CO LTD	3,299,196	2,587,121	0.26
	47,987	XERO LTD	1,699,380	1,697,212	0.17
		合計：ニュージーランド	4,998,576	4,284,333	0.43
		ノルウェー			
普通株式	404,535	DNB ASA	6,048,503	8,501,978	0.86
		合計：ノルウェー	6,048,503	8,501,978	0.86
		パプアニューギニア			
普通株式	488,157	OIL SEARCH LTD	2,893,518	3,181,733	0.32
		合計：パプアニューギニア	2,893,518	3,181,733	0.32
		ポーランド			
普通株式	3,954,527	ORANGE POLSKA SA	9,590,015	4,788,333	0.49
	1,315,588	PGE POLSKA GRUPA ENERG SA	6,384,388	3,390,000	0.34
		合計：ポーランド	15,974,403	8,178,333	0.83
		韓国			
普通株式	195,000	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	1,336,386	1,599,992	0.16
	16,500	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	1,648,216	1,547,245	0.16
	36,000	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	1,291,642	1,460,686	0.15
	35,000	SAMSUNG ELECT CO LTD N/VOTING SHS	1,217,694	1,194,471	0.12
	9,290	S-OIL CORP	1,037,407	1,147,567	0.12
	5,800	LG CHEM LTD PREFERENCE	1,128,275	1,066,842	0.11
	16,200	DB INSURANCE CO LTD	780,703	1,063,379	0.11
	4,000	POSCO	749,723	1,062,153	0.11
	10,000	HYUNDAI MOTOR CO LTD PREFERENCE	911,635	705,998	0.07
	9,000	WOONG JIN COWAY CO LTD	741,983	704,375	0.07

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	2,100	SK TELECOM CO LTD	531,589	533,962	0.05
			11,375,253	12,086,670	1.23
		合計：韓国	11,375,253	12,086,670	1.23
		ルーマニア			
投資信託	16,227,397	SC FONDUL PROPRIETATEA SA ETF	3,074,129	3,759,846	0.38
			3,074,129	3,759,846	0.38
		合計：ルーマニア	3,074,129	3,759,846	0.38
		ロシア			
普通株式	100,770	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,383,643	7,644,412	0.78
	823,538	GAZPROM- ADR	3,821,510	4,073,219	0.41
			9,205,153	11,717,631	1.19
		合計：ロシア	9,205,153	11,717,631	1.19
		シンガポール			
普通株式	253,051	DBS GROUP HOLDING LTD	3,637,682	4,828,747	0.49
	160,008	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	2,746,868	3,169,148	0.32
	270,088	OVERSEAS CHINESE BANKING CORP LTD	1,950,369	2,259,870	0.23
	830,000	SINGAPORE TELECOM 1000	2,509,581	1,966,868	0.20
	540,000	SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,453,900	1,406,034	0.14
	1,000,000	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,137,101	1,177,547	0.12
			13,435,501	14,808,214	1.50
		合計：シンガポール	13,435,501	14,808,214	1.50
		スペイン			
普通株式	672,432	REPSOL SA	13,432,598	13,403,184	1.36
			13,432,598	13,403,184	1.36
		合計：スペイン	13,432,598	13,403,184	1.36
		スイス			
普通株式	94,789	NOVARTIS AG-SPONSORED ADR	7,244,743	8,194,509	0.83
	74,072	SWISS RE AG	6,293,636	6,854,229	0.70
	179,855	ABB LTD SPON ADR	4,296,846	4,251,772	0.43
			17,835,225	19,300,510	1.96
		合計：スイス	17,835,225	19,300,510	1.96

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		台湾			
普通株式	1,210,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	5,539,455	10,406,062	1.05
	1,950,000	CATHAY FINANCIAL HOLDINGS	3,124,479	3,354,019	0.33
	1,170,000	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	3,489,196	3,035,868	0.31
	473,000	TAIWAN SECOM	1,352,756	1,366,789	0.14
	1,000,000	WPG HOLDINGS CO LTD	1,195,939	1,241,684	0.13
	480,322	ASE TECHNOLOGY HOLDINGS CO LT	1,192,916	1,172,359	0.12
	360,000	TONG HSING ELECTRONIC INDUSTRIES LT	1,016,825	1,138,156	0.12
	610,000	CTCI CORP	911,949	981,258	0.10
	1,000,000	INVENTEC CORPORATION	742,460	897,682	0.09
	39,000	ST SHINE OPTICAL CO LTD	601,693	857,352	0.09
	185,000	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	597,282	666,709	0.07
	70,000	MEDIATEK INCORPORATION	650,714	665,310	0.06
	280,000	NANYA TECHNOLOGY	598,556	532,974	0.05
	280,000	PRIMAX ELECTRONICS LTD	335,820	448,120	0.05
	420,000	E INK HOLDINGS	660,140	430,691	0.04
	140,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR CO LTD	373,401	274,743	0.03
			22,383,581	27,369,776	2.78
		合計：台湾	22,383,581	27,369,776	2.78
		タイ			
普通株式	5,004,800	DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F	1,751,110	2,320,913	0.24
	470,100	TISCO FINANCIAL GROUP PUB CO NVDR	895,680	1,217,184	0.12
	428,200	PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC CO LTD F	732,675	1,075,601	0.11
	1,900,000	STAR PETROLEUM REFINING PCL F	1,010,100	875,228	0.09
	4,255,700	TPI POLENE POWER F	930,960	874,931	0.09
	1,700,000	LAND AND HOUSE PLC NVDR	421,671	604,405	0.06
			5,742,196	6,968,262	0.71
		合計：タイ	5,742,196	6,968,262	0.71
		トルコ			
普通株式	2,255,087	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	5,976,227	1,363,762	0.14
			5,976,227	1,363,762	0.14
		合計：トルコ	5,976,227	1,363,762	0.14
		イギリス			
普通株式	4,203,716	MORRISON WM SUPERMARKETS PLC	12,182,108	14,280,724	1.45
	6,710,014	CENTRICA PLC	24,137,109	13,619,181	1.38
	1,098,360	PEARSON PLC	11,266,281	12,888,162	1.31

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
1,670,977	BP PLC	10,910,366	12,885,265	1.31
3,986,251	TESCO PLC	12,033,458	12,511,084	1.27
1,397,796	HSBC HOLDINGS PLC	12,405,863	12,299,484	1.25
3,621,316	RBS GROUP	12,993,941	11,781,937	1.20
12,662,881	LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,032,157	9,835,739	1.00
931,718	STANDARD CHARTERED PLC	10,099,620	7,749,329	0.79
110,214	ROYAL DUTCH SHELL PLC SPON ADR A	6,154,332	7,533,127	0.76
311,687	ANGLO AMER PLC	6,188,769	7,037,035	0.71
744,357	VODAFONE GROUP PLC (NEW)	2,457,416	1,603,555	0.16
		130,861,420	124,024,622	12.59
	合計：イギリス	130,861,420	124,024,622	12.59
	アメリカ			
普通株式				
106,737	APPLE INC *	11,804,317	23,987,005	2.44
392,229	CISCO SYSTEMS INC *	10,059,351	18,956,427	1.93
405,562	PFIZER INC	12,482,707	17,840,671	1.81
186,900	QUALCOMM INC *	11,782,181	13,391,385	1.36
85,638	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,813,901	11,155,206	1.13
96,483	JPMORGAN CHASE & CO *	5,562,440	10,976,871	1.11
709,346	AES CORP *	8,964,835	9,810,255	1.00
176,844	VERIZON COMMUNICATIONS INC	8,619,117	9,438,164	0.96
144,645	ORACLE CORP	5,742,751	7,459,343	0.76
244,601	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC *	6,160,133	7,328,246	0.74
158,094	EXELON CORP	5,220,597	6,832,823	0.69
181,021	COMCAST CORP A *	5,821,842	6,397,282	0.65
88,121	CITIGROUP INC *	4,581,429	6,336,781	0.64
101,607	MOLSON COORS BREWING CO	7,168,046	6,250,863	0.63
160,734	FIRSTENERGY CORP	5,016,696	5,911,797	0.60
72,940	BAXTER INTL INC *	2,834,157	5,649,932	0.57
247,169	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,301,935	5,509,397	0.56
65,540	CONOCOPHILLIPS	2,960,346	5,106,221	0.52
66,710	GILEAD SCIENCES INC	5,883,347	5,091,974	0.52
104,493	MORGAN STANLEY	4,971,380	4,931,025	0.50
180,450	WILLIAMS COS INC	5,076,217	4,917,263	0.50
62,908	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,168,340	4,643,869	0.47
25,350	NORFOLK SOUTHERN CORP	2,906,622	4,619,277	0.47
64,033	KELLOGG CO	4,228,121	4,498,959	0.46
35,784	LOWE'S COMPANIES INC	2,763,148	4,175,277	0.42
101,927	DEVON ENERGY CORP	3,102,567	4,076,061	0.41
69,907	WELLS FARGO & CO	4,198,566	3,690,391	0.37
35,769	JM SMUCKER CO	4,294,897	3,663,103	0.37
108,365	KROGER CO	3,178,040	3,151,254	0.32
61,172	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	2,370,326	3,021,285	0.31

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
53,023	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,346,665	2,794,312	0.28
30,526	MARATHON PETROLEUM CORP	1,233,912	2,508,627	0.25
54,485	PG&E CORP	3,203,132	2,489,420	0.25
14,265	LABORATORY CP	2,400,184	2,444,450	0.25
131,576	REGIONS FINANCIAL CORP	1,371,469	2,443,366	0.25
18,145	HUBBELL INC	2,028,591	2,424,898	0.25
44,352	E*TRADE FINANCIAL CORP	1,750,093	2,342,673	0.24
36,023	NUCOR CORP	2,141,632	2,285,299	0.23
19,139	VALERO ENERGY CORP	1,101,494	2,194,478	0.22
23,718	NASDAQ INC	1,149,478	2,040,222	0.21
176,223	GENERAL ELECTRIC CO	3,687,169	2,023,040	0.21
5,484	BIOGEN INC	1,891,641	1,944,955	0.20
19,945	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,568,065	1,907,540	0.19
73,218	MARATHON OIL CORP	1,769,854	1,686,943	0.17
39,185	GENERAL MILLS INC	2,167,341	1,682,212	0.17
113,661	FREEPORT MCMORAN INC	1,607,477	1,586,708	0.16
7,065	LEAR CORP	645,157	1,023,789	0.10
8,881	PACKAGING CORP OF AMERICA	638,941	984,814	0.10
24,000	DISH NETWORK CORP-A	841,088	844,320	0.09
64,795	SLM CORP	557,391	731,212	0.07
8,165	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	739,763	671,163	0.07
6,112	PPG INDUSTRIES INC	651,267	663,580	0.07
6,621	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	527,216	659,716	0.07
7,814	EDISON INTERNATIONAL	531,998	527,523	0.05
18,435	ALLY FINANCIAL INC	547,545	490,094	0.05
		215,136,915	270,213,761	27.42
	合計：アメリカ	215,136,915	270,213,761	27.42
	組入資産合計	824,176,827	904,721,578	91.82

