

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54期(決算日2016年6月17日) 第55期(決算日2016年7月19日) 第56期(決算日2016年8月17日)
第57期(決算日2016年9月20日) 第58期(決算日2016年10月17日) 第59期(決算日2016年11月17日)

作成対象期間(2016年5月18日～2016年11月17日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/株式	
信託期間	2011年11月18日から2021年11月17日(当初、2016年11月17日)までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー・マザーファンド受益証券を通じて、世界の高配当利回り株式(以下、「高配当株」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス受益証券および野村マネー・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス	世界の高配当株を主要投資対象とします。加えて、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用します。
主な投資制限	野村マネー・マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への直接投資は行いません。
分配方針	野村マネー・マザーファンド	株式への投資は行いません。
	毎決算時に、原則として、配当等収益等を中心に安定分配を行うことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合や安定分配とならない場合があります。なお、毎年5月および11月の決算時には、安定分配相当額に委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。「原則として、配当等収益等を中心に安定分配を行う」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			債組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		税分	込配	み騰落				
	円	円	%					百万円
30期(2014年6月17日)	12,512		240	1.5	0.0	—	98.6	69,890
31期(2014年7月17日)	12,441		240	1.4	0.0	—	98.6	85,977
32期(2014年8月18日)	12,027		240	△ 1.4	0.0	—	98.4	96,332
33期(2014年9月17日)	12,278		240	4.1	0.0	—	98.4	121,629
34期(2014年10月17日)	10,897		240	△ 9.3	0.0	—	98.7	141,383
35期(2014年11月17日)	12,330		240	15.4	0.0	—	98.6	201,364
36期(2014年12月17日)	11,158		240	△ 7.6	0.0	—	98.5	226,330
37期(2015年1月19日)	11,440		240	4.7	0.0	—	98.6	267,040
38期(2015年2月17日)	11,719		240	4.5	0.0	—	97.8	319,049
39期(2015年3月17日)	11,147		240	△ 2.8	0.0	—	98.8	344,803
40期(2015年4月17日)	11,332		200	3.5	0.0	—	98.4	380,070
41期(2015年5月18日)	11,180		200	0.4	0.0	—	98.9	392,377
42期(2015年6月17日)	10,822		200	△ 1.4	0.0	—	98.9	399,399
43期(2015年7月17日)	10,924		200	2.8	0.0	—	98.8	414,980
44期(2015年8月17日)	9,988		200	△ 6.7	0.0	—	98.9	385,130
45期(2015年9月17日)	8,552		200	△ 12.4	0.0	—	98.9	332,014
46期(2015年10月19日)	8,667		200	3.7	0.0	—	98.8	338,966
47期(2015年11月17日)	8,472		200	0.1	0.0	—	98.9	333,021
48期(2015年12月17日)	7,962		200	△ 3.7	0.0	—	98.3	311,483
49期(2016年1月18日)	6,738		200	△ 12.9	0.0	—	98.8	263,335
50期(2016年2月17日)	6,307		200	△ 3.4	0.0	—	98.9	245,049
51期(2016年3月17日)	6,751		150	9.4	0.0	—	98.1	263,714
52期(2016年4月18日)	6,751		150	2.2	0.0	—	99.1	260,200
53期(2016年5月17日)	6,346		150	△ 3.8	0.0	—	98.9	243,812
54期(2016年6月17日)	5,751		150	△ 7.0	0.0	—	98.8	218,813
55期(2016年7月19日)	6,298		100	11.3	0.0	—	98.1	237,324
56期(2016年8月17日)	6,092		100	△ 1.7	0.0	—	99.2	223,602
57期(2016年9月20日)	5,865		100	△ 2.1	0.0	—	99.0	208,113
58期(2016年10月17日)	6,142		50	5.6	0.0	—	98.4	214,111
59期(2016年11月17日)	6,171		50	1.3	0.0	—	98.7	203,635

* 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 証 組 入 比 率	信 託 券 率
		騰 落 率	騰 落 率				
第54期	(期 首)	円	%	%	%	%	%
	2016年 5月17日	6,346	—	0.0	—	—	98.9
	5月末	6,470	2.0	0.0	—	—	99.0
	(期 末)						
第55期	2016年 6月17日	5,901	△ 7.0	0.0	—	—	98.8
	(期 首)						
	2016年 6月17日	5,751	—	0.0	—	—	98.8
	6月末	5,846	1.7	0.0	—	—	99.0
第56期	(期 末)						
	2016年 7月19日	6,398	11.3	0.0	—	—	98.1
	(期 首)						
	2016年 7月19日	6,298	—	0.0	—	—	98.1
第57期	7月末	6,190	△ 1.7	0.0	—	—	99.0
	(期 末)						
	2016年 8月17日	6,192	△ 1.7	0.0	—	—	99.2
	(期 首)						
第58期	2016年 8月17日	6,092	—	0.0	—	—	99.2
	8月末	6,105	0.2	0.0	—	—	99.0
	(期 末)						
	2016年 9月20日	5,965	△ 2.1	0.0	—	—	99.0
第59期	(期 首)						
	2016年 9月20日	5,865	—	0.0	—	—	99.0
	9月末	6,043	3.0	0.0	—	—	99.2
	(期 末)						
第59期	2016年10月17日	6,192	5.6	0.0	—	—	98.4
	(期 首)						
	2016年10月17日	6,142	—	0.0	—	—	98.4
	10月末	6,246	1.7	0.0	—	—	99.0
第59期	(期 末)						
	2016年11月17日	6,221	1.3	0.0	—	—	98.7

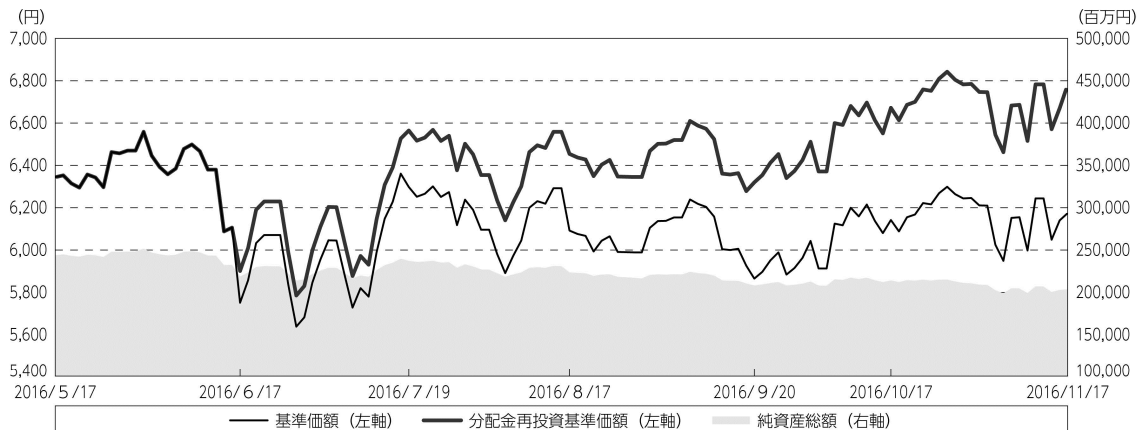
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第54期首：6,346円

第59期末：6,171円（既払分配金（税込み）：550円）

騰落率：6.5%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2016年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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、当作成期首6,346円から当作成期末には6,171円となりました。

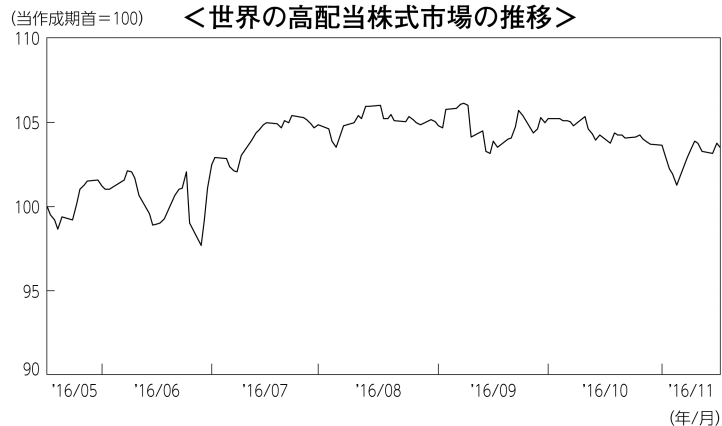
- ・実質的に投資している世界の高配当利回り株式（以下、「高配当株」といいます。）からのインカムゲイン（配当等収益）
- ・実質的に投資している世界の高配当株からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・実質的に保有する高配当株式の銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す『株式プレミアム戦略』による、オプションのプレミアム収入（またはオプションにおける支払い）
- ・円／選定通貨※の為替変動

※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）

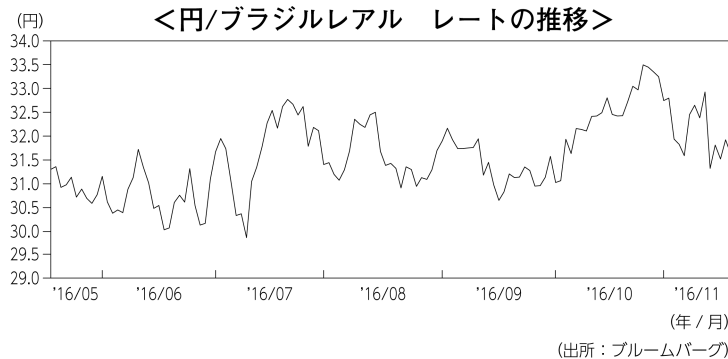
世界の高配当株式市場は、英国の国民投票においてEU（欧州連合）離脱が選択され、投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ懸念が高まったことなどから下落する場面もありましたが、世界経済の先行き不透明感を背景に、日銀やECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持するとの期待が高まったことや、FRBによる利上げが緩やかなものになるとの見方が強まったことなどから、当作成期間では値上がりとなりました。

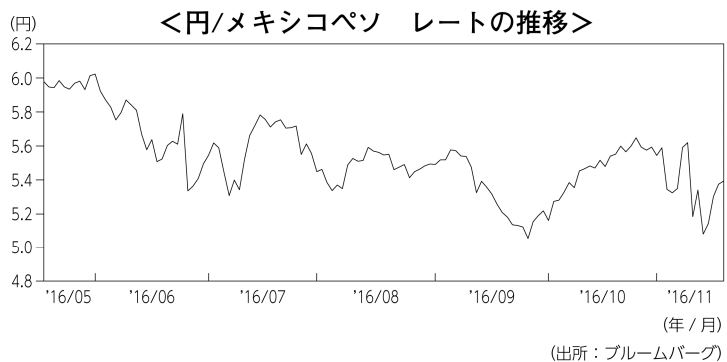
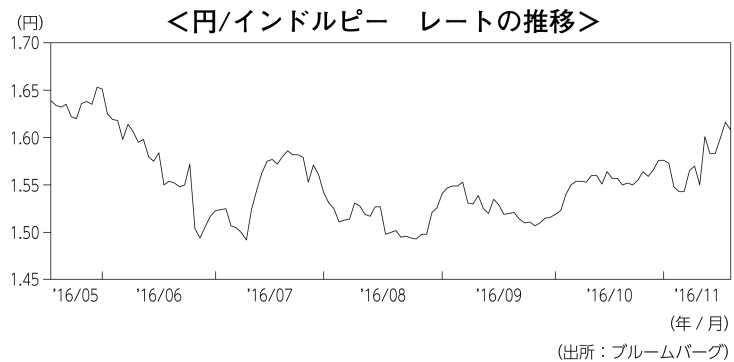
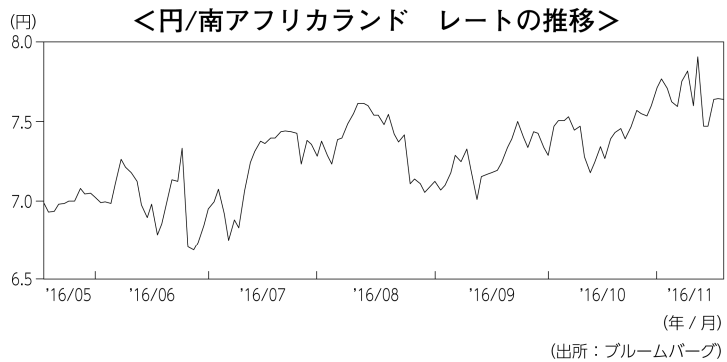
●MSCIワールド・ハイ・ディビデンド・イールド・インデックスはMSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。また、MSCIは同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