* 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

2018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

2018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。

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	84,825	USD	765	2018年10月10日	(17)
JPY	109,764	USD	993	2018年10月10日	(25)
JPY	299,492	USD	2,691	2018年10月10日	(49)
JPY	499,120	USD	4,486	2018年10月10日	(83)
JPY	2,095,489	USD	18,969	2018年10月10日	(479)
ZAR	1,020,000,000	USD	65,332,537	2018年11月28日	6,003,729
BRL	516,400,000	USD	125,202,812	2018年11月5日	3,047,674
ZAR	177,000,000	USD	11,392,192	2018年10月26日	1,042,320
MXN	350,000,000	USD	17,810,644	2018年11月5日	677,371
MXN	350,000,000	USD	17,882,689	2018年11月5日	605,326
MXN	870,000,000	USD	45,546,161	2018年11月5日	409,763
TRY	612,200,000	USD	99,270,309	2018年10月26日	286,201
USD	8,929,184	INR	650,000,000	2018年10月26日	4,804
USD	9,981,935	ZAR	144,000,000	2018年10月26日	(134,278)
INR	470,000,000	USD	6,609,850	2018年10月26日	(156,836)
INR	6,813,000,000	USD	93,591,592	2018年11月28日	(417,249)
MXN	2,310,000,000	USD	121,912,602	2018年12月5日	(429,695)
IDR	934,900,000,000	USD	63,002,303	2018年10月26日	(488,014)
USD	7,144,514	ZAR	110,000,000	2018年10月26日	(583,148)
IDR	800,000,000,000	USD	53,996,445	2018年11月28日	(731,181)
IDR	960,600,000,000	USD	64,836,232	2018年11月28日	(877,965)
ZAR	1,509,000,000	USD	107,674,962	2018年10月26日	(1,665,479)
INR	5,640,000,000	USD	81,180,280	2018年10月26日	(3,744,112)
USD	52,171,767	TRY	355,200,000	2018年10月26日	(5,591,174)
USD	35,756,367	TRY	257,000,000	2018年10月26日	(6,037,203)
USD	94,295	JPY	10,526,049	2018年10月10日	1,414
USD	66,479	JPY	7,384,275	2018年10月10日	1,320
USD	196,071	JPY	22,077,430	2018年10月10日	1,261
USD	196,071	JPY	22,053,957	2018年10月25日	1,247
USD	50,383	JPY	5,601,575	2018年10月10日	955
USD	33,056	JPY	3,671,763	2018年10月10日	657
USD	7,882	JPY	875,590	2018年10月10日	157
USD	31,954	JPY	3,603,739	2018年10月10日	156

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	31,954	JPY	3,599,904	2018年10月25日	153
USD	27,028	JPY	3,048,676	2018年10月10日	127
USD	27,028	JPY	3,045,389	2018年10月25日	125
JPY	1,829,176,286	USD	16,379,260	2018年10月25日	(220,313)
JPY	1,822,927,285	USD	16,464,382	2018年10月10日	(378,882)
USD	24,392,046	JPY	2,707,000,000	2018年10月26日	476,606
USD	26,638,324	JPY	2,965,000,000	2018年10月19日	457,391
USD	121,082,436	EUR	103,681,951	2018年10月16日	439,121
USD	2,230,784	TRY	11,220,157	2018年10月17日	395,088
USD	126,635,670	GBP	96,607,993	2018年10月18日	341,353
USD	13,448,669	JPY	1,500,000,000	2018年10月26日	196,670
USD	31,733,148	AUD	43,700,000	2018年10月31日	184,700
USD	31,733,017	AUD	43,700,000	2018年10月31日	184,569
USD	31,875,790	AUD	43,900,000	2018年10月31日	182,955
USD	30,061,595	AUD	41,400,000	2018年10月31日	173,592
USD	11,452,505	JPY	1,278,000,000	2018年10月19日	167,773
USD	8,562,462	NOK	69,375,080	2018年10月17日	49,172
TRY	1,417,263	USD	194,422	2018年10月17日	37,452
USD	3,868,849	DKK	24,550,559	2018年10月17日	37,307
USD	3,123,438	JPY	350,000,000	2018年10月26日	31,305
USD	5,404,776	RON	21,633,454	2018年10月17日	17,710
NOK	2,521,702	USD	298,348	2018年10月17日	11,099
TWD	40,000,000	USD	1,302,889	2018年10月19日	9,446
PLN	2,909,472	USD	782,558	2018年10月17日	9,429
TWD	30,000,000	USD	975,007	2018年10月19日	9,244
RON	2,035,711	USD	498,008	2018年10月17日	8,915
TRY	749,410	USD	113,942	2018年10月17日	8,666
PLN	1,254,886	USD	333,323	2018年10月17日	8,269
CZK	9,985,523	USD	443,979	2018年10月17日	7,876
TWD	30,000,000	USD	976,594	2018年10月19日	7,657
TRY	1,363,725	USD	217,032	2018年10月17日	6,083
DKK	2,321,183	USD	356,184	2018年10月17日	6,076
USD	13,085,815	KRW	14,500,000,000	2018年10月19日	5,960
KRW	400,000,000	USD	354,997	2018年10月19日	5,827
CZK	19,802,237	USD	891,044	2018年10月17日	5,027
KRW	400,000,000	USD	355,982	2018年10月19日	4,841
CHF	255,667	USD	257,901	2018年10月17日	4,554
KRW	400,000,000	USD	356,633	2018年10月19日	4,190
THB	9,000,000	USD	274,722	2018年10月26日	3,835
SGD	700,000	USD	508,631	2018年10月26日	3,666
HKD	9,000,000	USD	1,147,570	2018年10月26日	3,386

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)
KRW	400,000,000	USD	357,509	2018年10月19日	3,314
AUD	3,800,000	USD	2,740,149	2018年10月31日	3,193
HKD	7,000,000	USD	892,511	2018年10月26日	2,677
DKK	846,423	USD	130,104	2018年10月17日	1,995
THB	7,000,000	USD	214,677	2018年10月26日	1,979
USD	1,024,175	HKD	8,000,000	2018年10月26日	1,103
USD	440,136	SGD	600,000	2018年10月26日	1,025
USD	586,022	SGD	800,000	2018年10月26日	540
DKK	2,267,202	USD	353,526	2018年10月17日	310
USD	852,179	TWD	26,000,000	2018年10月19日	(838)
USD	359,911	KRW	400,000,000	2018年10月19日	(912)
USD	153,741	THB	5,000,000	2018年10月26日	(1,013)
CZK	11,587,040	USD	525,703	2018年10月17日	(1,378)
USD	357,956	TWD	11,000,000	2018年10月19日	(2,936)
USD	1,020,065	HKD	8,000,000	2018年10月26日	(3,007)
USD	2,645,269	JPY	300,000,000	2018年10月19日	(3,729)
USD	6,947,929	CZK	153,716,400	2018年10月17日	(7,893)
RON	4,993,086	USD	1,251,502	2018年10月17日	(8,147)
USD	9,096,637	PLN	33,616,605	2018年10月17日	(54,141)
USD	7,303,842	THB	239,000,000	2018年10月26日	(93,422)
USD	14,973,705	SGD	20,600,000	2018年10月26日	(102,463)
USD	39,017,548	HKD	306,000,000	2018年10月26日	(114,988)
USD	30,812,462	TWD	943,000,000	2018年10月19日	(125,848)
USD	6,909,452	CHF	6,883,611	2018年10月17日	(156,931)
					(6,526,122)

注記2-オプション契約

2018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>							
USD	(53)	C GE UN 13.60 28/09/18	FLEX	2018年9月28日	(1,392)	0	1,392
USD	(48)	C GE UN 13.75 28/09/18	FLEX	2018年9月28日	(1,333)	0	1,333
USD	(181)	C IPG UN 22.8 28/09/18	FLEX	2018年9月28日	(7,559)	0	7,559
USD	(15,200)	C SLM UQ 11.71 28/09/18	OTC	2018年9月28日	(3,371)	0	3,371
USD	(89)	C WFC UN 60.75 28/09/18	FLEX	2018年9月28日	(6,076)	0	6,076
GBP	(62,337)	C AAL LN 16.69521 09/10/18	OTC	2018年10月9日	(5,425)	(64,478)	(59,053)
GBP	(65,454)	C AAL LN 17.65611 06/12/18	OTC	2018年12月6日	(18,105)	(75,907)	(57,802)
GBP	(62,337)	C AAL LN 20.75455 20/12/18	OTC	2018年12月20日	(21,116)	(15,712)	5,404
USD	(128)	C AAPL UQ 215 28/09/18		2018年9月28日	(38,386)	(124,160)	(85,774)
USD	(30)	C AAPL UQ 217.5 26/10/18		2018年10月26日	(20,618)	(30,180)	(9,562)
USD	(78)	C AAPL UQ 227.5 12/10/18		2018年10月12日	(50,450)	(18,564)	31,886
USD	(10)	C AAPL UQ 227.5 26/10/18		2018年10月26日	(7,053)	(4,050)	3,003
USD	(128)	C AAPL UQ 230 19/10/18		2018年10月19日	(56,528)	(28,416)	28,112
USD	(32,400)	C ABB UN 23.4466 11/10/18	OTC	2018年10月11日	(15,270)	(12,971)	2,299
USD	(48,500)	C ABB UN 24.07 24/10/18	OTC	2018年10月24日	(21,723)	(11,042)	10,681
EUR	(74,364)	C AD NA 20.4326 20/12/18	OTC	2018年12月20日	(21,998)	(30,550)	(8,552)
EUR	(74,364)	C AD NA 21.9185 09/10/18	OTC	2018年10月9日	(5,437)	(5)	5,432
EUR	(40,173)	C AD NA 22.0595 22/11/18	OTC	2018年11月22日	(12,763)	(781)	11,982
EUR	(75,604)	C AD NA 22.0604 06/12/18	OTC	2018年12月6日	(23,825)	(2,356)	21,469
EUR	(78,497)	C AD NA 22.4575 25/10/18	OTC	2018年10月25日	(22,719)	(190)	22,529
USD	(898)	C AES UN 13 19/10/18		2018年10月19日	(41,994)	(71,840)	(29,846)
USD	(106,400)	C AES UN 13.75 31/10/18	OTC	2018年10月31日	(30,962)	(47,175)	(16,213)
USD	(1,230)	C AES UN 14 19/10/18		2018年10月19日	(37,841)	(23,370)	14,471
USD	(8,000)	C AGO US 42.392 30/10/18	OTC	2018年10月30日	(7,549)	(6,915)	634
EUR	(38,399)	C AGS BB 46.4951 09/10/18	OTC	2018年10月9日	(5,909)	(25,224)	(19,315)
EUR	(44,799)	C AGS BB 46.7675 06/12/18	OTC	2018年12月6日	(30,098)	(66,870)	(36,772)
EUR	(22,399)	C AGS BB 47.1772 22/11/18	OTC	2018年11月22日	(15,022)	(25,513)	(10,491)
EUR	(38,399)	C AGS BB 48.185 20/12/18	OTC	2018年12月20日	(30,245)	(36,432)	(6,187)
EUR	(22,549)	C AGS BB 48.9551 25/10/18	OTC	2018年10月25日	(13,751)	(4,295)	9,456
USD	(11)	C AIG UN 54 12/10/18		2018年10月12日	(1,075)	(583)	492
USD	(52)	C AIG UN 55 19/10/18		2018年10月19日	(2,536)	(676)	1,860
USD	(176)	C AIG UN 57.5 16/11/18		2018年11月16日	(8,759)	(3,696)	5,063
USD	(15,000)	C AKZOY UN 31.4062 05/10/18	OTC	2018年10月5日	(7,500)	(4,539)	2,961
USD	(15,000)	C AKZOY UN 31.4062 11/10/18	OTC	2018年10月11日	(10,032)	(6,499)	3,533
USD	(20,000)	C AKZOY UN 31.855 31/10/18	OTC	2018年10月31日	(8,000)	(10,469)	(2,469)
AUD	(23,240)	C ALL AT 33.2575 21/11/18	OTC	2018年11月21日	(9,471)	(387)	9,084

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	(28,154)	C ALL AT 33.4769 14/11/18 OTC	2018年11月14日	(13,422)	(273)	13,149
AUD	(31,054)	C ALL AT 33.8779 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(14,101)	(23)	14,078
AUD	(22,773)	C ALL AT 34.1493 19/12/18 OTC	2018年12月19日	(9,585)	(469)	9,116
USD	(1,700)	C ALLY US 27.331 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(1,357)	(126)	1,231
USD	(2,100)	C ALLY US 27.65 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(1,443)	(30)	1,413
USD	(44)	C ALLY US 28 19/10/18	2018年10月19日	(1,618)	(704)	914
EUR	(22,165)	C ALO FP 39.913 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(8,689)	(13,891)	(5,202)
EUR	(32,234)	C ALO FP 40.2906 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(16,548)	(4,863)	11,685
EUR	(35,861)	C ALO FP 40.6944 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(16,065)	(18,526)	(2,461)
EUR	(34,581)	C ALO FP 40.788 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(4,760)	(262)	4,498
EUR	(34,581)	C ALO FP 41.4117 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(20,809)	(15,583)	5,226
AUD	(103,429)	C ALX AT 7.1516 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(11,088)	(15,598)	(4,510)
AUD	(74,642)	C ALX AT 7.2729 07/11/18 OTC	2018年11月7日	(6,837)	(6,792)	45
AUD	(41,228)	C ANZ AT 29.0573 19/12/18 OTC	2018年12月19日	(10,100)	(11,769)	(1,669)
AUD	(374)	C ANZ AT 30.01 29/11/18	2018年11月29日	(9,396)	(1,755)	7,641
AUD	(33,410)	C ANZ AT 30.3331 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(6,925)	(245)	6,680
AUD	(377)	C ANZ AT 31 25/10/18	2018年10月25日	(8,820)	(82)	8,738
AUD	(78,788)	C A2M AT 12.1864 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(19,138)	(932)	18,206
AUD	(64,147)	C A2M AT 12.5774 07/11/18 OTC	2018年11月7日	(14,336)	(1,220)	13,116
AUD	(46,774)	C A2M AT 12.8605 12/12/18 OTC	2018年12月12日	(16,799)	(2,354)	14,445
USD	(103)	C BAX UN 73 28/09/18	2018年9月28日	(9,143)	(38,934)	(29,791)
USD	(118)	C BAX UN 74.5 05/10/18	2018年10月5日	(12,834)	(40,120)	(27,286)
USD	(3)	C BAX UN 77.5 19/10/18	2018年10月19日	(431)	(270)	161
USD	(104)	C BAX UN 78 26/10/18	2018年10月26日	(12,247)	(12,896)	(649)
USD	(338)	C BBD UN 7 19/10/18	2018年10月19日	(15,891)	(18,928)	(3,037)
USD	(30,800)	C BBD UN 7.14 28/09/18 OTC	2018年9月28日	(10,423)	(3,233)	7,190
AUD	(31,038)	C BHP AT 34.9871 28/11/18 OTC	2018年11月28日	(8,957)	(24,699)	(15,742)
AUD	(272)	C BHP AT 35 29/11/18	2018年11月29日	(8,724)	(20,516)	(11,792)
AUD	(34,397)	C BHP AT 35.2007 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(18,372)	(16,169)	2,203
AUD	(32,177)	C BHP AT 35.3994 14/11/18 OTC	2018年11月14日	(8,978)	(17,463)	(8,485)
AUD	(349)	C BHP AT 35.5 25/10/18	2018年10月25日	(16,607)	(10,328)	6,279
AUD	(28,295)	C BHP AT 35.7228 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(13,789)	(5,460)	8,329
USD	(11)	C BIIB UQ 350 05/10/18	2018年10月5日	(10,757)	(9,680)	1,077
USD	(13)	C BIIB UQ 350 26/10/18	2018年10月26日	(12,207)	(21,580)	(9,373)
EUR	(15,293)	C BNP FP 53.0288 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(4,035)	(6,834)	(2,799)
EUR	(16,058)	C BNP FP 54.486 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(10,830)	(17,764)	(6,934)
EUR	(18,720)	C BNP FP 56.3926 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(10,115)	(8,482)	1,633
EUR	(18,849)	C BNP FP 58.362 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(12,035)	(870)	11,165
EUR	(15,293)	C BNP FP 58.4562 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(11,298)	(5,429)	5,869
GBP	(127,779)	C BP/ LN 5.71208 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(11,534)	(45,505)	(33,971)
GBP	(250,646)	C BP/ LN 5.78389 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(8,119)	(49,262)	(41,143)

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
GBP	(257, 322)	C BP/ LN 5.90194 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(24, 166)	(48, 988)	(24, 822)
GBP	(400, 473)	C BP/ LN 5.9385 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(44, 681)	(51, 934)	(7, 253)
GBP	(250, 646)	C BP/ LN 5.96654 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(24, 509)	(52, 363)	(27, 854)
AUD	(36, 000)	C BSL AT 18.5964 12/12/18 OTC	2018年12月12日	(6, 567)	(7, 992)	(1, 425)
AUD	(39, 508)	C BSL AT 18.6617 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(6, 494)	(5, 379)	1, 115
AUD	(31, 346)	C BSL AT 20.3351 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(10, 331)	(54)	10, 277
USD	(68)	C C UN 05/10/18 C75	2018年10月5日	(6, 243)	(544)	5, 699
USD	(49)	C C UN 71.5 28/09/18	2018年9月28日	(6, 236)	(2, 695)	3, 541
USD	(136)	C C UN 72.5 05/10/18	2018年10月5日	(10, 328)	(7, 888)	2, 440
USD	(68)	C C UN 72.5 12/10/18	2018年10月12日	(6, 734)	(7, 956)	(1, 222)
USD	(29)	C C UN 72.5 19/10/18	2018年10月19日	(2, 835)	(3, 886)	(1, 051)
USD	(46)	C C UN 73.5 26/10/18	2018年10月26日	(4, 289)	(5, 014)	(725)
AUD	(14, 099)	C CBA AT 73.5939 05/12/18 OTC	2018年12月5日	(8, 087)	(12, 106)	(4, 019)
AUD	(180)	C CBA AT 75 20/12/18	2018年12月20日	(12, 213)	(9, 679)	2, 534
AUD	(15, 076)	C CBA AT 75.9051 14/11/18 OTC	2018年11月14日	(8, 657)	(3, 220)	5, 437
AUD	(225)	C CBA AT 76 29/11/18	2018年11月29日	(17, 271)	(5, 522)	11, 749
AUD	(15, 067)	C CBA AT 76.9479 07/11/18 OTC	2018年11月7日	(9, 446)	(1, 297)	8, 149
AUD	(15, 596)	C CBA AT 77.5207 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(8, 277)	(269)	8, 008
USD	(20)	C CMCSA UQ 35.55 19/10/18 FLEX	2018年10月19日	(1, 995)	(1, 068)	927
USD	(111)	C CMCSA UQ 36 09/11/18	2018年11月9日	(8, 521)	(8, 658)	(137)
USD	(111)	C CMCSA UQ 36 26/10/18	2018年10月26日	(8, 512)	(6, 882)	1, 630
USD	(57)	C CMCSA UQ 36.25 19/10/18 FLEX	2018年10月19日	(4, 091)	(1, 667)	2, 424
USD	(95)	C CMCSA UQ 37.5 16/11/18	2018年11月16日	(11, 453)	(3, 705)	7, 748
USD	(78)	C CMCSA US 37 12/10/18	2018年10月12日	(4, 218)	(624)	3, 594
USD	(115)	C CMCSA US 37.5 02/11/18	2018年11月2日	(11, 358)	(3, 795)	7, 563
USD	(227)	C CMCSA US 38.5 05/10/18	2018年10月5日	(6, 303)	(1, 589)	4, 714
GBP	(704, 551)	C CNA LN 1.48149 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(16, 698)	(72, 835)	(56, 137)
GBP	(671, 001)	C CNA LN 1.53213 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(7, 594)	(32, 155)	(24, 561)
GBP	(704, 551)	C CNA LN 1.57638 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(19, 589)	(34, 186)	(14, 597)
GBP	(709, 099)	C CNA LN 1.5963 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(21, 289)	(9, 410)	11, 879
GBP	(671, 001)	C CNA LN 1.59663 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(19, 408)	(32, 339)	(12, 931)
USD	(31)	C COF UN 101 28/09/18	2018年9月28日	(3, 960)	(403)	3, 557
USD	(58)	C COF UN 98.5 26/10/18	2018年10月26日	(12, 474)	(9, 918)	2, 556
USD	(173)	C COP UN 72.5 16/11/18	2018年11月16日	(34, 601)	(104, 319)	(69, 718)
USD	(56)	C COP UN 73 12/10/18	2018年10月12日	(6, 505)	(27, 440)	(20, 935)
USD	(131)	C COP UN 74 05/10/18	2018年10月5日	(16, 868)	(48, 863)	(31, 995)
AUD	(38, 936)	C CPU AT 19.8582 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(5, 783)	(11, 871)	(6, 088)
AUD	(37, 952)	C CPU AT 19.8736 28/11/18 OTC	2018年11月28日	(8, 740)	(17, 468)	(8, 728)
AUD	(38, 339)	C CPU AT 19.9234 14/11/18 OTC	2018年11月14日	(9, 235)	(14, 480)	(5, 245)
USD	(245)	C CSCO UQ 46 19/10/18	2018年10月19日	(25, 667)	(54, 880)	(29, 213)
USD	(256)	C CSCO UQ 47.5 02/11/18	2018年11月2日	(26, 213)	(35, 840)	(9, 627)