＜為替レート＞

2016年6月に英国で行われた国民投票において、EUからの離脱に対する支持が過半数を超える結果となったことなどから世界的な成長鈍化が意識され、米利上げ期待が後退しました。また、資源価格が上昇基調で推移する中で、南アフリカランドなどの新興国通貨が堅調に推移しました。一方で、同年11月に行われた米大統領選挙において、財政支出拡大や移民排斥、貿易協定見直しを掲げるトランプ氏が勝利したことを受け、インフレ期待が上昇し、米利上げ期待も高まった他、新興国通貨が軟調に推移しました。ブラジルでは、同年8月に上院で行なわれた罷免投票によりルセフ大統領が失職しました。テメル新政権が財政再建と経済改革に意欲的な姿勢を示したことが好感され、政府支出の伸び率を前年のインフレ率以下に抑える歳出上限法案が下院で可決されるなど、政策遂行能力に期待が集まりました。貿易黒字が定着し、経常赤字が減少傾向であるなど、一部の経済指標が改善を示しつつある点や他通貨に比べ相対的に高い金利水準であることなども、通貨を下支えしました。一方、トルコでは大統領の権限強化を柱とする憲法改正案の推進、同年7月に起きたクーデター未遂事件後の大規模な粛清やメディア統制、非常事態宣言の延長などが嫌気され、通貨は軟調に推移しました。

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





○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	92.4%
カバー率	44.1%
平均行使価格	105.1%
平均行使期間	38.5日
配当利回り（年率、米ドル為替取引後ベース）*	3.3%
プレミアム（年率）	4.1%

- ・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30.6%、欧州32.7%、アジア・太平洋29.1%となりました。同ポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、金融30.0%、生活必需品15.1%、通信9.1%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・マーケッツ・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ（基礎的諸条件）、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定し、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、原則として実質的に米ドルを売り各選定通貨を買う為替取引を行いました。選定通貨は定期的に見直しを行いました。当作成期末時点ではブラジルレアル、トルコリラ、南アフリカランド、インドルピー、メキシコペソを選定しています。

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

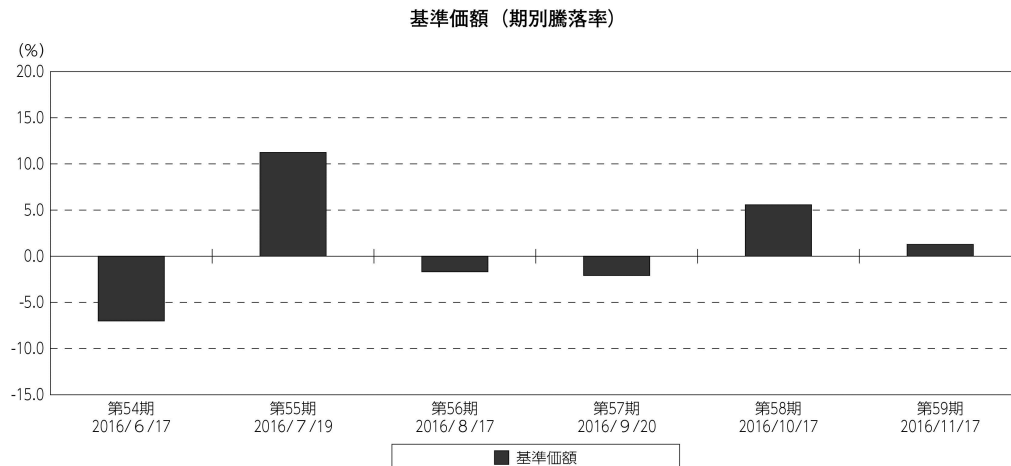
[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

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

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年5月18日～ 2016年6月17日	2016年6月18日～ 2016年7月17日	2016年7月20日～ 2016年8月17日	2016年8月18日～ 2016年9月20日	2016年9月21日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月17日
当期分配金	150	100	100	100	50	50
(対基準価額比率)	2.542%	1.563%	1.615%	1.676%	0.807%	0.804%
当期の収益	150	100	100	100	50	50
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	7,770	7,897	7,938	7,966	7,989	8,009

(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。

[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図る運用を行なう方針です。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化の動きについて

店頭デリバティブ取引に関して、将来、国際的に規制の強化等が予定されています。ファンドが投資対象とする外国投資信託が原則として活用する店頭デリバティブ取引（オプション、NDFおよびNDO等を含みます。）が当該規制強化等の対象取引となり、かつ、当該取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合、当該現金等を資産の一部として追加的に保有することとなります。その場合、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2016年5月18日～2016年11月17日)

項 目	第54期～第59期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 29	% 0.479	(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 ）	(12)	(0.191)	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 ）	(17)	(0.272)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	29	0.481	
作成期間の平均基準価額は、6,150円です。			

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

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月18日～2016年11月17日)

投資信託証券

銘 柄		第54期～第59期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	口	千円	口	千円	
	1,428,745	5,926,735	6,774,150	27,671,722	

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月18日～2016年11月17日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型>

該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区 分	第54期～第59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 23,989	百万円 1,633	% 6.8	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

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

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

○組入資産の明細

(2016年11月17日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	第53期末	第59期末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 通貨セレクトクラス	口 54,037,944	口 48,692,539	千円 200,905,415	% 98.7
合 計	54,037,944	48,692,539	200,905,415	98.7

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘	柄	第53期末		第59期末		
		口	数	口	数	評 価 額
野村マネー マザーファンド			千口 983		千口 983	千円 1,003

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年11月17日現在)

項	目	第59期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
投資信託受益証券		200,905,415	97.2
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		5,700,484	2.8
投資信託財産総額		206,606,902	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54期末	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末
		2016年6月17日現在	2016年7月19日現在	2016年8月17日現在	2016年9月20日現在	2016年10月17日現在	2016年11月17日現在
		円	円	円	円	円	円
(A) 資産		225,683,977,367	241,987,609,783	228,491,562,519	213,049,598,933	217,172,012,379	206,606,902,377
	コール・ローン等	8,632,466,464	8,671,620,502	6,673,152,917	6,183,860,078	6,395,534,240	3,906,178,326
	投資信託受益証券(評価額)	216,194,025,440	232,834,074,995	221,817,405,768	206,036,074,496	210,775,474,404	200,905,415,914
	野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,834	1,003,834	1,003,834	1,003,834	1,003,735	1,003,735
	未収入金	856,481,629	480,910,452	-	828,660,525	-	1,794,304,402
(B) 負債		6,870,051,975	4,663,528,716	4,889,443,764	4,936,141,142	3,060,693,386	2,971,417,561
	未払収益分配金	5,707,407,483	3,768,290,187	3,670,298,826	3,548,533,697	1,742,968,784	1,649,948,215
	未払解約金	964,909,133	706,520,884	1,045,429,320	1,193,622,578	1,168,215,286	1,152,777,422
	未払信託報酬	197,050,749	188,064,847	173,115,881	193,315,669	148,993,361	168,114,082
	未払利息	12,858	11,679	9,578	10,178	8,030	4,739
	その他未払費用	671,752	641,119	590,159	659,020	507,925	573,103
(C) 純資産総額(A-B)		218,813,925,392	237,324,081,067	223,602,118,755	208,113,457,791	214,111,318,993	203,635,484,816
	元本	380,493,832,261	376,829,018,701	367,029,882,665	354,853,369,755	348,593,756,846	329,989,643,155
	次期繰越損益金	△161,679,906,869	△139,504,937,634	△143,427,763,910	△146,739,911,964	△134,482,437,853	△126,354,158,339
(D) 受益権総口数		380,493,832,261口	376,829,018,701口	367,029,882,665口	354,853,369,755口	348,593,756,846口	329,989,643,155口
	1万口当たり基準価額(C/D)	5,715円	6,298円	6,092円	5,865円	6,142円	6,171円

(注) 第54期首元本額は384,216,743,512円、第54～59期中追加設定元本額は16,493,845,941円、第54～59期中一部解約元本額は70,720,946,298円、1口当たり純資産額は、第54期0.5751円、第55期0.6298円、第56期0.6092円、第57期0.5865円、第58期0.6142円、第59期0.6171円です。

○損益の状況

項 目	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年5月18日～ 2016年6月17日	2016年6月18日～ 2016年7月19日	2016年7月20日～ 2016年8月17日	2016年8月18日～ 2016年9月20日	2016年9月21日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月17日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	8,575,397,947	8,594,806,293	5,339,443,319	4,683,868,326	2,566,352,377	2,433,538,777
受取配当金	8,575,641,498	8,595,046,894	5,339,611,574	4,684,075,574	2,566,461,980	2,433,684,832
支払利息	△ 243,551	△ 240,601	△ 168,255	△ 207,248	△ 109,603	△ 146,055
(B) 有価証券売買損益	△ 25,335,960,705	15,935,041,781	△ 9,051,477,083	△ 9,036,077,624	8,965,871,856	301,881,412
売買益	88,324,670	16,032,045,287	192,616,594	98,543,159	9,075,778,553	516,066,166
売買損	△ 25,424,285,375	△ 97,003,506	△ 9,244,093,677	△ 9,134,620,783	△ 109,906,697	△ 214,184,754
(C) 信託報酬等	△ 197,722,501	△ 188,705,966	△ 173,706,040	△ 193,974,689	△ 149,501,286	△ 168,687,185
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 16,958,285,259	24,341,142,108	△ 3,885,739,804	△ 4,546,183,987	11,382,722,947	2,566,733,004
(E) 前期繰越損益金	△ 183,285,377,069	△ 202,075,899,840	△ 175,588,946,266	△ 175,918,986,616	△ 179,631,071,309	△ 160,261,044,269
(F) 追加信託差損益金	44,271,162,942	41,998,110,285	39,717,220,986	37,273,792,336	35,508,879,293	32,990,101,141
(配当等相当額)	(248,765,556,723)	(246,813,156,739)	(240,725,870,953)	(233,055,666,427)	(229,248,788,922)	(217,197,122,886)
(売買損益相当額)	(△204,494,393,781)	(△204,815,046,454)	(△201,008,649,967)	(△195,781,874,091)	(△193,739,909,629)	(△184,207,021,745)
(G) 計(D+E+F)	△ 155,972,499,386	△ 135,736,647,447	△ 139,757,465,084	△ 143,191,378,267	△ 132,739,469,689	△ 124,704,210,124
(H) 収益分配金	△ 5,707,407,483	△ 3,768,290,187	△ 3,670,298,826	△ 3,548,533,697	△ 1,742,968,784	△ 1,649,948,215
次期繰越損益金(G+H)	△ 161,679,906,869	△ 139,504,937,634	△ 143,427,763,910	△ 146,739,911,964	△ 134,482,437,853	△ 126,354,158,339
追加信託差損益金	44,271,162,942	41,998,110,285	39,717,220,986	37,273,792,336	35,508,879,293	32,990,101,141
(配当等相当額)	(248,765,556,726)	(246,813,156,742)	(240,725,870,955)	(233,055,666,429)	(229,248,788,925)	(217,197,122,887)
(売買損益相当額)	(△204,494,393,784)	(△204,815,046,457)	(△201,008,649,969)	(△195,781,874,093)	(△193,739,909,632)	(△184,207,021,746)
分配準備積立金	46,900,231,977	50,791,166,586	50,658,631,951	49,632,253,059	49,257,051,010	47,113,837,228
繰越損益金	△ 252,851,301,788	△ 232,294,214,505	△ 233,803,616,847	△ 233,645,957,359	△ 219,248,368,156	△ 206,458,096,708

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2016年5月18日～2016年11月17日)は以下の通りです。

項 目	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年5月18日～ 2016年6月17日	2016年6月18日～ 2016年7月19日	2016年7月20日～ 2016年8月17日	2016年8月18日～ 2016年9月20日	2016年9月21日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	8,377,675,740円	8,528,684,125円	5,165,737,614円	4,489,894,041円	2,533,088,749円	2,283,474,969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	248,765,556,726円	246,813,156,742円	240,725,870,955円	233,055,666,429円	229,248,788,925円	217,197,122,887円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	44,229,963,720円	46,030,772,648円	49,163,193,163円	48,690,892,715円	48,466,931,045円	46,480,310,474円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	301,373,196,186円	301,372,613,515円	295,054,801,732円	286,236,453,185円	280,248,808,719円	265,960,908,330円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	7,920円	7,997円	8,038円	8,066円	8,039円	8,059円
g. 分配金	5,707,407,483円	3,768,290,187円	3,670,298,826円	3,548,533,697円	1,742,968,784円	1,649,948,215円
h. 分配金(1万円当たり)	150円	100円	100円	100円	50円	50円

○分配金のお知らせ

	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
1万円当たり分配金（税込み）	150円	100円	100円	100円	50円	50円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年11月17日現在）

<野村マネー マザーファンド>

下記は、野村マネー マザーファンド全体（18,283,515千口）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59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	988,910	990,849	5.3	—	—	—	5.3
	(988,910)	(990,849)	(5.3)	(—)	(—)	(—)	(5.3)
特殊債券 (除く金融債)	5,125,000	5,131,964	27.5	—	—	—	27.5
	(5,125,000)	(5,131,964)	(27.5)	(—)	(—)	(—)	(27.5)
金融債券	3,980,000	3,983,292	21.3	—	—	—	21.3
	(3,980,000)	(3,983,292)	(21.3)	(—)	(—)	(—)	(21.3)
普通社債券 (含む投資法人債券)	4,100,000	4,111,823	22.0	—	—	—	22.0
	(4,100,000)	(4,111,823)	(22.0)	(—)	(—)	(—)	(22.0)
合 計	14,193,910	14,217,929	76.2	—	—	—	76.2
	(14,193,910)	(14,217,929)	(76.2)	(—)	(—)	(—)	(76.2)

* ()内は非上場債で内書きです。

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

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

銘柄	第59期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
北海道 公募平成18年度第10回	1.9	200,000	200,440	2016/12/28
北海道 公募（5年）平成23年度第12回	0.38	5,000	5,003	2017/1/31
北海道 公募（5年）平成23年度第14回	0.35	200,000	200,279	2017/3/23
神奈川県 公募第143回	1.77	100,000	100,165	2016/12/20
神奈川県 公募第145回	1.8	100,000	100,591	2017/3/20
群馬県 公募第3回	1.9	9,000	9,003	2016/11/25
共同発行市場地方債 公募第44回	1.8	100,000	100,046	2016/11/25
島根県 公募平成23年度第1回	0.38	2,500	2,500	2016/11/25
横浜市 公募平成18年度第3回	1.87	200,000	200,351	2016/12/20
川崎市 公募（5年）第31回	0.27	2,000	2,001	2017/3/17
広島市 公募平成18年度第1回	1.82	6,000	6,011	2016/12/26
仙台市 公募平成23年度第1回	0.36	59,410	59,444	2017/1/27
さいたま市 公募第4回	1.8	5,000	5,009	2016/12/26
小 計		988,910	990,849	
特殊債券(除く金融債)				
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第21回	1.8	125,000	125,091	2016/11/30
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第26回	0.1	350,000	350,095	2017/1/20
新関西国際空港社債 財投機関債第7回	0.217	100,000	100,027	2016/12/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第19回	0.445	300,000	300,142	2016/12/20
地方公共団体金融機構債券（5年）第9回	0.34	100,000	100,162	2017/4/28
地方公共団体金融機構債券（2年）第2回	0.1	200,000	200,107	2017/3/28
公営企業債券 第24回財投機関債	1.94	100,000	100,181	2016/12/20
日本政策金融公庫社債 第43回財投機関債	0.101	200,000	200,004	2016/11/18
国際協力銀行債券 第27回財投機関債	1.77	100,000	100,583	2017/3/17
都市再生債券 財投機関債第14回	1.9	100,000	100,625	2017/3/17
都市再生債券 財投機関債第82回	0.187	100,000	100,017	2016/12/20
関西国際空港社債 財投機関債第34回	0.535	100,000	100,042	2016/12/20
福祉医療機構債券 第36回財投機関債	0.167	100,000	100,020	2016/12/20
中部国際空港社債 財投機関債第2回	0.489	1,500,000	1,502,119	2017/2/24
成田国際空港 第3回	1.92	600,000	600,882	2016/12/20
日本学生支援債券 財投機関債第38回	0.1	400,000	400,150	2017/2/20
東日本高速道路 第18回	0.387	30,000	30,105	2017/9/20
中日本高速道路社債 第15回	0.931	420,000	421,313	2017/3/17
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第12回	1.91	200,000	200,292	2016/12/20
小 計		5,125,000	5,131,964	
金融債券				
商工債券 利付第738回い号	0.45	200,000	200,027	2016/11/25
商工債券 利付第739回い号	0.5	200,000	200,112	2016/12/27
商工債券 利付第743回い号	0.4	300,000	300,538	2017/4/27
農林債券 利付第738回い号	0.5	280,000	280,047	2016/11/25
農林債券 利付第739回い号	0.5	800,000	800,450	2016/12/27
農林債券 利付第740回い号	0.5	200,000	200,198	2017/1/27
農林債券 利付第741回い号	0.5	100,000	100,139	2017/2/27
農林債券 利付第742回い号	0.45	200,000	200,324	2017/3/27
しんきん中金債券 利付第265回	0.5	500,000	500,264	2016/12/27
しんきん中金債券 利付第266回	0.45	300,000	300,286	2017/1/27

銘	柄	第59期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		%	千円	千円	
しんきん中金債券	利付第268回	0.4	500,000	500,722	2017/3/27
商工債券	利付（3年）第166回	0.2	100,000	100,004	2016/11/25
商工債券	利付（3年）第167回	0.2	100,000	100,022	2016/12/27
商工債券	利付（3年）第169回	0.2	100,000	100,060	2017/2/27
商工債券	利付（3年）第171回	0.2	100,000	100,094	2017/4/27
小	計		3,980,000	3,983,292	
普通社債券（含む投資法人債券）					
関西電力	第491回	0.527	100,000	100,050	2016/12/20
三菱商事	第77回担保提供制限等財務上特約無	0.56	400,000	400,236	2016/12/26
みずほコーポレート銀行	第7回特定社債間限定同順位特約付	2.08	100,000	101,429	2017/7/27
みずほコーポレート銀行	第28回特定社債間限定同順位特約付	0.515	100,000	100,099	2017/1/25
みずほコーポレート銀行	第29回特定社債間限定同順位特約付	0.46	100,000	100,200	2017/4/21
みずほコーポレート銀行	第30回特定社債間限定同順位特約付	0.34	200,000	200,497	2017/7/25
三菱東京UFJ銀行	第132回特定社債間限定同順位特約付	0.46	500,000	500,434	2017/1/24
三井住友銀行	第56回社債間限定同順位特約付	0.47	600,000	600,497	2017/1/20
ホンダファイナンス	第19回社債間限定同順位特約付	0.372	200,000	200,442	2017/6/20
三井住友ファイナンス&リース	第4回社債間限定同順位特約付	0.554	200,000	200,286	2017/2/23
三菱UFJリース	第15回社債間限定同順位特約付	0.66	600,000	600,265	2016/12/14
三菱UFJリース	第17回社債間限定同順位特約付	0.578	100,000	100,156	2017/2/28
三菱地所	第79回担保提供制限等財務上特約無	1.79	100,000	100,569	2017/3/17
小田急電鉄	第64回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	100,038	2017/1/25
東日本旅客鉄道	第5回	3.3	500,000	504,384	2017/2/25
大阪瓦斯	第7回社債間限定同順位特約付	3.4	200,000	202,233	2017/3/20
小	計		4,100,000	4,111,823	
合	計		14,193,910	14,217,929	

*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59期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 999,992	% 5.4

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

*金額の単位未満は切り捨て。

Nomura Multi Managers Fund V – Global High Dividend Equity Premium

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

2015年9月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形	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。 ◆投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、高配当株や株式オプションの運用を行う運用会社を選定します(選定する運用会社は複数になる場合があります)。 										
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" data-bbox="308 526 1255 574"> <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>			地域名	米州	欧州	アジア・太平洋	投資比率	25～50%	25～50%	25～50%
	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋							
投資比率	25～50%	25～50%	25～50%								
<p>※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●為替にかかる含み損益の状況によっては、一時的に上記のような運用ができない場合があります。 ●高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。 ※市場環境によっては、株式オプションのコール売り以外のオプション取引を行う場合があります。 ●株式プレミアム戦略によってさらなる収益の獲得を目指しますが、株価が権利行使価格を上回って値上がりした局面では、収益の一部を享受できない場合があります。 ●米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が当該資産について、原則として対米ドルで為替取引を行います。 ●ファンドには2つのクラス(日本円クラス、通貨セレクトクラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、各クラスの通貨(通貨セレクトクラスについては、米ドル以外の選定通貨)で為替取引を行うことで、各通貨への投資効果を追求します。 <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・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に(原則、毎月)見直すこととします。 ●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%～30%程度の範囲内に維持することを基本とします。 ●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。 ●投資顧問会社が、高配当株や株式オプションの運用を行う副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。 ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、高配当株や株式オプションの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およびファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行います。 ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 											
受託会社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー										
投資顧問会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社*										
共同投資顧問会社	野村アセットマネジメント株式会社										
管理事務代行会社 保管銀行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー										

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

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

*野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社は、平成27年10月1日にリテール運用関連事業を分割し、野村アセットマネジメント株式会社が当該事業を承継します。これに伴い、同日以降は、ファンドの投資顧問会社は野村アセットマネジメント株式会社となります。

純資産計算書
2015年9月30日現在
(金額は米ドル表示)

資産	
投資有価証券時価	2,930,398,492
<i>(取得原価 : 3,316,996,759米ドル)</i>	
現金預金等	251,779,709
デリバティブに係る委託証拠金	2,346,691
受益証券発行未収金	5,313,881
ブローカーからの受取金	17,427,292
未収収益	6,789,406
現金および現金同等物に係る金利	1,072
	3,214,056,543
資産合計	
	3,214,056,543
負債	
投資オプション契約時価(売り)	16,193,182
<i>(取得原価 : 27,665,039米ドル)</i>	
銀行借越金	10,538,171
先物契約に係る評価差損	1,658,580
外国為替先渡し契約に係る評価差損	78,126,388
受益証券買戻支払金	4,419,652
ブローカーへの未払金	17,671,104
未払費用	9,280,000
	137,887,077
負債合計	
	137,887,077
純資産総額	
	3,076,169,466

受益証券一口当たり情報 :

	期末1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス(円)	10,082	737,600	7,436,449,560
通貨セレクトクラス(円)	6,216	53,754,985	334,146,275,354

運用計算書
2015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	434, 717
受取配当金等	103, 093, 440
雑収益	1
	1
収益合計	103, 528, 158
費用	
投資顧問および共同投資顧問報酬	27, 570, 840
事務管理代行報酬	3, 074, 626
保管費用	923, 585
当座借越利息	3, 663
取引銀行報酬	499, 581
銀行手数料	148, 500
受託報酬	615, 522
法務報酬	7, 988
海外登記手数料	12, 863
立替費用	614, 807
専門家報酬	50, 266
雑費用	5, 954
	5, 954
費用合計	33, 528, 195
純投資損益	69, 999, 963
投資有価証券売買に係る損益	(57, 069, 705)
先物取引契約に係る損益	(178, 817)
オプション契約に係る損益	(10, 493, 018)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	(285, 465, 541)
	(285, 465, 541)
当期実現純損益	(353, 207, 081)
投資有価証券評価損益の増減	(421, 597, 954)
先物取引契約に係る評価損益の増減	(1, 463, 575)
オプション契約に係る評価損益の増減	11, 857, 977
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(79, 163, 480)
	(79, 163, 480)
当期評価差損益	(490, 367, 032)
運用の結果による純資産の増減額	(773, 574, 150)

純資産変動計算書
2015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	1,612,464,979
純投資損益	69,999,963
当期実現純損益	(353,207,081)
当期評価差損益	(490,367,032)
運用の結果による純資産の増減額	(773,574,150)
受益証券の発行手取金	3,247,844,160
受益証券の買戻支払金	(51,465,360)
	3,196,378,800
受益者への支払分配金	(959,100,163)
期末純資産総額	3,076,169,466

発行済受益証券数の変動表
2015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	509,906
発行受益証券数	393,884
買戻受益証券数	(166,190)
期末発行済受益証券数	737,600

通貨セレクトクラス

期首受益証券数	14,657,825
発行受益証券数	39,169,755
買戻受益証券数	(72,595)
期末発行済受益証券数	53,754,985

統計情報
2015年9月30日現在
(未監査)

	2015	2014	2013
期末純資産総額(米ドル)	3,076,169,466	1,612,464,979	801,565,728
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	7,436,449,560	5,859,732,583	5,020,127,693
期末1口当たり純資産価格	10,082	11,492	11,276
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	334,146,275,354	146,257,277,005	56,027,119,854
期末1口当たり純資産価格	6,216	9,978	10,854