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	(147)	C CSCO UQ 47.5 26/10/18	2018年10月26日	(13,356)	(16,611)	(3,255)
USD	(165)	C CSCO UQ 47.94 12/10/18 FLEX	2018年10月12日	(11,841)	(11,062)	779
USD	(165)	C CSCO UQ 48 05/10/18	2018年10月5日	(10,851)	(9,075)	1,776
USD	(308)	C CSCO UQ 48 16/11/18	2018年11月16日	(51,979)	(49,280)	2,699
USD	(165)	C CSCO UQ 48 19/10/18	2018年10月19日	(13,161)	(13,200)	(39)
USD	(165)	C CSCO UQ 48.75 30/10/18 FLEX	2018年10月30日	(10,686)	(12,891)	(2,205)
AUD	(4,843)	C CSL AT 211.231 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(14,537)	(5,128)	9,409
AUD	(3,384)	C CSL AT 216.3873 19/12/18 OTC	2018年12月19日	(7,699)	(7,322)	377
AUD	(4,908)	C CSL AT 221.1704 05/12/18 OTC	2018年12月5日	(8,365)	(5,739)	2,626
AUD	(4,230)	C CSL AT 231.781 10/10/18 OTC	2018年10月10日	(4,829)	(2)	4,827
AUD	(3,966)	C CSL AT 243.3134 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(8,842)	(283)	8,559
SGD	(110,000)	C DBS SP 27.1899 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(2,024)	(5,896)	(3,872)
SGD	(110,000)	C DBS SP 27.5992 26/10/18 OTC	2018年10月26日	(5,038)	(6,065)	(1,027)
USD	(109)	C DISH UQ 38 05/10/18	2018年10月5日	(7,995)	(7,630)	365
AUD	(97,479)	C DLX AT 8.0394 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(7,164)	(1,622)	5,542
AUD	(69,681)	C DLX AT 8.0812 07/11/18 OTC	2018年11月7日	(6,588)	(1,858)	4,730
AUD	(9,804)	C DMP AT 60.3981 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(8,029)	(1,118)	6,911
AUD	(11,210)	C DMP AT 61.4848 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(11,460)	(2,650)	8,810
NOK	(67,905)	C DNB NO 172.7214 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(15,608)	(19,272)	(3,664)
NOK	(80,907)	C DNB NO 175.6698 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(7,406)	(3,877)	3,529
NOK	(84,952)	C DNB NO 180.9487 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(19,685)	(19,876)	(191)
NOK	(49,048)	C DNB NO 180.9554 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(13,022)	(8,790)	4,232
NOK	(80,907)	C DNB NO 182.8262 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(19,617)	(18,871)	746
AUD	(90,520)	C DOW AT 7.9614 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(7,155)	(6,952)	203
USD	(19)	C DVN UN 40.5 26/10/18	2018年10月26日	(1,972)	(1,862)	110
USD	(66)	C DVN UN 41 02/11/18	2018年11月2日	(6,452)	(7,062)	(610)
USD	(66)	C DVN UN 41 16/11/18	2018年11月16日	(10,214)	(10,890)	(676)
USD	(42)	C DVN UN 42 12/10/18	2018年10月12日	(4,744)	(2,268)	2,476
USD	(151)	C DVN UN 42 19/10/18	2018年10月19日	(22,765)	(6,493)	16,272
USD	(118)	C DVN UN 44 19/10/18	2018年10月19日	(16,782)	(1,534)	15,248
USD	(49)	C DVN UN 44.5 05/10/18	2018年10月5日	(4,021)	(2,205)	1,816
USD	(49)	C DVN UN 45 12/10/18	2018年10月12日	(4,411)	(784)	3,627
USD	(3,500)	C EIX UN 68.205 26/10/18 OTC	2018年10月26日	(3,941)	(3,766)	175
EUR	(111,483)	C ENI IM 16.2823 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(9,314)	(25,488)	(16,174)
EUR	(130,714)	C ENI IM 16.3613 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(31,056)	(72,741)	(41,685)
EUR	(143,511)	C ENI IM 16.6811 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(35,215)	(25,354)	9,861
EUR	(102,193)	C ENI IM 16.8156 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(25,522)	(40,125)	(14,603)
EUR	(142,591)	C ENI IM 16.974 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(29,718)	(32,408)	(2,690)
USD	(35)	C ETFC US 55.5 02/11/18	2018年11月2日	(7,055)	(5,110)	1,945
USD	(124)	C ETFC US 56.5 12/10/18	2018年10月12日	(16,296)	(5,828)	10,468
USD	(40)	C ETFC US 62.5 28/09/18	2018年9月28日	(5,311)	(720)	4,591

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
USD	(434)	C EXC UN 44 19/10/18	2018年10月19日	(26,372)	(7,378)	18,994
USD	(27,700)	C EXC UN 44.31 30/10/18	OTC 2018年10月30日	(22,105)	(7,484)	14,621
USD	(530)	C FCX UN 15 12/10/18	2018年10月12日	(19,486)	(4,770)	14,716
USD	(105)	C FE UN 37 16/11/18	2018年11月16日	(8,586)	(8,400)	186
USD	(14)	C FE UN 37.08 03/10/18	FLEX 2018年10月3日	(865)	(160)	705
USD	(22,900)	C FE UN 37.502 11/10/18	OTC 2018年10月11日	(17,262)	(2,706)	14,556
USD	(66)	C FE UN 37.85 12/11/18	FLEX 2018年11月12日	(5,924)	(2,579)	3,345
USD	(49)	C FE UN 37.95 26/10/18	FLEX 2018年10月26日	(3,761)	(1,013)	2,748
USD	(40)	C FE UN 38 12/11/18	FLEX 2018年11月12日	(3,791)	(1,393)	2,398
USD	(90)	C FE UN 38 19/10/18	2018年10月19日	(6,729)	(1,440)	5,289
USD	(130)	C FE UN 38.02 23/10/18	FLEX 2018年10月23日	(10,499)	(1,991)	8,508
EUR	(30,086)	C FORTUM FH 22.5675 25/10/18	OTC 2018年10月25日	(9,686)	(5,527)	4,159
EUR	(23,544)	C GBF GY 45.1448 22/11/18	OTC 2018年11月22日	(14,838)	(13,062)	1,776
EUR	(6,977)	C GBF GY 46.2026 20/12/18	OTC 2018年12月20日	(4,613)	(4,170)	443
EUR	(19,107)	C GBF GY 46.4429 25/10/18	OTC 2018年10月25日	(12,727)	(1,409)	11,318
USD	(70)	C GE UN 12 19/10/18	2018年10月19日	(6,354)	(770)	5,584
USD	(25)	C GE UN 12 31/10/18	FLEX 2018年10月31日	(544)	(541)	3
USD	(15)	C GE UN 12.5 12/10/18	2018年10月12日	(411)	(45)	366
USD	(100)	C GE UN 13 05/10/18	2018年10月5日	(1,477)	(100)	1,377
USD	(87)	C GE UN 13 12/10/18	2018年10月12日	(2,590)	(174)	2,416
USD	(26)	C GE UN 13 16/11/18	2018年11月16日	(1,118)	(208)	910
USD	(45)	C GE UN 13 19/10/18	2018年10月19日	(1,234)	(135)	1,099
USD	(42)	C GE UN 13 21/12/18	2018年12月21日	(841)	(756)	85
USD	(30)	C GE UN 13 26/10/18	2018年10月26日	(893)	(210)	683
USD	(30)	C GE UN 13 28/09/18	2018年9月28日	(390)	(30)	360
USD	(34)	C GE UN 13.35 05/10/18	FLEX 2018年10月5日	(553)	(13)	540
USD	(27)	C GE UN 13.5 02/11/18	2018年11月2日	(588)	(162)	426
USD	(17)	C GE UN 14 16/11/18	2018年11月16日	(340)	(68)	272
USD	(246)	C GILD UQ 75 02/11/18	2018年11月2日	(46,927)	(79,950)	(33,023)
USD	(61)	C GILD UQ 75 19/10/18	2018年10月19日	(10,478)	(14,518)	(4,040)
USD	(187)	C GIS UN 47.5 19/10/18	2018年10月19日	(24,696)	(935)	23,761
USD	(13)	C HIG UN 50 19/10/18	2018年10月19日	(1,132)	(741)	391
USD	(79)	C HIG UN 50.44 17/10/18	FLEX 2018年10月17日	(7,407)	(1,012)	6,395
USD	(71)	C HIG UN 51 12/10/18	2018年10月12日	(5,289)	(4,544)	745
USD	(79)	C HIG UN 51.5 26/10/18	2018年10月26日	(6,538)	(4,108)	2,430
USD	(33)	C HIG UN 51.5 28/09/18	2018年9月28日	(2,797)	(561)	2,236
GBP	(209,669)	C HSBA LN 6.83506 09/10/18	OTC 2018年10月9日	(5,346)	(8,114)	(2,768)
GBP	(220,152)	C HSBA LN 6.94734 06/12/18	OTC 2018年12月6日	(18,648)	(24,461)	(5,813)
GBP	(220,152)	C HSBA LN 7.12276 22/11/18	OTC 2018年11月22日	(21,295)	(9,207)	12,088
GBP	(139,779)	C HSBA LN 7.1374 20/12/18	OTC 2018年12月20日	(12,611)	(9,780)	2,831
GBP	(221,574)	C HSBA LN 7.43812 25/10/18	OTC 2018年10月25日	(27,481)	(260)	27,221

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	(8,100)	C HUBB US 136.148 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(20,746)	(16,055)	4,691
EUR	(102,707)	C INGA NA 11.5662 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(5,831)	(3,244)	2,587
EUR	(107,843)	C INGA NA 12.5486 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(13,915)	(6,409)	7,506
EUR	(102,707)	C INGA NA 12.5793 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(16,177)	(7,420)	8,757
EUR	(107,843)	C INGA NA 12.788 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(19,324)	(3,050)	16,274
EUR	(108,539)	C INGA NA 13.6044 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(18,982)	(126)	18,856
USD	(316)	C IPG UN 22.95 16/11/18 FLEX	2018年11月16日	(30,894)	(22,782)	8,112
USD	(615)	C IPG UN 23.4 19/10/18 FLEX	2018年10月19日	(29,991)	(14,088)	15,903
EUR	(582,095)	C ISP IM 2.5087 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(19,233)	(15,596)	3,637
EUR	(582,095)	C ISP IM 2.6157 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(19,893)	(11,349)	8,544
EUR	(371,432)	C ISP IM 2.633 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(4,519)	(69)	4,450
EUR	(371,432)	C ISP IM 2.7871 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(13,915)	(3,919)	9,996
USD	(832)	C ITUB UN 11 19/10/18	2018年10月19日	(37,248)	(58,240)	(20,992)
USD	(743)	C ITUB UN 12 16/11/18	2018年11月16日	(45,522)	(44,580)	942
AUD	(32,618)	C JHX AT 22.4455 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(4,371)	(5,397)	(1,026)
AUD	(34,755)	C JHX AT 22.658 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(5,178)	(2,208)	2,970
AUD	(34,031)	C JHX AT 23.4508 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(6,289)	(468)	5,821
USD	(13)	C JPM UN 115 02/11/18	2018年11月2日	(2,554)	(2,470)	84
USD	(41)	C JPM UN 115 05/10/18	2018年10月5日	(9,212)	(1,886)	7,326
USD	(76)	C JPM UN 115 19/10/18	2018年10月19日	(26,317)	(10,260)	16,057
USD	(76)	C JPM UN 115 28/09/18	2018年9月28日	(20,701)	(304)	20,397
USD	(127)	C JPM UN 116 05/10/18	2018年10月5日	(19,274)	(3,048)	16,226
USD	(31)	C JPM UN 117 26/10/18	2018年10月26日	(4,922)	(2,976)	1,946
USD	(70)	C JPM UN 118 02/11/18	2018年11月2日	(15,609)	(6,160)	9,449
USD	(198)	C K UN 73.4 19/10/18 FLEX	2018年10月19日	(43,612)	(5,887)	37,725
USD	(90)	C K UN 73.5 26/10/18 FLEX	2018年10月26日	(13,929)	(4,161)	9,768
USD	(244)	C KR UN 30.5 02/11/18	2018年11月2日	(12,458)	(10,248)	2,210
USD	(88)	C KR UN 30.5 26/10/18	2018年10月26日	(4,168)	(2,816)	1,352
USD	(156)	C KR UN 31 16/11/18	2018年11月16日	(6,983)	(6,084)	899
USD	(31)	C LEA UN 160 19/10/18	2018年10月19日	(8,891)	(1,085)	7,806
USD	(64)	C LH UN 175 19/10/18	2018年10月19日	(14,257)	(8,576)	5,681
USD	(15,115)	C LKOD LI 71.51 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(4,573)	(68,674)	(64,101)
USD	(8,178)	C LKOD LI 73.2 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(7,911)	(40,153)	(32,242)
USD	(21,535)	C LKOD LI 74.31 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(12,888)	(82,896)	(70,008)
USD	(21,673)	C LKOD LI 75.56 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(19,740)	(47,084)	(27,344)
USD	(15,115)	C LKOD LI 77.04 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(13,951)	(37,529)	(23,578)
GBP	(1,899,432)	C LLOY LN 0.61942 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(6,424)	(2,605)	3,819
GBP	(1,994,403)	C LLOY LN 0.64582 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(20,186)	(9,299)	10,887
GBP	(2,007,279)	C LLOY LN 0.65323 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(21,316)	(1,678)	19,638
GBP	(1,899,432)	C LLOY LN 0.665 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(20,161)	(10,469)	9,692
AUD	(59,998)	C LNK AT 8.1089 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(7,976)	(3,465)	4,511