組入資産明細
2015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			
コール フラント					
	36,020	21ST CENTURY FOX/UBS INV WTS 22	1,131,291	938,283	0.03
	35,418	21ST CENTURY FOX/MAC GP WTS 16	1,112,480	923,594	0.03
			2,243,771	1,861,877	0.06
普通株式					
	808,239	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA *	54,375,862	41,195,487	1.33
	1,739,464	WESTPAC BANKING CORP *	47,199,796	36,209,945	1.17
	1,577,073	NTL AUSTRALIA BANK LTD *	44,139,314	33,139,000	1.08
	5,303,669	TELSTRA CORPORATION LIMITED	25,718,935	20,854,282	0.68
	1,060,143	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING *	28,541,791	20,121,905	0.65
	1,144,011	BHP BILLITON (AUD) *	29,186,946	17,816,821	0.58
	243,349	MACQUARIE GROUP LTD	13,758,543	13,075,381	0.43
	187,497	CSL LTD	13,259,257	11,722,363	0.38
	322,100	RIO TINTO LTD	15,020,878	10,971,928	0.36
	1,515,900	TRANSURBAN GROUP	10,960,020	10,561,191	0.34
	1,148,715	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	12,051,341	10,378,180	0.34
	3,363,399	SCENTRE GROUP	9,647,646	9,193,883	0.30
	330,386	WESFARMERS LIMITED	11,836,597	9,082,077	0.30
	1,480,781	ASCIANO LTD	8,266,805	8,718,185	0.28
	1,269,994	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,101,132	7,664,094	0.25
	2,576,014	INCITEC PIVOT LTD	6,559,560	7,041,559	0.23
	2,696,806	QANTAS AIRWAYS LTD	7,226,807	7,031,510	0.23
	998,842	WESTFIELD CORP	7,482,863	6,979,880	0.23
	549,368	AGL ENERGY LTD	6,644,499	6,149,280	0.20
	244,742	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	6,465,436	5,365,760	0.17
	1,542,173	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	5,297,624	5,231,599	0.17
	589,200	LEND LEASE CORP LTD	7,599,750	5,182,776	0.17
	3,155,090	ORORA LTD	5,151,873	5,108,339	0.17
	155,660	REA GROUP LTD	5,651,142	4,835,404	0.16
	1,305,974	BORAL LIMITED	6,117,962	4,823,931	0.16
	1,197,987	AMP LIMITED	5,891,345	4,668,559	0.15
	2,234,100	CSR LTD	6,401,080	4,525,394	0.15
	3,716,703	MIRVAC GROUP	5,542,544	4,480,663	0.15
	248,496	WOOLWORTHS LTD	6,405,363	4,326,403	0.14
	472,561	NEWCREST MINING LTD	5,019,152	4,206,468	0.14
	445,100	SUNCORP GROUP LTD	4,840,417	3,802,921	0.12
	1,189,590	SANTOS LTD	7,519,765	3,318,458	0.11
	352,800	AMCOR LTD	3,797,903	3,256,644	0.11
	159,018	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	5,012,876	3,224,413	0.10
	837,500	INSURANCE AUSTRALIAN GROUP LTD	3,854,871	2,841,098	0.09
	505,531	SYDNEY AIRPORT	2,149,727	2,111,787	0.07

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
	1,136,960	MEDIBANK PRIVATE LTD	2,121,252	1,928,486	0.06
	524,395	GPT GROUP	1,749,433	1,657,643	0.05
	196,700	SEEK LIMITED	2,756,397	1,654,404	0.05
	238,218	RECALL HOLDINGS LTD	1,421,602	1,220,529	0.04
	84,000	ORICA LTD	1,013,803	885,489	0.03
	135,160	COCA-COLA AMATIL LTD	846,846	853,550	0.03
	787,495	ALUMINA LTD	1,072,478	620,950	0.02
	161,700	AURIZON HOLDINGS LTD	644,456	567,811	0.02
	110,633	DULUX GROUP LTD	527,302	414,853	0.01
		合計：オーストラリア	463,850,991	369,021,283	12.00
			466,094,762	370,883,160	12.06
		オーストリア			
普通株式	202,836	VIENNA INSURANCE GROUP AG	8,844,609	5,978,219	0.19
		合計：オーストリア	8,844,609	5,978,219	0.19
		ベルギー			
普通株式	912,933	AGEAS NV	31,002,591	37,569,365	1.22
	80,026	SOLVAY SA	11,148,406	8,167,321	0.27
		合計：ベルギー	42,150,997	45,736,686	1.49
		バミューダ諸島			
普通株式	2,986,000	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG LTD	10,329,523	11,038,425	0.35
	8,668,780	COSCO PACIFIC LIMITED	11,922,017	9,787,139	0.32
	4,400,000	TEXWINCA HOLDINGS LTD	4,738,044	3,951,433	0.13
	5,472,000	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE	3,691,598	3,431,429	0.11
	1,170,000	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	3,562,443	2,925,717	0.10
		合計：バミューダ諸島	34,243,625	31,134,143	1.01
			34,243,625	31,134,143	1.01

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		ブラジル			
普通株式	234,118	ITAU UNIBANCO HOLDING SA SP ADR	3,203,727	1,532,302	0.05
			3,203,727	1,532,302	0.05
		合計：ブラジル	3,203,727	1,532,302	0.05
		カナダ			
普通株式	582,900	SUNCORP ENERGY INC (USD)	19,540,788	15,545,943	0.51
	47,700	MAGNA INTERNATIONAL INC (USD)	2,433,969	2,248,578	0.07
			21,974,757	17,794,521	0.58
		合計：カナダ	21,974,757	17,794,521	0.58
		ケイマン諸島			
普通株式	2,650,000	SANDS CHINA LTD	13,358,274	7,966,994	0.26
	3,489,000	SHIMAO PROPERTY HOLDING LTD	7,756,677	5,231,181	0.17
	1,700,000	STELLA INTERNATIONAL HOLDING LTD	4,307,376	4,158,914	0.14
	550,000	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	3,798,317	3,998,981	0.13
	4,250,000	NAGACORP LTD	3,271,001	2,544,483	0.08
	2,183,000	KWG PROPERTY HOLDING LTD	1,588,244	1,430,903	0.05
	600,000	MGM CHINA HOLDINGS LTD	1,609,781	694,443	0.02
			35,689,670	26,025,899	0.85
		合計：ケイマン諸島	35,689,670	26,025,899	0.85
		中国			
普通株式	21,200,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	14,140,815	12,200,100	0.39
	18,300,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	14,044,544	12,160,488	0.40
	25,000,000	BANK OF CHINA LTD H	11,618,020	10,741,797	0.35
	17,500,000	CHINA PETROL & CHEM CORP SINOPEC H	12,910,728	10,635,347	0.35
	5,400,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	6,005,693	6,877,072	0.22
	6,200,000	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD H	6,369,573	6,727,913	0.22
	1,780,000	CHINA PACIFIC INSURANCE CO LTD H	6,479,499	6,580,173	0.21
	1,790,000	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD H	6,076,740	6,189,856	0.20
	13,500,000	AGRICULTURAL BANK OF CHINA H	6,398,072	5,103,805	0.17
	5,400,000	DATANG INTL POWER GENER H	2,727,387	2,041,522	0.07
	2,285,000	ANHUI EXPRESSWAY CO LTD H	1,353,431	1,857,460	0.06
			88,124,502	81,115,533	2.64
		合計：中国	88,124,502	81,115,533	2.64

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		チェコ			
普通株式	39,746	PHILIP MORRIS CR AS	18,898,275	18,865,228	0.61
			18,898,275	18,865,228	0.61
		合計：チェコ	18,898,275	18,865,228	0.61
		デンマーク			
普通株式	637,531	D/S NORDEN AS	15,600,838	13,971,978	0.45
			15,600,838	13,971,978	0.45
		合計：デンマーク	15,600,838	13,971,978	0.45
		フィンランド			
普通株式	740,262	UPM-KYMMENE CORP	12,101,256	11,073,117	0.36
			12,101,256	11,073,117	0.36
		合計：フィンランド	12,101,256	11,073,117	0.36
		フランス			
普通株式	1,048,464	CIE DE SAINT GOBAIN	46,399,528	45,672,368	1.49
	1,167,635	ALSTOM	38,603,910	36,334,890	1.18
	532,025	BNP PARIBAS	31,430,173	31,319,100	1.02
	267,475	SANOFI	25,740,105	25,627,973	0.83
	319,321	VINCI SA	18,593,320	20,397,047	0.66
	1,182,072	COFACE SA	10,897,321	10,441,865	0.34
	819,073	VALLOUREC	18,599,432	7,388,914	0.24
	128,300	TOTAL SA SPONSORED ADR B	7,918,221	5,737,576	0.19
			198,182,010	182,919,733	5.95
		合計：フランス	198,182,010	182,919,733	5.95
		ドイツ			
普通株式	2,480,768	DEUTSCHE TELEKOM AG	40,548,862	44,142,671	1.43
	574,185	BILFINGER BERGER AG	32,183,624	21,465,740	0.70
	237,576	DAIMLER AG	19,527,330	17,315,199	0.56
	139,366	BASF SE	12,708,860	10,676,988	0.35
			104,968,676	93,600,598	3.04
		合計：ドイツ	104,968,676	93,600,598	3.04

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		香港			
普通株式					
	4,850,000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	15,389,016	14,236,914	0.46
	850,000	CHINA MOBILE LTD	11,745,042	10,068,257	0.33
	3,113,800	HKT TRUST AND HKT LTD	3,857,216	3,700,352	0.12
	5,600,000	CHINA POWER INTL DEVELOPMENT LTD	3,085,556	3,641,759	0.12
	1,950,000	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	2,371,682	1,804,041	0.06
			<u>36,448,512</u>	<u>33,451,323</u>	<u>1.09</u>
		合計：香港	<u>36,448,512</u>	<u>33,451,323</u>	<u>1.09</u>
		アイルランド			
普通株式					
	207,200	MEDTRONIC PLC	13,026,838	13,861,680	0.45
	169,000	XL GROUP PLC	5,748,915	6,143,150	0.20
	490,200	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	6,566,419	5,854,622	0.19
			<u>25,342,172</u>	<u>25,859,452</u>	<u>0.84</u>
		合計：アイルランド	<u>25,342,172</u>	<u>25,859,452</u>	<u>0.84</u>
		イスラエル			
普通株式					
	153,800	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD ADR	8,258,187	8,569,736	0.28
			<u>8,258,187</u>	<u>8,569,736</u>	<u>0.28</u>
		合計：イスラエル	<u>8,258,187</u>	<u>8,569,736</u>	<u>0.28</u>
		イタリア			
普通株式					
	5,133,609	SNAM SPA	26,090,691	26,277,093	0.85
	5,451,958	INTESA SANPAOLO RSP	14,363,995	17,571,734	0.57
	949,691	ENI SPA	19,597,417	14,952,388	0.49
			<u>60,052,103</u>	<u>58,801,215</u>	<u>1.91</u>
		合計：イタリア	<u>60,052,103</u>	<u>58,801,215</u>	<u>1.91</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		日本			
普通株式					
	226,000	TOYOTA MOTOR CORP	14,160,980	13,125,441	0.44
	250,000	NIPPON TELG & TEL CORP NTT	7,319,834	8,701,995	0.28
	1,420,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	7,856,749	8,475,285	0.28
	3,900,000	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	7,150,225	7,242,442	0.24
	160,000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	7,595,867	6,980,924	0.23
	436,000	SEKISUI HOUSE LTD	5,636,876	6,774,476	0.22
	400,000	NTT DOCOMO	7,191,223	6,641,676	0.22
	212,000	JAPAN TOBACCO INC	7,027,499	6,526,204	0.21
	665,000	NISSAN MOTOR CO LTD	6,405,092	6,061,071	0.20
	159,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	5,191,109	5,884,181	0.19
	162,000	FUJI HEAVY INDUSTRIES LTD	5,464,103	5,780,607	0.19
	260,000	KDDI CORP	5,232,061	5,777,058	0.19
	230,000	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	4,456,329	5,647,965	0.18
	145,000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	5,408,324	5,450,640	0.18
	34,100	FANUC CORPORATION	7,176,543	5,203,214	0.17
	390,000	ASTELLAS PHARMA INC	5,269,824	5,019,997	0.16
	276,000	NIPPON STEEL & SUMITOMO METAL CORP	7,087,293	4,986,305	0.16
	169,000	HONDA MOTOR CO LTD	5,551,558	4,982,848	0.16
	300,000	MITSUBISHI CORP	6,031,898	4,882,531	0.16
	45,000	DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD	4,889,459	4,545,740	0.15
	430,000	ITOCHU CORP	5,166,016	4,504,917	0.15
	350,000	SUMITOMO ELECTRIC IND LTD	4,662,440	4,442,433	0.14
	985,000	MITSUBISHI HEAVY IND LTD	5,450,850	4,369,026	0.14
	866,000	HITACHI LTD	5,800,019	4,335,413	0.14
	477,000	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	5,553,382	4,331,669	0.14
	145,000	CANON INC	4,907,044	4,172,542	0.14
	1,150,000	JX HOLDINGS INC	5,164,418	4,128,428	0.13
	1,120,000	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	4,573,543	4,081,381	0.13
	800,000	RESONA HOLDINGS INC	4,067,887	4,040,991	0.13
	352,000	mitsui & CO LTD	5,073,055	3,931,152	0.13
	117,500	AISIN SEIKI CO LTD	4,566,686	3,915,689	0.13
	118,000	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	3,652,647	3,743,599	0.12
	350,000	KONICA MINOLTA INC	4,456,202	3,656,587	0.12
	500,000	ASAHI KASEI CORPORATION	3,988,333	3,499,127	0.11
	76,000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	2,804,724	3,447,006	0.11
	240,000	SEIKO EPSON CORP	4,436,318	3,373,158	0.11
	92,000	BRIDGESTONE CORP	3,294,489	3,162,477	0.10
	626,000	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	2,740,627	3,139,650	0.10
	74,500	DENSO CORP	3,472,028	3,125,737	0.10
	537,000	ASAHI GLASS CO LTD	3,387,654	3,118,297	0.10
	100,500	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT CO	3,409,897	3,051,926	0.10
	63,000	TOKYO ELECTRON LTD	3,814,102	2,946,615	0.10
	49,000	SECOM CO LTD	2,838,959	2,926,611	0.10
	770,000	OSAKA GAS CO LTD	3,122,090	2,906,025	0.09
	285,000	HINO MOTORS LTD	3,862,031	2,880,156	0.09