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	(115)	C LOW UN 109 05/10/18	2018年10月5日	(24,583)	(65,320)	(40,737)
USD	(9)	C LOW UN 111 12/10/18	2018年10月12日	(1,841)	(3,681)	(1,840)
USD	(3)	C LOW UN 115 26/10/18	2018年10月26日	(692)	(990)	(298)
USD	(34)	C LOW UN 116 02/11/18	2018年11月2日	(8,991)	(9,078)	(87)
USD	(2)	C MDT UN 100 19/10/18	2018年10月19日	(192)	(112)	80
USD	(10)	C MDT UN 95.01 05/10/18	FLEX 2018年10月5日	(1,718)	(3,473)	(1,755)
USD	(30)	C MDT UN 97 26/10/18	2018年10月26日	(3,893)	(6,720)	(2,827)
USD	(27)	C MDT UN 97.5 16/11/18	2018年11月16日	(4,638)	(6,777)	(2,139)
USD	(175)	C MDT UN 99.5 02/11/18	2018年11月2日	(24,284)	(24,675)	(391)
AUD	(344,069)	C MGR AT 2.5565 28/11/18 OTC	2018年11月28日	(5,702)	(3,462)	2,240
USD	(25)	C MPC UN 83 02/11/18	2018年11月2日	(4,844)	(14,500)	(9,656)
USD	(25)	C MPC UN 87.5 16/11/18	2018年11月16日	(4,544)	(3,300)	1,244
USD	(58)	C MPC UN 87.5 19/10/18	2018年10月19日	(8,106)	(3,596)	4,510
USD	(59)	C MPC UN 87.5 26/10/18	2018年10月26日	(10,859)	(8,319)	2,540
AUD	(7,419)	C MQG AT 132.1531 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(5,441)	(1,522)	3,919
USD	(57)	C MRO UN 21 19/10/18	2018年10月19日	(3,464)	(11,742)	(8,278)
USD	(155)	C MRO UN 21.5 26/10/18	2018年10月26日	(9,574)	(29,605)	(20,031)
USD	(5)	C MRO UN 22.5 05/10/18	2018年10月5日	(261)	(335)	(74)
USD	(27)	C MRO UN 22.5 12/10/18	2018年10月12日	(1,289)	(2,376)	(1,087)
USD	(74)	C MRO UN 23 02/11/18	2018年11月2日	(4,084)	(6,512)	(2,428)
USD	(79)	C MRO UN 23 16/11/18	2018年11月16日	(9,224)	(10,981)	(1,757)
USD	(5)	C MRO UN 23 19/10/18	2018年10月19日	(273)	(385)	(112)
GBP	(922,069)	C MRW LN 2.66917 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(40,377)	(23,520)	16,857
GBP	(588,520)	C MRW LN 2.67227 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(26,080)	(44,721)	(18,641)
GBP	(588,520)	C MRW LN 2.77123 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(9,187)	(108)	9,079
GBP	(913,450)	C MRW LN 2.78406 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(40,610)	(20,401)	20,209
USD	(23)	C MS UN 49 05/10/18	2018年10月5日	(2,111)	(184)	1,927
USD	(138)	C MS UN 49 16/11/18	2018年11月16日	(15,699)	(11,868)	3,831
USD	(57)	C MS UN 50 02/11/18	2018年11月2日	(4,832)	(3,876)	956
USD	(89)	C MS UN 50 05/10/18	2018年10月5日	(6,298)	(267)	6,031
USD	(145)	C MS UN 50 12/10/18	2018年10月12日	(11,123)	(1,305)	9,818
USD	(19)	C MS UN 50 28/09/18	2018年9月28日	(1,558)	(19)	1,539
USD	(106)	C NDAQ UN 90 19/10/18	2018年10月19日	(18,737)	(2,120)	16,617
USD	(114)	C NSC UN 180 19/10/18	2018年10月19日	(39,439)	(52,440)	(13,001)
AUD	(60,893)	C NST AT 8.8354 05/12/18 OTC	2018年12月5日	(7,810)	(20,068)	(12,258)
USD	(52)	C NUE UN 65 12/10/18	2018年10月12日	(4,789)	(2,444)	2,345
USD	(114)	C NUE UN 65 19/10/18	2018年10月19日	(15,028)	(8,436)	6,592
USD	(22,100)	C NVS UN 83.437 03/10/18	OTC 2018年10月3日	(34,897)	(67,799)	(32,902)
USD	(205)	C NVS UN 85 19/10/18	2018年10月19日	(32,342)	(46,125)	(13,783)
SGD	(200,000)	C OCB SP 12.0514 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(1,800)	(3,021)	(1,221)
USD	(159,176)	C OGZD LI 4.77 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(8,834)	(52,504)	(43,670)

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	(114,063)	C OGZD LI 4.81 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(4,346)	(31,788)	(27,442)
USD	(165,356)	C OGZD LI 4.81 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(9,376)	(35,755)	(26,379)
USD	(164,707)	C OGZD LI 4.86 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(3,344)	(22,207)	(18,863)
USD	(140,001)	C OGZD LI 5.26 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(8,610)	(15,938)	(7,328)
USD	(51)	C ORCL UN 49 19/10/18	2018年10月19日	(8,721)	(13,566)	(4,845)
USD	(120)	C ORCL UN 49 26/10/18	2018年10月26日	(14,852)	(35,400)	(20,548)
USD	(159)	C ORCL UN 50 05/10/18	2018年10月5日	(15,629)	(26,553)	(10,924)
USD	(40)	C ORCL UN 50 12/10/18	2018年10月12日	(3,217)	(7,920)	(4,703)
USD	(102)	C ORCL UN 50 16/11/18	2018年11月16日	(7,524)	(22,950)	(15,426)
USD	(40)	C ORCL UN 51 12/10/18	2018年10月12日	(2,285)	(4,720)	(2,435)
AUD	(115,715)	C OSH AT 9.2704 10/10/18 OTC	2018年10月10日	(10,763)	(4,448)	6,315
AUD	(81,131)	C OSH AT 9.4941 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(7,320)	(7,367)	(47)
AUD	(99,416)	C OSH AT 9.5159 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(5,756)	(2,210)	3,546
USD	(485)	C PBR UN 11 05/10/18	2018年10月5日	(24,621)	(58,200)	(33,579)
USD	(104)	C PCG UN 47 05/10/18	2018年10月5日	(14,059)	(1,560)	12,499
USD	(141)	C PCG UN 49 26/10/18	2018年10月26日	(15,799)	(6,063)	9,736
USD	(390)	C PFE UN 40.05 05/10/18 FLEX	2018年10月5日	(30,716)	(154,434)	(123,718)
USD	(390)	C PFE UN 40.15 12/10/18 FLEX	2018年10月12日	(30,716)	(151,479)	(120,763)
USD	(390)	C PFE UN 40.25 19/10/18 FLEX	2018年10月19日	(31,106)	(149,418)	(118,312)
USD	(126)	C PFE UN 41.69 26/10/18 FLEX	2018年10月26日	(11,562)	(31,852)	(20,290)
USD	(166)	C PFE UN 42 26/10/18	2018年10月26日	(14,403)	(35,856)	(21,453)
USD	(263)	C PFE UN 42.98 16/11/18 FLEX	2018年11月16日	(25,975)	(39,322)	(13,347)
USD	(102)	C PFE UN 43 02/11/18	2018年11月2日	(8,544)	(14,994)	(6,450)
USD	(158)	C PHG UN 42.63 28/09/18 FLEX	2018年9月28日	(17,027)	(44,545)	(27,518)
USD	(25,500)	C PHG UN 46.381 23/10/18 OTC	2018年10月23日	(23,654)	(13,274)	10,380
USD	(3,900)	C PKG UN 118.948 23/10/18 OTC	2018年10月23日	(7,992)	(1,100)	6,892
USD	(5)	C PM UN 82 05/10/18	2018年10月5日	(394)	(400)	(6)
USD	(5)	C PM UN 83.5 26/10/18	2018年10月26日	(534)	(745)	(211)
USD	(23)	C PM UN 83.5 28/09/18	2018年9月28日	(2,729)	(23)	2,706
USD	(6)	C PM UN 84.5 19/10/18	2018年10月19日	(557)	(450)	107
USD	(29)	C PPG UN 111 12/10/18	2018年10月12日	(7,439)	(5,220)	2,219
USD	(29)	C PRU UN 105 19/10/18	2018年10月19日	(6,450)	(1,160)	5,290
GBP	(204,101)	C PSON LN 10.31216 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(33,315)	(3,215)	30,100
GBP	(164,754)	C PSON LN 9.114 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(11,080)	(27,978)	(16,898)
GBP	(164,754)	C PSON LN 9.63924 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(28,002)	(31,604)	(3,602)
GBP	(172,991)	C PSON LN 9.64329 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(29,083)	(29,721)	(638)
GBP	(161,557)	C PSON LN 9.9717 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(24,963)	(11,561)	13,402
AUD	(82,482)	C QAN AT 6.8476 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(5,677)	(176)	5,501
AUD	(114,964)	C QAN AT 6.9342 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(7,605)	(1,153)	6,452
AUD	(146,581)	C QAN AT 7.0972 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(19,672)	(105)	19,567
USD	(188)	C QCOM UQ 67.5 19/10/18	2018年10月19日	(31,784)	(84,788)	(53,004)