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
580,000	MARUBENI CORP	3,652,200	2,820,996	0.09
180,000	KOMATSU LTD	4,077,279	2,628,094	0.09
207,400	KURARAY CO LTD	2,603,740	2,567,662	0.08
88,000	SOMPO JAPAN NIPPONKOA HOLDINGS	2,470,462	2,533,768	0.08
19,000	MURATA MANUFACTURING CO LTD	2,209,235	2,432,976	0.08
170,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	2,253,516	2,332,668	0.08
66,000	JAPAN AIRLINES	2,063,324	2,317,672	0.08
232,000	ISUZU MOTORS LTD	3,024,506	2,309,757	0.08
470,000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	2,299,931	2,220,196	0.07
340,000	DAIWA SECURITIES GROUP INC	2,715,063	2,180,272	0.07
150,000	JSR CORPORATION	2,678,438	2,146,964	0.07
900,000	NIPPON YUSEN KK	2,573,000	2,069,483	0.07
210,000	TONENGENERAL SEKIYU K.K	1,876,971	2,024,245	0.07
126,000	DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD	2,285,458	1,987,679	0.06
120,000	SONY FINANCIAL HOLDING INC	1,879,327	1,957,511	0.06
31,000	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	1,632,664	1,932,109	0.06
63,000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	1,729,160	1,923,645	0.06
190,000	RICOH CO LTD	1,938,607	1,906,649	0.06
400,000	NIPPON EXPRESS	1,805,795	1,896,193	0.06
22,000	LAWSON INC	1,501,030	1,614,764	0.05
250,000	BANK OF YOKOHAMA LTD	1,390,896	1,508,165	0.05
288,000	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	1,376,702	1,490,748	0.05
110,000	KIRIN HOLDINGS CO LTD	1,418,251	1,434,684	0.05
112,000	ORIX CORP	1,510,750	1,429,510	0.05
320,000	OJI HOLDINGS CORPORATION	1,227,949	1,364,993	0.04
30,000	KAO CORP	1,017,033	1,350,413	0.04
280,000	TOKYO GAS CO LTD	1,451,833	1,347,864	0.04
380,000	AOZORA BANK LTD	1,302,712	1,310,673	0.04
100,000	JFE HOLDINGS INC	2,141,633	1,301,758	0.04
48,000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	1,080,021	1,276,881	0.04
56,000	NGK SPARK PLUG CO LTD	1,563,774	1,273,216	0.04
56,000	ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP	1,142,908	1,187,370	0.04
120,000	SUMITOMO CORP	1,316,901	1,151,713	0.04
	合計：日本	301,579,356	281,152,503	9.14
		301,579,356	281,152,503	9.14
	ジャージー			
1,363,812	HENDERSON GROUP PLC CDI	5,551,427	5,305,221	0.17
		5,551,427	5,305,221	0.17
	合計：ジャージー	5,551,427	5,305,221	0.17
		5,551,427	5,305,221	0.17

普通株式

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		ルクセンブルク			
普通株式	1,173,859	TENARIS SA	17,060,979	14,223,864	0.46
			<u>17,060,979</u>	<u>14,223,864</u>	<u>0.46</u>
		合計：ルクセンブルク	<u>17,060,979</u>	<u>14,223,864</u>	<u>0.46</u>
		マレーシア			
普通株式	5,234,929	MALAYAN BANKING BHD MAYBANK	14,481,383	10,165,809	0.33
			<u>14,481,383</u>	<u>10,165,809</u>	<u>0.33</u>
		合計：マレーシア	<u>14,481,383</u>	<u>10,165,809</u>	<u>0.33</u>
		オランダ			
普通株式	824,517	RELX NV	11,650,972	13,564,928	0.44
	438,211	WOLTERS KLUWER NV	11,857,037	13,545,368	0.44
	537,320	KONINKLIJKE AHOLD NV	9,936,376	10,592,880	0.34
	112,200	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV A	9,925,940	9,305,868	0.30
	98,600	AKZO NOBEL NV SPON ADR	2,439,904	2,126,802	0.07
	174,670	DELTA LLOYD NV	3,229,957	1,456,644	0.05
			<u>49,040,186</u>	<u>50,592,490</u>	<u>1.64</u>
		合計：オランダ	<u>49,040,186</u>	<u>50,592,490</u>	<u>1.64</u>
		ノルウェー			
普通株式	1,268,530	DNB ASA	20,372,529	16,664,762	0.54
	461,264	STATOIL ASA	10,065,932	6,764,520	0.22
			<u>30,438,461</u>	<u>23,429,282</u>	<u>0.76</u>
		合計：ノルウェー	<u>30,438,461</u>	<u>23,429,282</u>	<u>0.76</u>
		フィリピン			
普通株式	40,000	PHIL LONG DISTANCE TEL CO	2,767,840	1,874,140	0.06
			<u>2,767,840</u>	<u>1,874,140</u>	<u>0.06</u>
		合計：フィリピン	<u>2,767,840</u>	<u>1,874,140</u>	<u>0.06</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		ポーランド			
普通株式	18,663,105	ORANGE POLSKA SA	51,265,409	35,987,496	1.17
	1,918,579	PGE POLSKA GRUPA ENERGA SA	10,974,634	6,794,343	0.22
			62,240,043	42,781,839	1.39
		合計：ポーランド	62,240,043	42,781,839	1.39
		韓国			
普通株式	50,000	SK TELECOM CO LTD	12,656,874	11,104,690	0.36
	146,000	DONGBU INSURANCE CO LTD	6,774,290	7,557,777	0.25
	61,000	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	4,680,718	5,743,617	0.19
	88,000	KANGWON LAND INC	2,600,130	3,143,430	0.10
	20,000	HYUNDAI MOTOR CO LTD PFD NON-VOTING	1,843,281	1,866,264	0.06
			28,555,293	29,415,778	0.96
		合計：韓国	28,555,293	29,415,778	0.96
		ロシア			
普通株式	1,345,243	M VIDEO	7,451,137	4,202,237	0.14
			7,451,137	4,202,237	0.14
		合計：ロシア	7,451,137	4,202,237	0.14
		シンガポール			
普通株式	1,110,093	DBS GROUP HOLDING LTD	15,115,678	12,642,871	0.42
	4,800,000	SINGAPORE TELECOM 1000	14,661,473	12,140,794	0.39
	3,900,000	CAPITALAND MALL TRUST REITS	5,667,317	5,206,208	0.17
	380,000	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	6,477,037	4,952,573	0.16
	2,450,000	COMFORTDELGRO CORP LTD	5,024,582	4,940,277	0.16
	1,000,000	MI LTD	2,855,139	1,981,310	0.06
	1,615,948	FRASERS COMMERCIAL TRUST	1,782,116	1,510,019	0.05
	568,603	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	645,616	541,317	0.02
			52,228,958	43,915,369	1.43
		合計：シンガポール	52,228,958	43,915,369	1.43

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
		スペイン			
普通株式	2,039,859	ENDESA	46,671,773	43,318,349	1.41
			<u>46,671,773</u>	<u>43,318,349</u>	<u>1.41</u>
		合計：スペイン	<u>46,671,773</u>	<u>43,318,349</u>	<u>1.41</u>
		スウェーデン			
普通株式	846,138	SWEDBANK AB A SHARES	20,072,130	18,683,392	0.61
	1,129,200	ERICSSON (LM)TELEFON SP ADR	13,779,205	11,009,700	0.36
			<u>33,851,335</u>	<u>29,693,092</u>	<u>0.97</u>
		合計：スウェーデン	<u>33,851,335</u>	<u>29,693,092</u>	<u>0.97</u>
		スイス			
普通株式	251,355	SWISS RE AG	20,717,028	21,586,729	0.70
	106,829	NOVARTIS AG	9,221,819	9,804,905	0.32
			<u>29,938,847</u>	<u>31,391,634</u>	<u>1.02</u>
		合計：スイス	<u>29,938,847</u>	<u>31,391,634</u>	<u>1.02</u>
		台湾			
普通株式	4,650,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	20,150,248	18,377,262	0.60
	9,350,000	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENG INC	11,776,957	10,033,924	0.33
	6,800,000	WPG HOLDINGS CO LTD	8,132,384	6,553,189	0.21
	2,000,000	SILICONWARE PRECISION IND CO LTD	2,807,435	2,483,743	0.08
	950,000	QUANTA COMPUTER	2,231,999	1,649,090	0.05
	970,000	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,942,289	967,231	0.03
			<u>47,041,312</u>	<u>40,064,439</u>	<u>1.30</u>
		合計：台湾	<u>47,041,312</u>	<u>40,064,439</u>	<u>1.30</u>
		タイ			
普通株式	5,250,000	INTOUCH HOLDINGS PUBLIC CO LTD	12,509,851	10,509,735	0.34
	5,000,000	KRUNG THAI BANK PUBLIC COM LTD NVDR	3,560,482	2,352,695	0.08
			<u>16,070,333</u>	<u>12,862,430</u>	<u>0.42</u>
		合計：タイ	<u>16,070,333</u>	<u>12,862,430</u>	<u>0.42</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
トルコ					
普通株式	3,288,689	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	9,826,995	6,480,599	0.21
			9,826,995	6,480,599	0.21
		合計：トルコ	9,826,995	6,480,599	0.21
イギリス					
普通株式	6,516,267	HSBC HOLDINGS PLC (GBP)	62,624,282	49,007,214	1.59
	17,249,972	TESCO PLC	57,922,274	48,099,475	1.56
	13,336,692	CENTRICA PLC	58,657,133	46,196,858	1.50
	11,287,828	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	40,801,255	40,638,505	1.32
	12,601,764	VODAFONE GROUP PLC (NEW)	43,305,794	39,490,259	1.28
	5,119,154	BAE SYSTEMS PLC	37,419,975	34,634,769	1.13
	4,882,391	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	25,291,570	27,619,850	0.90
	10,285,072	MORRISON WM SUPERMARKETS PLC	30,953,858	25,687,755	0.84
	4,810,684	BP PLC	33,790,634	24,128,468	0.78
	368,940	NIELSEN HOLDINGS PLC	16,828,050	16,476,860	0.54
	2,631,806	RBS GROUP	14,044,668	12,512,478	0.41
	1,574,932	ASHMORE GROUP PLC	6,272,247	5,889,536	0.19
			427,911,740	370,382,027	12.04
		合計：イギリス	427,911,740	370,382,027	12.04
アメリカ					
投資信託	93,750	ISHARES MSCI CANADA ETF	2,647,203	2,122,500	0.07
			2,647,203	2,122,500	0.07
リミテッド・パートナーシップ	87,000	KKR & CO LP	2,019,465	1,410,270	0.05
			2,019,465	1,410,270	0.05
普通株式	1,526,700	PFIZER INC *	46,976,662	47,785,710	1.54
	1,802,000	CISCO SYSTEMS INC *	45,992,440	46,933,090	1.52
	896,100	CITIGROUP INC *	46,819,745	44,312,145	1.43
	672,251	JPMORGAN CHASE & CO *	38,212,248	40,677,908	1.31
	874,700	VERIZON COMMUNICATIONS INC	42,385,672	38,355,595	1.24
	585,500	QUALCOMM INC	40,529,205	31,166,165	1.01
	490,500	VALERO ENERGY CORP	24,856,791	29,395,665	0.96
	512,400	DISCOVER FINANCIAL SERVICES *	30,722,011	26,439,840	0.86
	1,626,900	MARATHON OIL CORP	47,471,589	24,777,687	0.81
	328,400	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP *	25,968,221	23,753,172	0.77
	180,760	APPLE INC	20,383,836	19,898,061	0.65

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
386,500	MERCK & CO INC	20,541,093	19,046,720	0.62
361,200	NASDAQ INC	16,705,354	18,887,148	0.61
425,600	NEWELL RUBBERMAID INC	14,279,013	16,778,003	0.55
423,020	APACHE CORP *	31,541,494	16,146,673	0.52
313,560	MACY'S INC	19,259,716	15,991,560	0.52
1,533,200	AES CORP	20,516,501	14,672,724	0.48
469,800	EXELON CORP	15,622,104	13,812,120	0.45
495,900	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC	12,451,082	12,318,156	0.40
331,200	KROGER CO	8,507,870	11,923,200	0.39
399,590	GAP INC	16,426,922	11,095,815	0.36
274,200	GNC HOLDINGS INC A	11,257,519	11,020,098	0.36
97,800	LEAR CORP	8,653,272	10,549,686	0.34
332,600	BAXALTA INC	11,073,280	10,343,860	0.34
216,500	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	8,208,186	9,818,275	0.32
224,590	VIACOM INC - CLASS B	15,579,643	9,744,960	0.32
208,400	MARATHON PETROLEUM CORP	9,068,580	9,705,188	0.32
82,200	LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	9,215,356	8,874,312	0.29
266,100	BAXTER INTL INC	10,259,451	8,791,944	0.29
288,710	GULFPORT ENERGY CORP	13,207,874	8,592,010	0.28
192,550	MICROSOFT CORP *	7,533,949	8,431,765	0.27
417,500	STARWOOD PROPERTY TRUST INC	10,039,959	8,420,975	0.27
190,700	COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC	9,000,623	7,982,702	0.26
192,700	HOLOGIC INC	5,441,310	7,382,337	0.24
144,000	LINCOLN NATIONAL CORP	7,773,367	6,824,160	0.22
129,800	BAKER HUGHES INC	7,460,356	6,678,210	0.22
1,299,888	RESMED INC CDI	8,397,265	6,623,634	0.22
60,000	RAYTHEON CO	5,370,596	6,501,000	0.21
102,020	QUEST DIAGNOSTICS INC	6,438,064	6,239,543	0.20
289,623	OUTFRONT MEDIA INC	8,100,204	6,015,470	0.20
405,580	ARES CAPITAL CORP	6,846,470	5,876,854	0.19
77,250	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,520,895	5,865,593	0.19
62,500	JOHNSON & JOHNSON	6,284,825	5,853,750	0.19
454,800	KEYCORP	6,189,103	5,853,276	0.19
123,600	TOTAL SYSTEM SERVICE INC	4,387,480	5,615,148	0.18
111,300	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,945,060	5,433,666	0.18
114,980	METLIFE INC	5,910,685	5,390,262	0.18
78,700	ST JUDE MEDICAL INC	4,954,176	4,956,526	0.16
282,500	TERADYNE INC	5,408,169	4,901,375	0.16
366,900	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	7,509,165	4,769,700	0.16
236,000	DYNEGY INC	6,594,273	4,701,120	0.15
93,700	TUPPERWARE BRANDS CORP	7,253,387	4,600,670	0.15
227,880	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,504,025	4,306,932	0.14
79,600	WELLS FARGO & CO	3,896,500	4,069,948	0.13
58,500	LOWE'S COMPANIES INC	3,617,526	3,985,605	0.13
87,000	CROWN HOLDINGS	4,505,935	3,962,850	0.13
39,300	CVS HEALTH CORPORATION *	3,209,406	3,795,987	0.12
152,400	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,911,834	3,578,352	0.12

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
32,500	KIMBERLY-CLARK CORP	3,448,638	3,544,775	0.12
429,600	SLM CORP	3,941,604	3,252,072	0.11
73,600	TYSON FOODS INC CL-A	2,749,054	3,169,952	0.10
46,500	KELLOGG CO	2,992,589	3,119,685	0.10
47,500	OMNICOM GROUP INC	3,395,018	3,116,475	0.10
37,800	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	3,117,456	3,063,312	0.10
72,900	AVNET INC	3,174,269	3,052,323	0.10
84,800	HALLIBURTON CO	3,611,542	3,009,552	0.10
552,790	APOLLO INVESTMENT CORP	4,392,613	2,974,010	0.10
70,400	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,540,736	2,927,936	0.10
77,110	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,331,384	2,902,420	0.09
300,800	REGIONS FINANCIAL CORP	2,963,930	2,698,176	0.09
374,000	PROSPECT CAPITAL CORP	3,646,703	2,659,140	0.09
33,100	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	2,758,960	2,624,830	0.09
34,100	PHILLIPS 66	2,639,952	2,605,581	0.08
65,200	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,891,356	2,568,228	0.08
34,900	HARRIS CORP	2,509,163	2,516,988	0.08
50,800	SPIRIT AEROSYSTEMS HLDGS INC A	1,917,179	2,450,084	0.08
33,300	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,660,684	2,384,946	0.08
38,450	AFLAC INC	2,371,835	2,241,251	0.07
62,150	UGI CORP	2,029,623	2,109,993	0.07
12,564	NORTHROP GRUMMAN CORP	1,484,905	2,088,388	0.07
22,000	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,080,592	2,064,480	0.07
35,700	CELANESE CORP SERIES A	2,103,629	2,062,389	0.07
48,400	ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	2,468,458	2,012,956	0.07
55,650	ORACLE CORP	2,209,360	2,005,070	0.07
73,330	AECOM	2,184,393	1,987,243	0.06
106,700	WESTERN UNION CO	1,877,161	1,952,610	0.06
36,400	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,110,055	1,938,300	0.06
46,900	PUBLIC SERV ENTERPRISE GROUP	1,920,301	1,936,970	0.06
34,000	THOR INDUSTRIES INC	1,872,260	1,771,400	0.06
24,900	WAL-MART STORES INC	1,913,242	1,605,552	0.05
10,100	JONES LANG LASALLE INC	1,112,644	1,470,762	0.05
33,800	SONOCO PRODUCTS CO	1,324,589	1,272,908	0.04
11,100	STANLEY BLACK&DECKER INC	987,119	1,065,711	0.03
79,800	FORD MOTOR CO	1,108,114	1,061,340	0.03
18,100	ABBVIE INC	1,027,012	968,531	0.03
52,300	STEEL DYNAMICS INC	968,874	892,238	0.03
6,800	UNITED PARCEL SERVICE INC B	664,927	672,520	0.02
4,900	PG&E CORP	244,755	255,780	0.01
		949,444,015	858,301,777	27.89
	合計：アメリカ	954,110,683	861,834,547	28.01
	組入資産合計	3,316,996,759	2,930,398,492	95.26

* 部分的にデリバティブの担保として差し入れられている証券

財務書類に関する注記

2015年9月30日現在

(購入金額、売却金額、契約数は通貨を欄左側に表示)

注記1-外国為替先渡し契約

2015年9月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	428,122,724	AUD	609,184,558	2015年10月30日	1,866,351
USD	46,298,580	SGD	65,700,000	2015年10月9日	153,124
JPY	3,731,135,975	USD	31,026,119	2015年10月26日	68,909
JPY	3,725,047,529	USD	30,970,443	2015年10月13日	68,837
JPY	12,272,243	USD	101,336	2015年10月13日	923
JPY	25,267,780	USD	209,964	2015年10月13日	581
JPY	25,262,846	USD	209,964	2015年10月26日	574
USD	89,934,091	HKD	697,000,000	2015年10月16日	552
JPY	4,611,995	USD	38,267	2015年10月13日	163
JPY	1,648,958	USD	13,616	2015年10月13日	124
JPY	2,668,262	USD	22,139	2015年10月13日	94
JPY	2,638,192	USD	21,916	2015年10月13日	66
JPY	12,976,164	USD	108,076	2015年10月26日	66
JPY	12,977,947	USD	108,076	2015年10月13日	63
JPY	399,731	USD	3,322	2015年10月13日	8
JPY	64,957	USD	541	2015年10月13日	0
JPY	1,004,335	USD	8,372	2015年10月13日	(4)
JPY	5,828,225	USD	48,668	2015年10月26日	(96)
JPY	5,829,150	USD	48,668	2015年10月13日	(97)
JPY	6,808,906	USD	56,853	2015年10月26日	(108)
JPY	6,809,969	USD	56,853	2015年10月13日	(109)
JPY	13,560,869	USD	113,239	2015年10月26日	(225)
JPY	13,563,020	USD	113,239	2015年10月13日	(225)
JPY	4,786,665	USD	40,218	2015年10月13日	(333)
JPY	6,171,847	USD	51,821	2015年10月13日	(394)
JPY	6,170,505	USD	51,821	2015年10月26日	(397)
USD	94,057,234	HKD	729,000,000	2015年10月9日	(5,856)
USD	52,338,540	MXN	870,000,000	2015年11月20日	1,302,986
INR	4,500,000,000	USD	66,513,930	2015年11月20日	1,277,003
INR	4,393,000,000	USD	65,016,465	2015年11月20日	1,162,551
INR	4,500,000,000	USD	66,866,771	2015年11月20日	924,162
ZAR	1,200,000,000	USD	85,139,593	2015年11月20日	832,770
ZAR	1,089,000,000	USD	77,367,652	2015年11月20日	652,267
TRY	250,000,000	USD	80,716,764	2015年11月20日	626,905
INR	1,830,000,000	USD	27,314,032	2015年10月23日	400,345
USD	11,487,296	MXN	190,000,000	2015年10月23日	317,305
TRY	237,200,000	USD	76,896,269	2015年11月20日	282,604
USD	12,585,516	TRY	39,000,000	2015年11月20日	(104,095)
USD	25,035,604	INR	1,670,000,000	2015年11月20日	(122,364)
USD	20,979,020	INR	1,410,000,000	2015年11月20日	(262,138)
ZAR	1,200,000,000	USD	86,682,654	2015年11月20日	(710,291)
TRY	250,000,000	USD	82,155,767	2015年11月20日	(812,098)