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	(320)	C QCOM UQ 71 05/10/18	2018年10月5日	(34,499)	(41,600)	(7,101)
USD	(63)	C QCOM UQ 72 26/10/18	2018年10月26日	(12,522)	(13,860)	(1,338)
USD	(270)	C QCOM UQ 72.5 16/11/18	2018年11月16日	(71,505)	(67,500)	4,005
GBP	(543,197)	C RBS LN 2.59488 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(7,773)	(2,909)	4,864
GBP	(570,357)	C RBS LN 2.66856 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(23,238)	(26,229)	(2,991)
GBP	(570,357)	C RBS LN 2.68275 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(23,529)	(29,693)	(6,164)
GBP	(574,039)	C RBS LN 2.72813 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(24,384)	(2,624)	21,760
GBP	(543,197)	C RBS LN 2.90698 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(21,766)	(9,947)	11,819
USD	(33)	C RDSA UN 65 05/10/18	2018年10月5日	(4,746)	(16,005)	(11,259)
USD	(86)	C RDSA UN 65 19/10/18	2018年10月19日	(9,870)	(36,722)	(26,852)
USD	(59)	C RDSA UN 65 26/10/18	2018年10月26日	(5,341)	(12,744)	(7,403)
USD	(90)	C RDSA UN 65 28/09/18	2018年9月28日	(5,289)	(34,200)	(28,911)
USD	(99)	C RDSA UN 67.5 05/10/18	2018年10月5日	(5,323)	(17,325)	(12,002)
USD	(99)	C RDSA UN 67.5 12/10/18	2018年10月12日	(6,412)	(25,245)	(18,833)
USD	(58)	C RDSA UN 66 02/11/18	2018年11月2日	(7,874)	(25,636)	(17,762)
USD	(82)	C RDSA UN 67 02/11/18	2018年11月2日	(10,067)	(10,660)	(593)
AUD	(7,984)	C REA AT 91.5936 14/11/18 OTC	2018年11月14日	(3,935)	(6,482)	(2,547)
AUD	(9,795)	C REA AT 93.6815 05/12/18 OTC	2018年12月5日	(6,093)	(7,964)	(1,871)
AUD	(8,787)	C REA AT 93.7838 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(8,700)	(8)	8,692
AUD	(9,966)	C REA AT 95.4851 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(7,170)	(2,013)	5,157
EUR	(141,210)	C REP SQ 17.3858 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(34,912)	(75,488)	(40,576)
EUR	(100,864)	C REP SQ 17.4853 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(25,452)	(54,290)	(28,838)
EUR	(105,908)	C REP SQ 17.556 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(22,208)	(41,622)	(19,414)
EUR	(100,864)	C REP SQ 17.995 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(6,007)	(2,275)	3,732
USD	(290)	C RF UN 19 16/11/18	2018年11月16日	(13,852)	(12,180)	1,672
USD	(4,600)	C RF UN 19.329 30/10/18 OTC	2018年10月30日	(1,909)	(1,032)	877
USD	(15,000)	C RF UN 19.422 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(6,375)	(2,481)	3,894
USD	(106)	C RF UN 20 19/10/18	2018年10月19日	(3,473)	(318)	3,155
AUD	(12,196)	C RIO AT 77.7827 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(7,937)	(21,978)	(14,041)
AUD	(12,923)	C RIO AT 80.4704 10/10/18 OTC	2018年10月10日	(10,296)	(5,481)	4,815
EUR	(15,645)	C RR TL GY 64.9832 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(14,988)	(12,610)	2,378
EUR	(18,405)	C RR TL GY 66.5493 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(4,035)	(57)	3,978
EUR	(19,325)	C RR TL GY 66.5676 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(13,995)	(7,168)	6,827
EUR	(31,298)	C SAN FP 76.9615 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(30,530)	(72,329)	(41,799)
EUR	(27,820)	C SAN FP 76.9901 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(10,821)	(21,464)	(10,643)
EUR	(31,500)	C SAN FP 77.5528 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(31,476)	(32,236)	(760)
EUR	(31,298)	C SAN FP 77.7926 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(35,114)	(49,834)	(14,720)
EUR	(23,846)	C SAN FP 78.1505 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(24,069)	(45,478)	(21,409)
AUD	(129,016)	C SGR AT 5.7705 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(5,768)	(1,483)	4,285
AUD	(116,129)	C SGR AT 5.8492 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(6,851)	(1,887)	4,964
USD	(77)	C SJM UN 113.8 16/11/18 FLEX	2018年11月16日	(20,926)	(3,248)	17,678

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	(83)	C SJM UN 115 19/10/18	2018年10月19日	(11,123)	(1,245)	9,878
USD	(152)	C SLM UQ 12 19/10/18	2018年10月19日	(3,612)	(1,824)	1,788
CHF	(11,666)	C SREN SE 90.2765 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(13,374)	(26,356)	(12,982)
CHF	(11,110)	C SREN SE 90.5256 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(2,984)	(8,907)	(5,923)
CHF	(11,666)	C SREN SE 91.534 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(12,148)	(21,780)	(9,632)
CHF	(11,769)	C SREN SE 92.9067 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(12,194)	(6,200)	5,994
CHF	(11,110)	C SREN SE 93.5859 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(11,978)	(14,162)	(2,184)
GBP	(139,757)	C STAN LN 6.54733 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(3,345)	(4,704)	(1,359)
GBP	(146,745)	C STAN LN 6.75255 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(15,277)	(19,707)	(4,430)
GBP	(93,171)	C STAN LN 7.01892 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(9,210)	(7,942)	1,268
GBP	(146,745)	C STAN LN 7.03506 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(15,812)	(5,516)	10,296
GBP	(147,925)	C STAN LN 7.54208 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(17,726)	(48)	17,678
USD	(46)	C SU UN 40 12/10/18	2018年10月12日	(3,117)	(2,024)	1,093
USD	(18)	C SU UN 40 19/10/18	2018年10月19日	(968)	(1,008)	(40)
USD	(35)	C SU UN 40 26/10/18	2018年10月26日	(1,859)	(1,750)	109
USD	(20)	C SU UN 40.5 02/11/18	2018年11月2日	(1,415)	(1,880)	(465)
USD	(54)	C SU UN 40.5 19/10/18	2018年10月19日	(3,011)	(3,024)	(13)
USD	(16)	C SU UN 40.5 26/10/18	2018年10月26日	(908)	(928)	(20)
USD	(30)	C SU UN 41 09/11/18	2018年11月9日	(1,913)	(1,950)	(37)
USD	(54)	C SU UN 41 28/09/18	2018年9月28日	(4,161)	(108)	4,053
USD	(11)	C SU UN 42 05/10/18	2018年10月5日	(668)	(935)	(267)
USD	(27)	C SU UN 42 16/11/18	2018年11月16日	(1,560)	(1,107)	453
AUD	(67,041)	C SUN AT 15.1159 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(7,731)	(1,953)	5,778
AUD	(58,060)	C SUN AT 15.1267 05/12/18 OTC	2018年12月5日	(5,841)	(6,238)	(397)
AUD	(58,703)	C SUN AT 15.6477 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(10,392)	(1,367)	9,025
AUD	(62,258)	C SUN AT 15.9878 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(6,638)	(62)	6,576
GBP	(705,272)	C S32 LN 2.16115 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(8,257)	(22,145)	(13,888)
GBP	(475,785)	C S32 LN 2.16403 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(17,228)	(46,874)	(29,646)
GBP	(325,350)	C S32 LN 2.202 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(12,380)	(21,481)	(9,101)
GBP	(337,085)	C S32 LN 2.36488 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(13,612)	(1,906)	11,706
GBP	(512,209)	C S32 LN 2.45309 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(18,961)	(8,597)	10,364
AUD	(104,759)	C TAH AT 5.1889 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(3,201)	(3,183)	18
USD	(403)	C TAP UN 64 26/10/18	2018年10月26日	(54,837)	(36,270)	18,567
USD	(54)	C TAP UN 67.5 19/10/18	2018年10月19日	(9,755)	(540)	9,215
AUD	(89,966)	C TCL AT 11.6624 05/12/18 OTC	2018年12月5日	(8,106)	(9,307)	(1,201)
AUD	(65,432)	C TCL AT 12.2162 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(7,255)	(86)	7,169
AUD	(60,919)	C TCL AT 12.2174 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(5,276)	(433)	4,843
USD	(285)	C TDS UN 30 19/10/18	2018年10月19日	(33,563)	(21,375)	12,188
USD	(31,500)	C TDS UN 30.85 15/11/18 OTC	2018年11月15日	(44,116)	(49,287)	(5,171)
USD	(22,800)	C TDS UN 30.964 01/11/18 OTC	2018年11月1日	(11,430)	(27,107)	(15,677)
USD	(27,200)	C TDS UN 32.34 23/10/18 OTC	2018年10月23日	(10,222)	(15,537)	(5,315)

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(78,760)	C TPM AT 9.0102 21/11/18 OTC	2018年11月21日	(9,747)	(10,769)	(1,022)
GBP	(657,103)	C TSCO LN 2.5115 20/12/18 OTC	2018年12月20日	(26,853)	(36,613)	(9,760)
GBP	(837,112)	C TSCO LN 2.5407 06/12/18 OTC	2018年12月6日	(29,770)	(31,685)	(1,915)
GBP	(286,462)	C TSCO LN 2.54327 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(3,987)	(2,069)	1,918
GBP	(941,923)	C TSCO LN 2.69494 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(39,945)	(5,819)	34,126
GBP	(948,378)	C TSCO LN 2.70892 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(41,653)	(2,353)	39,300
SGD	(120,000)	C UOB SP 28.4395 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(3,204)	(5,768)	(2,564)
USD	(113)	C VLO UN 123 05/10/18	2018年10月5日	(28,562)	(3,051)	25,511
GBP	(370,981)	C VOD LN 1.84377 22/11/18 OTC	2018年11月22日	(10,837)	(1,187)	9,650
GBP	(373,376)	C VOD LN 1.90368 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(11,455)	(171)	11,284
USD	(85)	C VZ UN 54 28/09/18	2018年9月28日	(5,675)	(170)	5,505
USD	(281)	C VZ UN 55 02/11/18	2018年11月2日	(27,938)	(14,331)	13,607
USD	(123)	C VZ UN 55 12/10/18	2018年10月12日	(6,244)	(1,107)	5,137
USD	(222)	C VZ UN 55 19/10/18	2018年10月19日	(20,651)	(3,108)	17,543
USD	(84)	C VZ UN 56 26/10/18	2018年10月26日	(6,700)	(1,428)	5,272
USD	(134)	C WBA UQ 70.5 12/10/18	2018年10月12日	(12,189)	(56,280)	(44,091)
USD	(150)	C WBA UQ 73.5 26/10/18	2018年10月26日	(25,846)	(33,900)	(8,054)
AUD	(451)	C WBC AT 29 20/12/18	2018年12月20日	(17,554)	(8,301)	9,253
AUD	(456)	C WBC AT 29.01 29/11/18	2018年11月29日	(11,348)	(4,443)	6,905
AUD	(33,091)	C WBC AT 30.3668 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(10,093)	(209)	9,884
USD	(5)	C WFC UN 54.5 05/10/18	2018年10月5日	(240)	(45)	195
USD	(24)	C WFC UN 55 19/10/18	2018年10月19日	(2,160)	(864)	1,296
USD	(14)	C WFC UN 56 19/10/18	2018年10月19日	(837)	(280)	557
USD	(30)	C WFC UN 56.5 26/10/18	2018年10月26日	(2,423)	(1,200)	1,223
USD	(13)	C WFC UN 57 02/11/18	2018年11月2日	(1,063)	(546)	517
USD	(14)	C WFC UN 57 31/10/18 FLEX	2018年10月31日	(1,187)	(308)	879
USD	(14)	C WFC UN 57.5 16/11/18	2018年11月16日	(770)	(364)	406
USD	(20)	C WFC UN 58.5 12/10/18	2018年10月12日	(1,962)	(140)	1,822
USD	(70)	C WFC UN 59.5 05/10/18	2018年10月5日	(4,884)	(70)	4,814
USD	(74)	C WMB UN 28.5 19/10/18	2018年10月19日	(1,907)	(962)	945
USD	(74)	C WMB UN 28.5 26/10/18	2018年10月26日	(2,499)	(2,590)	(91)
USD	(55)	C WMB UN 29 02/11/18	2018年11月2日	(2,476)	(825)	1,651
USD	(54)	C WMB UN 29 19/10/18	2018年10月19日	(2,218)	(270)	1,948
USD	(22)	C WMB UN 29.5 26/10/18	2018年10月26日	(633)	(550)	83
USD	(64)	C WMB UN 30.5 28/09/18	2018年9月28日	(2,086)	(512)	1,574
USD	(303)	C WMB UN 31 28/09/18	2018年9月28日	(11,746)	(1,818)	9,928
AUD	(26,077)	C WOW AT 30.5001 31/10/18 OTC	2018年10月31日	(5,329)	(102)	5,227
AUD	(32,309)	C WOW AT 30.9275 24/10/18 OTC	2018年10月24日	(8,019)	(17)	8,002
AUD	(10,652)	C XRO AT 55.2901 14/11/18 OTC	2018年11月14日	(7,847)	(2,829)	5,018
USD	(184)	C ZBH UN 125 19/10/18	2018年10月19日	(66,747)	(122,728)	(55,981)
KRW	(7,000)	C 033780 KP 110663.928 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(1,469)	(3,641)	(2,172)