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

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)
INR	12,520,000,000	USD	190,719,922	2015年10月23日	(1,111,178)
INR	12,500,000,000	USD	192,721,301	2015年10月23日	(3,415,447)
MXN	5,890,000,000	USD	349,583,941	2015年11月20日	(4,067,373)
INR	12,500,000,000	USD	193,858,560	2015年10月23日	(4,552,706)
ZAR	1,178,000,000	USD	90,739,628	2015年10月23日	(5,930,933)
ZAR	1,200,000,000	USD	93,132,632	2015年10月23日	(6,740,074)
ZAR	1,200,000,000	USD	93,294,823	2015年10月23日	(6,902,265)
TRY	310,000,000	USD	109,089,629	2015年10月23日	(7,366,962)
TRY	316,200,000	USD	111,611,161	2015年10月23日	(7,854,040)
TRY	310,000,000	USD	109,856,424	2015年10月23日	(8,133,757)
MXN	6,890,000,000	USD	422,595,682	2015年10月23日	(17,536,502)
BRL	1,996,400,000	USD	510,221,554	2015年11月4日	(24,669,126)
AUD	3,744,106	USD	2,616,531	2015年10月30日	3,281
USD	267,245	JPY	31,821,817	2015年10月26日	2,045
USD	267,245	JPY	31,828,739	2015年10月13日	2,030
USD	13,979	JPY	1,663,840	2015年10月13日	116
USD	117,266	JPY	14,067,597	2015年10月13日	47
USD	97,525	JPY	11,699,348	2015年10月13日	39
USD	486,189	JPY	58,788,759	2015年10月13日	(3,673)
USD	486,189	JPY	58,779,278	2015年10月26日	(3,673)
USD	195,111,681	GBP	126,674,017	2015年10月15日	3,265,005
USD	192,539,250	GBP	125,000,000	2015年10月15日	3,227,857
USD	51,522,322	TWD	1,633,000,000	2015年10月8日	1,877,353
USD	12,336,738	MYR	47,700,000	2015年10月8日	1,521,718
USD	28,301,672	NOK	226,582,625	2015年10月15日	1,467,859
USD	33,292,137	CHF	31,223,963	2015年10月15日	1,238,112
USD	8,409,165	TRY	23,013,322	2015年10月15日	837,632
USD	4,226,382	RUB	246,292,430	2015年10月15日	498,505
USD	16,149,596	THB	570,000,000	2015年10月8日	477,786
USD	92,825,702	JPY	11,100,000,000	2015年10月16日	330,482
USD	27,299,328	KRW	32,000,000,000	2015年10月8日	284,370
EUR	25,760,830	USD	28,715,597	2015年10月15日	220,442
USD	90,137,835	JPY	10,800,000,000	2015年10月30日	127,016
SGD	65,700,000	USD	46,045,484	2015年10月9日	99,971
USD	4,292,874	PHP	197,000,000	2015年10月8日	80,563
DKK	18,334,953	USD	2,697,042	2015年10月15日	63,720
DKK	25,551,243	USD	3,785,689	2015年10月15日	61,657
USD	516,670	RUB	30,173,551	2015年10月15日	59,964
USD	2,852,432	CHF	2,740,984	2015年10月15日	38,582
NOK	19,768,196	USD	2,310,909	2015年10月15日	30,206
KRW	2,200,000,000	USD	1,839,464	2015年10月8日	17,814
USD	2,384,492	PLN	8,954,495	2015年10月15日	13,845
USD	2,198,473	TWD	72,000,000	2015年10月8日	9,595
TWD	67,000,000	USD	2,029,687	2015年10月8日	7,185
PHP	73,500,000	USD	1,567,164	2015年10月8日	4,434
PHP	100,500,000	USD	2,145,144	2015年10月8日	3,776
TRY	1,846,196	USD	603,819	2015年10月15日	3,591
CHF	1,392,260	USD	1,425,832	2015年10月15日	3,439
DKK	10,355,721	USD	1,556,304	2015年10月15日	2,995
PHP	13,000,000	USD	277,126	2015年10月8日	843
USD	2,133,021	CZK	51,612,718	2015年10月15日	(29)
THB	27,000,000	USD	744,581	2015年10月8日	(2,232)
USD	4,607,295	PLN	17,414,862	2015年10月15日	(3,183)
THB	20,000,000	USD	553,326	2015年10月8日	(3,439)

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	1,516,108	KRW	1,800,000,000	2015年10月8日	(3,483)
PHP	10,000,000	USD	217,580	2015年10月8日	(3,758)
USD	1,985,770	PHP	93,500,000	2015年12月18日	(4,538)
USD	1,257,808	KRW	1,500,000,000	2015年10月8日	(8,517)
TWD	75,000,000	USD	2,289,726	2015年10月8日	(9,645)
USD	4,983,443	EUR	4,445,498	2015年10月15日	(9,995)
KRW	1,400,000,000	USD	1,191,996	2015年10月8日	(10,092)
SEK	18,934,851	USD	2,278,187	2015年10月15日	(12,517)
USD	17,467,781	CZK	423,055,000	2015年10月15日	(16,237)
TRY	2,159,451	USD	728,721	2015年10月15日	(18,248)
THB	50,000,000	USD	1,393,922	2015年10月8日	(19,202)
PLN	11,847,124	USD	3,155,984	2015年10月15日	(19,531)
TWD	81,000,000	USD	2,491,541	2015年10月8日	(29,053)
PLN	8,513,929	USD	2,285,005	2015年10月15日	(30,995)
TWD	111,000,000	USD	3,412,234	2015年10月8日	(37,715)
DKK	13,197,355	USD	2,033,966	2015年10月15日	(46,791)
USD	19,103,545	JPY	2,300,000,000	2015年10月9日	(60,473)
MYR	3,000,000	USD	743,089	2015年10月8日	(62,899)
USD	2,561,952	DKK	17,454,298	2015年10月15日	(66,207)
NOK	21,096,364	USD	2,569,294	2015年10月15日	(70,887)
JPY	1,640,000,000	USD	13,736,954	2015年10月9日	(72,175)
USD	2,092,275	SEK	18,093,535	2015年10月15日	(72,726)
USD	19,431,221	SEK	163,047,960	2015年10月15日	(78,462)
CHF	2,743,440	USD	2,914,166	2015年10月15日	(97,795)
TWD	86,000,000	USD	2,713,789	2015年10月8日	(99,297)
USD	43,899,570	SGD	62,700,000	2015年10月30日	(105,571)
PLN	16,539,804	USD	4,496,101	2015年10月15日	(117,290)
USD	21,856,653	DKK	145,962,774	2015年10月15日	(121,510)
USD	168,336,750	EUR	150,000,000	2015年10月15日	(151,840)
USD	168,325,500	EUR	150,000,000	2015年10月15日	(163,090)
USD	167,359,348	EUR	149,261,403	2015年10月15日	(299,607)
USD	88,839,072	JPY	10,700,000,000	2015年10月9日	(315,276)
USD	45,863,284	PLN	175,365,837	2015年10月15日	(563,746)
GBP	16,961,291	USD	26,522,404	2015年10月15日	(834,680)
HKD	86,000,000	USD	11,096,931	2015年10月9日	(326)
					(78,126,388)

注記2－先物契約

2015年9月30日現在、ファンドは以下の未決済先物契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
<i>買い持ちポジション</i>					
USD	462	FUT S&P 500 EMINI	2015年12月	43,838,025	(1,658,580)
				<u>43,838,025</u>	<u>(1,658,580)</u>
					<u>(1,658,580)</u>

注記3－オプション契約

2015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	(81,100)	C ARCC UQ 15.69 30/09/15 OTC	2015年9月30日	(12,343)	0	12,343
USD	(20,000)	C AVT UN 41.97 30/09/15 OTC	2015年9月30日	(17,116)	0	17,116
USD	(439)	C DGX UN 71.5 02/10/15 FLEX	2015年10月2日	(75,049)	0	75,049
THB	(1,000,000)	C INTUCH-R TB 79.56 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(15,100)	0	15,100
THB	(1,000,000)	C INTUCH-R TB 80.9626 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(14,600)	0	14,600
THB	(1,000,000)	C INTUCH-R TB 81.7461 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(11,900)	0	11,900
USD	(49,000)	C KR UN 38.85 01/10/15 OTC	2015年10月1日	(65,160)	0	65,160
USD	(4,300)	C PEG UN 42.52 30/09/15 OTC	2015年9月30日	(3,440)	0	3,440
USD	(88)	C SPR UN 56.85 30/09/15 FLEX	2015年9月30日	(13,108)	0	13,108
SGD	(1,000,000)	C ST SP 4.2536 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(27,600)	0	27,600
USD	(15,000)	C TDS UN 30.01 30/09/15 OTC	2015年9月30日	(8,826)	0	8,826
USD	(7,000)	C TOT UN 48.2054 30/09/15 OTC	2015年9月30日	(6,882)	0	6,882
USD	(330)	C TSS UN 47.01 30/09/15 FLEX	2015年9月30日	(29,355)	0	29,355
JPY	(33,000)	C 2503 JT 1868.0585 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(2,598)	0	2,598
JPY	(120,000)	C 3861 JT 1284.8096 01/10/15 OTC	2015年10月1日	(5,719)	0	5,719
JPY	(33,000)	C 4502 JT 6354.488 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(11,053)	0	11,053
JPY	(90,000)	C 4503 JT 1950.0754 01/10/15 OTC	2015年10月1日	(6,923)	0	6,923
JPY	(14,000)	C 5334 JT 3275.0365 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(3,859)	0	3,859
JPY	(42,000)	C 5411 JT 2322.693 01/10/15 OTC	2015年10月1日	(8,069)	0	8,069
JPY	(180,000)	C 7011 JT 689.59 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(3,187)	0	3,187
JPY	(180,000)	C 7201 JT 1284.8096 01/10/15 OTC	2015年10月1日	(13,285)	0	13,285
JPY	(48,000)	C 7270 JT 5058.288 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(14,448)	0	14,448
JPY	(120,000)	C 8601 JT 941.622 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(5,181)	0	5,181

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(80,000)	C 9437 JT 2842.562 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(8,809)	0	8,809
JPY	(14,000)	C 9735 JT 8494.84 01/10/15 OTC	2015年10月1日	(4,979)	0	4,979
USD	(122)	C AAL UQ 42.5 06/11/15	2015年11月6日	(14,902)	(10,492)	4,410
USD	(37)	C AAL UQ 44 16/10/15	2015年10月16日	(3,476)	(1,295)	2,181
USD	(100)	C AAL UQ 45.5 23/10/15	2015年10月23日	(11,545)	(11,000)	545
USD	(59)	C AAPL UN 117 09/10/15	2015年10月9日	(16,163)	(1,180)	14,983
USD	(390)	C AAPL UN 118 02/10/15	2015年10月2日	(87,818)	(780)	87,038
USD	(20)	C AAPL UN 121 30/10/15	2015年10月30日	(5,912)	(2,420)	3,492
USD	(110)	C AAPL UQ 115 23/10/15	2015年10月23日	(40,276)	(18,700)	21,576
USD	(17)	C AAPL UQ 120 02/10/15	2015年10月2日	(2,498)	(17)	2,481
USD	(128)	C AAPL UQ 120 16/10/15	2015年10月16日	(24,341)	(2,560)	21,781
SGD	(100,000)	C AAREIT SP 1.3957 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(1,070)	(523)	547
USD	(71)	C ABBV UN 64 02/10/15	2015年10月2日	(7,026)	(355)	6,671
USD	(44)	C ABBV UN 64 09/10/15	2015年10月9日	(5,712)	(220)	5,492
USD	(70)	C ADM UN 45 02/10/15	2015年10月2日	(6,479)	(1,330)	5,149
USD	(50)	C ADM UN 46 09/10/15	2015年10月9日	(4,607)	(250)	4,357
USD	(100,000)	C AES UN 10.244 30/11/15 OTC	2015年11月30日	(27,160)	(28,108)	(948)
USD	(71,000)	C AES UN 11.2254 09/11/15 OTC	2015年11月9日	(13,611)	(4,784)	8,827
USD	(160,000)	C AES UN 11.6026 16/11/15 OTC	2015年11月16日	(54,096)	(9,019)	45,077
USD	(90,000)	C AES UN 12.389 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(30,384)	(1,401)	28,983
USD	(193,000)	C AES UN 13.0072 12/10/15 OTC	2015年10月12日	(64,404)	(116)	64,288
USD	(100)	C AFL UN 60 20/11/15	2015年11月20日	(11,016)	(11,000)	16
USD	(53)	C AFL UN 64.25 09/10/15 FLEX	2015年10月9日	(7,100)	(11)	7,089
AUD	(1,284)	C AGL AU 17 26/11/15	2015年11月26日	(35,386)	(22,499)	12,887
AUD	(1,126)	C AGL AU 17 29/10/15	2015年10月29日	(20,708)	(9,865)	10,843
AUD	(180)	C AGL AU 17.28 17/12/15	2015年12月17日	(4,500)	(3,543)	957
AUD	(777)	C AGL AU 17.5 26/11/15	2015年11月26日	(18,884)	(7,624)	11,260
AUD	(1,301)	C AGL AU 17.5 29/10/15	2015年10月29日	(19,300)	(5,015)	14,285
EUR	(187,057)	C AGS BB 38.1554 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(40,730)	(16,681)	24,049
EUR	(129,410)	C AGS BB 38.9852 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(80,681)	(78,499)	2,182
EUR	(134,130)	C AGS BB 39.5197 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(66,036)	(15,506)	50,530
EUR	(159,571)	C AGS BB 39.7079 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(100,571)	(47,004)	53,567
EUR	(177,942)	C AGS BB 40.1004 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(73,052)	(76,722)	(3,670)
EUR	(74,040)	C AH NA 18.8965 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(27,762)	(20,290)	7,472
EUR	(83,018)	C AH NA 19.0225 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(8,830)	(1,116)	7,714
EUR	(108,201)	C AH NA 19.0669 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(31,271)	(42,250)	(10,979)
EUR	(98,607)	C AH NA 19.1264 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(29,188)	(31,708)	(2,520)
EUR	(114,269)	C AH NA 19.285 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(36,263)	(7,590)	28,673
EUR	(259,755)	C ALO FP 30.2107 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(99,998)	(155,537)	(55,539)
EUR	(238,081)	C ALO FP 30.7991 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(84,346)	(88,426)	(4,080)
EUR	(244,533)	C ALO FP 31.2682 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(148,309)	(47,027)	101,282
EUR	(223,207)	C ALO FP 32.9073 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(39,170)	(549)	38,621
AUD	(874)	C AMC AU 13 29/10/15	2015年10月29日	(17,477)	(30,017)	(12,540)
AUD	(1,688)	C AMC AU 13.5 26/11/15	2015年11月26日	(40,093)	(42,592)	(2,499)
AUD	(966)	C AMC AU 15 29/10/15	2015年10月29日	(18,121)	(677)	17,444