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
KRW	(17,000)	C 055550 KP 44783.94 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(1,023)	(12,157)	(11,134)
HKD	(120,000)	C 1 HK 97.2815 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(4,212)	(462)	3,750
HKD	(90,000)	C 1 HK 98.4293 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(2,637)	(165)	2,472
HKD	(90,000)	C 1038 HK 62.3489 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(1,134)	(8,372)	(7,238)
HKD	(100,000)	C 1038 HK 64.6275 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(630)	(591)	39
HKD	(700,000)	C 1288 HK 4.0041 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(630)	(306)	324
HKD	(50,000)	C 1299 HK 70.2776 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(670)	(4,417)	(3,747)
HKD	(60,000)	C 1299 HK 70.315 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(984)	(4,159)	(3,175)
HKD	(1,200,000)	C 1398 HK 5.9656 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(1,920)	(985)	935
HKD	(1,300,000)	C 1398 HK 6.0264 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(2,210)	(2,933)	(723)
HKD	(80,000)	C 16 HK 124.762 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(1,544)	(34)	1,510
HKD	(150,000)	C 16 HK 126.4788 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(3,585)	(196)	3,389
JPY	(2,500)	C 1878 JT 15507.8 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(751)	(1,265)	(514)
JPY	(12,000)	C 1925 JT 3420.5588 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(385)	(1,264)	(879)
JPY	(20,000)	C 1928 JT 1771.2918 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(448)	(1,643)	(1,195)
JPY	(22,000)	C 1928 JT 1804.12 10/10/18 OTC	2018年10月10日	(535)	(754)	(219)
TWD	(150,000)	C 2317 TT 80.56 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(1,185)	(2,903)	(1,718)
TWD	(400,000)	C 2317 TT 80.785 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(2,360)	(7,378)	(5,018)
TWD	(450,000)	C 2317 TT 83.5408 26/10/18 OTC	2018年10月26日	(3,240)	(5,738)	(2,498)
TWD	(250,000)	C 2330 TT 281.4707 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(5,450)	(5,337)	113
TWD	(300,000)	C 2330 TT 281.9143 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(5,790)	(4,407)	1,383
TWD	(500,000)	C 2330 TT 286.038 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(7,350)	(4,262)	3,088
HKD	(130,000)	C 2388 HK 39.3548 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(1,092)	(189)	903
HKD	(270,000)	C 2388 HK 40.3845 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(1,674)	(2,521)	(847)
TWD	(860,000)	C 2882 TT 55.44 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(1,806)	(8,787)	(6,981)
TWD	(940,000)	C 2882 TT 55.7042 15/10/18 OTC	2018年10月15日	(1,598)	(7,600)	(6,002)
JPY	(16,000)	C 2914 JT 3124.88 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(752)	(931)	(179)
JPY	(17,000)	C 2914 JT 3156.2259 22/10/18 OTC	2018年10月22日	(756)	(1,068)	(312)
JPY	(10,000)	C 2914 JT 3172.05 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(373)	(12)	361
JPY	(6,000)	C 3382 JT 5338.2 10/10/18 OTC	2018年10月10日	(516)	(121)	395
TWD	(400,000)	C 3711 TT 79.812 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(2,520)	(11,511)	(8,991)
HKD	(350,000)	C 386 HK 8.4885 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(1,190)	(804)	386
HKD	(550,000)	C 386 HK 8.658 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(1,100)	(1,318)	(218)
HKD	(1,400,000)	C 3988 HK 3.6867 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(980)	(52)	928
JPY	(40,000)	C 4188 JT 1094.075 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(619)	(6,643)	(6,024)
JPY	(6,000)	C 4452 JT 9724.6629 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(871)	(1,199)	(328)
JPY	(7,000)	C 4502 JT 4890.97 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(431)	(3,049)	(2,618)
JPY	(12,000)	C 4502 JT 5264.7 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(1,026)	(1,589)	(563)
JPY	(27,000)	C 4503 JT 2029.255 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(460)	(3,033)	(2,573)
JPY	(20,000)	C 4503 JT 2153.91 15/10/18 OTC	2018年10月15日	(394)	(164)	230
JPY	(6,000)	C 4519 JT 7343.875 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(611)	(4,225)	(3,614)

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	(7,000)	C 4568 JT 4888.1124 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(739)	(4,614)	(3,875)
JPY	(60,000)	C 5020 JT 810.909 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(794)	(25,989)	(25,195)
JPY	(60,000)	C 5020 JT 878.121 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(1,314)	(8,009)	(6,695)
JPY	(60,000)	C 5020 JT 923.6025 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(1,600)	(2,568)	(968)
JPY	(13,000)	C 6301 JT 3237.3 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(490)	(25,128)	(24,638)
JPY	(12,000)	C 6301 JT 3285.1783 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(753)	(18,562)	(17,809)
JPY	(15,000)	C 6301 JT 3288.11 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(952)	(22,641)	(21,689)
JPY	(10,000)	C 6501 JT 3795.9320 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(503)	(7,975)	(7,472)
JPY	(12,000)	C 6501 JT 3855.21 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(574)	(7,128)	(6,554)
JPY	(22,000)	C 6503 JT 1665.9407 15/10/18 OTC	2018年10月15日	(421)	(731)	(310)
JPY	(22,000)	C 6503 JT 1705.561 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(424)	(437)	(13)
JPY	(20,000)	C 6724 JT 2119.3122 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(483)	(670)	(187)
JPY	(27,000)	C 6752 JT 1326.06 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(546)	(3,726)	(3,180)
JPY	(3,000)	C 6981 JT 19921 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(1,299)	(326)	973
JPY	(45,000)	C 7201 JT 1081.6 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(294)	(1,469)	(1,175)
JPY	(40,000)	C 7201 JT 1086.135 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(264)	(537)	(273)
JPY	(45,000)	C 7201 JT 1129.92 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(295)	(538)	(243)
JPY	(25,000)	C 7202 JT 1942.7615 18/10/18 OTC	2018年10月18日	(592)	(414)	178
JPY	(7,000)	C 7203 JT 7446.13 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(561)	(1,441)	(880)
JPY	(8,000)	C 7203 JT 7647.48 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(653)	(833)	(180)
JPY	(60,000)	C 7211 JT 850.8431 15/10/18 OTC	2018年10月15日	(581)	(2,009)	(1,428)
JPY	(45,000)	C 7211 JT 869.597 18/10/18 OTC	2018年10月18日	(798)	(926)	(128)
JPY	(10,000)	C 7267 JT 3659.04 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(302)	(308)	(6)
JPY	(15,000)	C 7270 JT 3355.0802 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(596)	(17,108)	(16,512)
JPY	(15,000)	C 7270 JT 3661.2832 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(819)	(1,548)	(729)
JPY	(10,000)	C 7751 JT 3673.96 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(342)	(1,022)	(680)
JPY	(24,000)	C 8001 JT 2079 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(384)	(4,758)	(4,374)
JPY	(20,000)	C 8001 JT 2091.9756 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(360)	(1,984)	(1,624)
JPY	(15,000)	C 8001 JT 2184 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(305)	(361)	(56)
JPY	(18,000)	C 8031 JT 1881.6 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(289)	(22,042)	(21,753)
JPY	(22,000)	C 8031 JT 1969.8 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(259)	(10,764)	(10,505)
JPY	(20,000)	C 8053 JT 1880.6591 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(388)	(4,801)	(4,413)
JPY	(12,000)	C 8058 JT 3345.36 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(238)	(16,678)	(16,440)
JPY	(14,000)	C 8058 JT 3361.05 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(483)	(17,766)	(17,283)
JPY	(15,000)	C 8058 JT 3486.9471 15/10/18 OTC	2018年10月15日	(706)	(9,093)	(8,387)
JPY	(10,000)	C 8058 JT 3528.74 18/10/18 OTC	2018年10月18日	(595)	(4,708)	(4,113)
JPY	(12,000)	C 8058 JT 3791.02 22/10/18 OTC	2018年10月22日	(406)	(479)	(73)
JPY	(70,000)	C 8306 JT 715.924 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(339)	(2,535)	(2,196)
JPY	(80,000)	C 8306 JT 717.12 03/10/18 OTC	2018年10月3日	(571)	(3,140)	(2,569)
JPY	(60,000)	C 8306 JT 719.496 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(287)	(2,295)	(2,008)
JPY	(70,000)	C 8306 JT 722.92 05/10/18 OTC	2018年10月5日	(555)	(2,414)	(1,859)

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(55,000)	C 8306 JT 772.632 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(453)	(408)	45
JPY	(9,000)	C 8316 JT 4550.58 02/10/18 OTC	2018年10月2日	(277)	(4,855)	(4,578)
JPY	(10,000)	C 8316 JT 4906.74 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(652)	(673)	(21)
JPY	(13,000)	C 8316 JT 4933.44 23/10/18 OTC	2018年10月23日	(685)	(1,228)	(543)
JPY	(10,000)	C 8316 JT 4960.44 22/10/18 OTC	2018年10月22日	(610)	(700)	(90)
JPY	(9,000)	C 8766 JT 5521.4244 16/10/18 OTC	2018年10月16日	(581)	(14,246)	(13,665)
JPY	(9,000)	C 8766 JT 5693.47 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(727)	(7,455)	(6,728)
JPY	(9,000)	C 8766 JT 5971.67 17/10/18 OTC	2018年10月17日	(445)	(1,352)	(907)
HKD	(250,000)	C 883 HK 16.24 10/10/18 OTC	2018年10月10日	(1,625)	(2,901)	(1,276)
HKD	(350,000)	C 883 HK 16.539 18/10/18 OTC	2018年10月18日	(1,400)	(4,809)	(3,409)
JPY	(8,000)	C 9201 JT 4155.036 09/10/18 OTC	2018年10月9日	(429)	(2,006)	(1,577)
HKD	(1,300,000)	C 939 HK 7.1654 04/10/18 OTC	2018年10月4日	(2,210)	(650)	1,560
HKD	(2,200,000)	C 939 HK 7.2741 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(3,300)	(2,975)	325
JPY	(8,000)	C 9432 JT 5495.04 12/10/18 OTC	2018年10月12日	(295)	(159)	136
JPY	(9,000)	C 9432 JT 5605.2 25/10/18 OTC	2018年10月25日	(579)	(370)	209
JPY	(9,000)	C 9432 JT 5618.16 23/10/18 OTC	2018年10月23日	(498)	(270)	228
JPY	(12,000)	C 9433 JT 3279.15 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(534)	(666)	(132)
JPY	(12,000)	C 9433 JT 3294.8189 19/10/18 OTC	2018年10月19日	(491)	(1,163)	(672)
JPY	(13,000)	C 9437 JT 3170.96 11/10/18 OTC	2018年10月11日	(282)	(611)	(329)
JPY	(17,000)	C 9437 JT 3255.2855 22/10/18 OTC	2018年10月22日	(459)	(579)	(120)
JPY	(15,000)	C 9437 JT 3264.57 23/10/18 OTC	2018年10月23日	(403)	(483)	(80)
				(5,798,208)	(7,042,415)	(1,244,207)
				(5,798,208)	(7,042,415)	(1,244,207)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日2019年8月19日）

作成対象期間（2018年8月21日～2019年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		騰落	中率			
	円		%	%	%	百万円
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
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458

*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

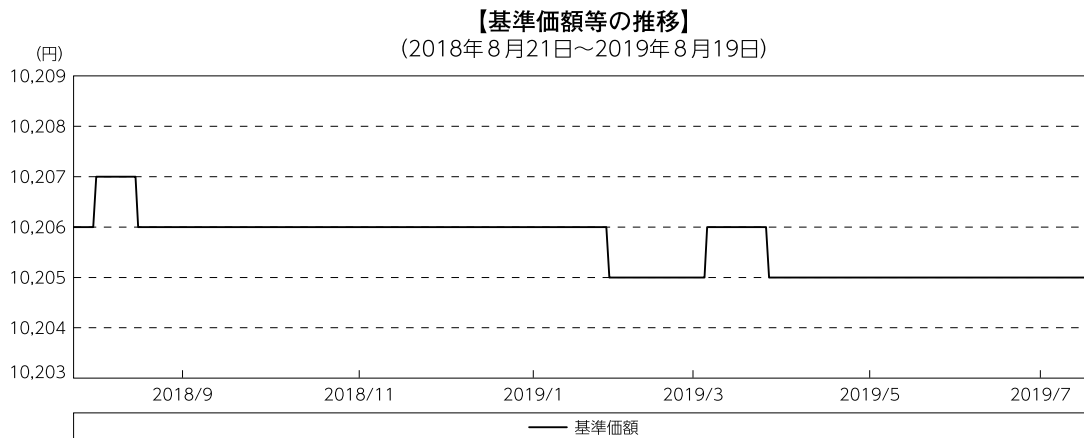
年月日	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰落	率			
(期首) 2018年8月20日	円		%	%	%	%
	10,206		—	38.7	—	—
8月末	10,207		0.0	40.6	—	—
9月末	10,206		0.0	52.5	—	—
10月末	10,206		0.0	53.1	—	—
11月末	10,206		0.0	41.5	—	—
12月末	10,206		0.0	51.0	—	—
2019年1月末	10,206		0.0	51.1	—	—
2月末	10,205		△0.0	55.7	—	—
3月末	10,205		△0.0	64.2	—	—
4月末	10,205		△0.0	54.0	—	—
5月末	10,205		△0.0	65.5	—	—
6月末	10,205		△0.0	61.8	—	—
7月末	10,205		△0.0	57.8	—	—
(期末) 2019年8月19日	10,205		△0.0	59.3	—	—

*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いたものの、海外経済の減速から輸出や生産に弱含みの動きもみられました。

このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2019年4月には「政策金利のフォワードガイダンス」をより明確に示すため、少なくとも2020年春頃まで現在のきわめて低い長短金利の水準を維持することとしました。

マイナス金利政策のもと、T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、2018年9月まで概ね-0.1%台で推移し、10月以降は良好な円調達環境を受け海外投資家等により買込まれ-0.3%台まで低下、その後期末にかけては-0.1%台まで上昇しました。また、無担保コール翌日物金利は期を通して概ね-0.06～-0.07%程度で推移しました。

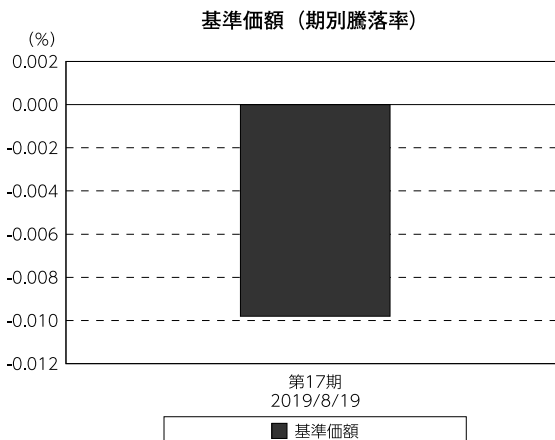
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債やコマーシャル・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

(2018年8月21日～2019年8月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2018年8月21日～2019年8月19日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	6,812,723	6,812,701
	地方債証券	2,994,475	—
内	特殊債券	5,906,659	—
	社債券（投資法人債券を含む）	11,495,778	—
			(2,452,000)
			(7,940,000)
			(10,167,000)

*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
内	コマーシャル・ペーパー	4,699,986	—
			(8,600,000)

*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

(2018年8月21日～2019年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
		百万円	%		百万円	百万円
公社債	百万円 20,396	百万円 1,141	% 5.6	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證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2019年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	1,156,000 (1,156,000)	1,157,903 (1,157,903)	13.7 (13.7)	— (—)	— (—)	— (—)	13.7 (13.7)
特殊債券 (除く金融債)	700,000 (700,000)	700,671 (700,671)	8.3 (8.3)	— (—)	— (—)	— (—)	8.3 (8.3)
金融債券	350,000 (350,000)	350,021 (350,021)	4.1 (4.1)	— (—)	— (—)	— (—)	4.1 (4.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	2,800,000 (2,800,000)	2,804,925 (2,804,925)	33.2 (33.2)	— (—)	— (—)	— (—)	33.2 (33.2)
合 計	5,006,000 (5,006,000)	5,013,521 (5,013,521)	59.3 (59.3)	— (—)	— (—)	— (—)	59.3 (59.3)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	
		千 円	千 円	償 還 年 月 日
地方債証券	%			
大阪府 公募第330回	1.48	116,000	116,173	2019/9/27
大阪府 公募第331回	1.41	100,000	100,269	2019/10/29
兵庫県 公募平成21年度第23回	1.37	100,000	100,218	2019/10/18
静岡県 公募平成21年度第4回	1.56	100,000	100,007	2019/8/20
静岡県 公募平成21年度第5回	1.35	100,000	100,222	2019/10/18
広島県 公募平成21年度第3回	1.41	140,000	140,196	2019/9/25
福岡県 公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,016	2019/9/26
岐阜県 公募平成21年度第1回	1.35	100,000	100,256	2019/10/28
共同発行市場地方債 公募第79回	1.34	100,000	100,246	2019/10/25
広島市 公募平成21年度第2回	1.35	100,000	100,262	2019/10/29
鹿児島県 公募(5年)平成26年度第1回	0.153	100,000	100,034	2019/10/31
小 計		1,156,000	1,157,903	
特殊債券(除く金融債)				
日本政策投資銀行社債 財投機関債第46回	0.219	100,000	100,020	2019/9/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第67回	0.001	100,000	100,000	2019/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第53回	1.38	400,000	400,478	2019/9/20
国際協力銀行債券 第16回財投機関債	2.07	100,000	100,172	2019/9/20
小 計		700,000	700,671	
金融債券				
商工債券 利付第771回い号	0.2	350,000	350,021	2019/8/27
小 計		350,000	350,021	
普通社債券(含む投資法人債券)				
中部電力 第492回	1.405	350,000	350,881	2019/10/25
東北電力 第452回	1.405	100,000	100,489	2019/12/25
九州電力 第423回	0.959	100,000	100,093	2019/9/25
北海道電力 第319回	0.514	550,000	550,281	2019/9/25
三菱東京UFJ銀行 第110回特定社債間限定同順位特約付	1.485	400,000	400,898	2019/10/16
三菱UFJリース 第26回社債間限定同順位特約付	0.441	200,000	200,224	2019/11/21
三井不動産 第37回社債間限定同順位特約付	1.493	100,000	100,484	2019/12/20
東京急行電鉄 第69回社債間限定同順位特約付	1.7	200,000	200,594	2019/10/25
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	1.875	600,000	600,959	2019/9/20
電源開発 第28回社債間限定同順位特約付	1.474	200,000	200,017	2019/8/20
小 計		2,800,000	2,804,925	
合 計		5,006,000	5,013,521	

*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
	千 円	%
コマーシャル・ペーパー	499,996	5.9

*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

(2019年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	5,013,521	59.3
その他有価証券	499,996	5.9
コール・ローン等、その他	2,944,648	34.8
投資信託財産総額	8,458,165	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 (2019年8月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,458,165,584
コール・ローン等	2,925,096,627
公社債(評価額)	5,013,521,293
その他有価証券	499,996,087
未収利息	7,780,208
前払費用	11,771,369
(B) 負債	4,506
未払利息	4,506
(C) 純資産総額(A-B)	8,458,161,078
元本	8,288,568,727
次期繰越損益金	169,592,351
(D) 受益権総口数	8,288,568,727口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,205円

(注) 期首元本額は13,238,234,160円、期中追加設定元本額は505,769,218円、期中一部解約元本額は5,455,434,651円、1口当たり純資産額は1.0205円です。

○損益の状況 (2018年8月21日～2019年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	46,233,836
受取利息	48,231,124
支払利息	△ 1,997,288
(B) 有価証券売買損益	△ 48,206,310
売買損	△ 48,206,310
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,972,474
(D) 前期繰越損益金	273,342,594
(E) 追加信託差損益金	10,418,721
(F) 解約差損益金	△112,196,490
(G) 計(C+D+E+F)	169,592,351
次期繰越損益金(G)	169,592,351

*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)	5,129,840,665
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)	2,050,866,611
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)	424,221,200
野村世界高金利通貨投信	151,953,753
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	104,556,769
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	96,909,215
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623
ネクストコア	19,922,154

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	10,607,461
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第12回 野村短期公社債ファンド	6,664,982
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネーボールファンド)年2回決算型	2,551,759
野村新エマージング債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	2,513,115
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729

ファンド名	当期末
	元本額
	円
第10回 野村短期公社債ファンド	1,959,728
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	1,230,043
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村グローバルCB投信(マネーボールファンド)年2回決算型	996,807
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信(毎月分配型)	982,608
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 年2回決算型	980,297
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	946,340
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	774,485
第7回 野村短期公社債ファンド	686,093
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース) 毎月分配型	315,476
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 毎月分配型	277,875
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース) 年2回決算型	253,829
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	213,673
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 年2回決算型	118,445
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
ノムラ 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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 毎月分配型	54,497
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型	51,703
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 年2回決算型	43,905
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型	41,316
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 年2回決算型	36,381
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,805
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 ブラジルレアル毎月分配型	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
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	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信(ユーロコース) 年2回決算型	4,908
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 毎月分配型	1,813

〇お知らせ

該当事項はございません。

<お申し込み時の留意点>

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

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

(2019年11月18日現在)

年 月	日
2019年11月	28
12月	24、25、26

※2019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。