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	(1,280)	C AMP AU 6.25 26/11/15	2015年11月26日	(10,433)	(4,934)	5,499
AUD	(3,969)	C AMP AU 6.25 29/10/15	2015年10月29日	(35,841)	(6,955)	28,886
AUD	(3,090)	C AMP AU 6.5 29/10/15	2015年10月29日	(55,340)	(2,166)	53,174
AUD	(3,641)	C AMP AU 6.75 26/11/15	2015年11月26日	(40,957)	(3,828)	37,129
AUD	(1,489)	C ANZ AU 28.01 26/11/15	2015年11月26日	(78,949)	(68,880)	10,069
AUD	(1,327)	C ANZ AU 28.5 17/12/15	2015年12月17日	(83,262)	(66,967)	16,295
AUD	(1,258)	C ANZ AU 29 26/11/15	2015年11月26日	(42,188)	(38,355)	3,833
AUD	(1,105)	C ANZ AU 29.5 17/12/15	2015年12月17日	(39,351)	(32,142)	7,209
AUD	(1,332)	C ANZ AU 30.5 29/10/15	2015年10月29日	(49,112)	(6,068)	43,044
AUD	(1,557)	C ANZ AU 31 29/10/15	2015年10月29日	(64,786)	(4,365)	60,421
AUD	(1,545)	C ANZ AU 31.5 29/10/15	2015年10月29日	(45,838)	(2,166)	43,672
AUD	(985)	C ANZ AU 32.5 29/10/15	2015年10月29日	(28,150)	(483)	27,667
USD	(860)	C APA UN 42.5 20/11/15	2015年11月20日	(82,523)	(91,160)	(8,637)
USD	(300)	C APA UN 51 02/10/15	2015年10月2日	(35,667)	(35,700)	(33)
USD	(405)	C ARCC UN 16 18/12/15	2015年12月18日	(9,703)	(6,075)	3,628
GBP	(293,435)	C ASHM LN 2.685456 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(4,903)	(84)	4,819
GBP	(337,450)	C ASHM LN 2.831107 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(17,646)	(148)	17,498
USD	(90)	C AVT UN 44 16/10/15	2015年10月16日	(7,018)	(1,800)	5,218
AUD	(1,617)	C AZJ AU 5.5 29/10/15	2015年10月29日	(8,103)	(2,267)	5,836
GBP	(1,138,823)	C BA/ LN 4.5472552 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(113,128)	(212,279)	(99,151)
GBP	(516,877)	C BA/ LN 4.691325 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(18,999)	(6,216)	12,783
GBP	(1,186,935)	C BA/ LN 4.7167202 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(124,498)	(103,945)	20,553
GBP	(1,375,088)	C BA/ LN 4.9523026 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(144,227)	(4,249)	139,978
EUR	(28,064)	C BAS GY 74.3259 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(26,339)	(40,376)	(14,037)
EUR	(15,595)	C BAS GY 77.1806 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(6,685)	(50)	6,635
EUR	(25,574)	C BAS GY 77.6627 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(30,419)	(14,299)	16,120
EUR	(25,144)	C BAS GY 81.821 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(40,648)	(2,399)	38,249
EUR	(29,638)	C BAS GY 83.8914 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(35,666)	(286)	35,380
USD	(604)	C BAX UN 37.5 23/10/15	2015年10月23日	(54,530)	(15,100)	39,430
USD	(484)	C BAX UN 40 16/10/15	2015年10月16日	(51,628)	(1,452)	50,176
USD	(354)	C BHI UN 55.5 02/10/15	2015年10月2日	(65,120)	(37,170)	27,950
AUD	(1,082)	C BHP AU 23.85 29/10/15	2015年10月29日	(25,487)	(27,734)	(2,247)
AUD	(1,914)	C BHP AU 24 26/11/15	2015年11月26日	(132,161)	(77,808)	54,353
AUD	(840)	C BHP AU 24.78 29/10/15	2015年10月29日	(30,266)	(10,297)	19,969
AUD	(1,176)	C BHP AU 25.25 17/12/15	2015年12月17日	(44,157)	(38,880)	5,277
AUD	(1,509)	C BHP AU 25.5 26/11/15	2015年11月26日	(34,012)	(25,913)	8,099
AUD	(1,571)	C BHP AU 26.5 26/11/15	2015年11月26日	(53,802)	(14,314)	39,488
AUD	(393)	C BHP AU 26.65 17/12/15	2015年12月17日	(14,158)	(6,424)	7,734
AUD	(852)	C BHP AU 26.65 29/10/15	2015年10月29日	(35,266)	(2,532)	32,734
AUD	(1,230)	C BHP AU 27.59 29/10/15	2015年10月29日	(44,465)	(1,828)	42,637
AUD	(3,878)	C BLD AU 5.75 26/11/15	2015年11月26日	(26,623)	(28,540)	(1,917)
AUD	(370,500)	C BLD AU 5.8727 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(32,701)	(29,695)	3,006
AUD	(2,661)	C BLD AU 6 26/11/15	2015年11月26日	(25,746)	(10,258)	15,488
AUD	(2,815)	C BLD AU 6 29/10/15	2015年10月29日	(19,675)	(2,960)	16,715
EUR	(107,135)	C BNP FP 57.3338 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(107,489)	(167,676)	(60,187)

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
EUR	(63, 975)	C BNP FP 60.4623 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(23, 324)	(574)	22, 750
EUR	(98, 514)	C BNP FP 60.621 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(104, 379)	(60, 237)	44, 142
EUR	(90, 656)	C BNP FP 63.4417 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(99, 956)	(15, 313)	84, 643
EUR	(113, 143)	C BNP FP 64.4759 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(88, 117)	(4, 473)	83, 644
GBP	(968, 747)	C BP/ LN 3.5934192 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(71, 844)	(94, 140)	(22, 296)
GBP	(573, 586)	C BP/ LN 3.705378 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(56, 978)	(30, 545)	26, 433
GBP	(743, 259)	C BP/ LN 3.805536 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(20, 885)	(293)	20, 592
GBP	(972, 141)	C BP/ LN 3.9859175 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(109, 462)	(8, 466)	100, 996
GBP	(1, 023, 065)	C BP/ LN 4.1462933 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(88, 463)	(1, 131)	87, 332
USD	(31, 900)	C BRX UN 23.5449 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(13, 385)	(1, 850)	11, 535
USD	(29, 000)	C BRX UN 24.303 09/11/15 OTC	2015年11月9日	(11, 426)	(2, 777)	8, 649
USD	(443)	C BXLN UN 40 16/10/15	2015年10月16日	(19, 473)	(4, 430)	15, 043
USD	(747)	C C UN 52 06/11/15	2015年11月6日	(81, 390)	(66, 483)	14, 907
USD	(503)	C C UN 52 30/10/15	2015年10月30日	(55, 089)	(40, 240)	14, 849
USD	(425)	C C UN 52.5 23/10/15	2015年10月23日	(56, 081)	(26, 775)	29, 306
USD	(1, 370)	C C UN 55 09/10/15	2015年10月9日	(158, 859)	(10, 960)	147, 899
USD	(5)	C C UN 55 16/10/15	2015年10月16日	(355)	(55)	300
USD	(533)	C C UN 57.5 02/10/15	2015年10月2日	(92, 436)	(6, 396)	86, 040
AUD	(604)	C CBA AU 75.7 26/11/15	2015年11月26日	(80, 596)	(68, 793)	11, 803
AUD	(604)	C CBA AU 76.7 17/12/15	2015年12月17日	(78, 810)	(72, 603)	6, 207
AUD	(480)	C CBA AU 76.7 29/10/15	2015年10月29日	(15, 520)	(17, 158)	(1, 638)
AUD	(480)	C CBA AU 77.69 26/11/15	2015年11月26日	(29, 251)	(32, 129)	(2, 878)
AUD	(475)	C CBA AU 78.69 17/12/15	2015年12月17日	(36, 810)	(36, 289)	521
AUD	(691)	C CBA AU 78.69 29/10/15	2015年10月29日	(63, 158)	(9, 444)	53, 714
AUD	(588)	C CBA AU 80.68 26/11/15	2015年11月26日	(37, 807)	(15, 043)	22, 764
USD	(270)	C CCK UN 50 16/10/15	2015年10月16日	(40, 473)	(5, 400)	35, 073
USD	(8, 000)	C CCK UN 50.56 03/11/15 OTC	2015年11月3日	(9, 076)	(2, 367)	6, 709
SGD	(300, 000)	C CD SP 2.8665 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(4, 290)	(17, 263)	(12, 973)
SGD	(300, 000)	C CD SP 3.0952 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(5, 940)	(80)	5, 860
USD	(150)	C CE UN 65 16/10/15	2015年10月16日	(8, 444)	(6, 000)	2, 444
GBP	(2, 685, 662)	C CNA LN 2.3951 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(113, 639)	(211, 561)	(97, 922)
GBP	(2, 148, 897)	C CNA LN 2.4447966 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(114, 025)	(105, 551)	8, 474
GBP	(1, 425, 411)	C CNA LN 2.5088166 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(22, 733)	(151)	22, 582
GBP	(2, 771, 465)	C CNA LN 2.755662 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(220, 219)	(3, 316)	216, 903
GBP	(2, 836, 253)	C CNA LN 2.756676 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(188, 583)	(129)	188, 454
USD	(655)	C COF UN 77 02/10/15	2015年10月2日	(86, 267)	(21, 615)	64, 652
USD	(655)	C COF UN 78.5 30/10/15	2015年10月30日	(126, 786)	(46, 505)	80, 281
EUR	(23, 859)	C COFA FP 8.664 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(2, 257)	(3, 826)	(1, 569)
EUR	(35, 869)	C COFA FP 8.7641 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(1, 432)	(126)	1, 306
USD	(695)	C CSCO UQ 26.5 09/10/15	2015年10月9日	(38, 053)	(11, 120)	26, 933
USD	(508)	C CSCO UQ 26.5 23/10/15	2015年10月23日	(15, 219)	(17, 780)	(2, 561)
USD	(2, 400)	C CSCO UQ 26.5 30/10/15	2015年10月30日	(79, 098)	(76, 800)	2, 298
USD	(507)	C CSCO UQ 27 06/11/15	2015年11月6日	(13, 668)	(12, 675)	993
USD	(1, 496)	C CSCO UQ 27 16/10/15	2015年10月16日	(58, 302)	(17, 952)	40, 350
USD	(1, 600)	C CSCO UQ 28 02/10/15	2015年10月2日	(68, 607)	(4, 800)	63, 807

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	(129)	C CSL AU 104 29/10/15	2015年10月29日	(15,039)	(136)	14,903
AUD	(281)	C CSL AU 91 26/11/15	2015年11月26日	(78,567)	(49,140)	29,427
AUD	(257)	C CSL AU 95 26/11/15	2015年11月26日	(31,550)	(20,895)	10,655
AUD	(253)	C CSL AU 97 17/12/15	2015年12月17日	(24,973)	(20,659)	4,314
AUD	(370)	C CSL AU 98 29/10/15	2015年10月29日	(28,362)	(4,279)	24,083
AUD	(3,055)	C CSR AU 3.2 26/11/15	2015年11月26日	(22,611)	(10,706)	11,905
AUD	(2,592)	C CSR AU 3.3 26/11/15	2015年11月26日	(21,796)	(6,359)	15,437
AUD	(3,163)	C CSR AU 3.3 29/10/15	2015年10月29日	(20,039)	(2,217)	17,822
AUD	(2,981)	C CSR AU 3.4 26/11/15	2015年11月26日	(14,442)	(5,223)	9,219
AUD	(4,900)	C CSR AU 3.6 26/11/15	2015年11月26日	(26,147)	(3,091)	23,056
AUD	(2,876)	C CSR AU 3.6 29/10/15	2015年10月29日	(20,628)	(202)	20,426
AUD	(2,774)	C CSR AU 3.9 29/10/15	2015年10月29日	(13,771)	(194)	13,577
SGD	(800,000)	C CT SP 1.9313 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(13,360)	(10,432)	2,928
SGD	(800,000)	C CT SP 1.9881 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(14,720)	(2,479)	12,241
AUD	(203)	C CTX AU 32.5 26/11/15	2015年11月26日	(10,346)	(12,663)	(2,317)
AUD	(781)	C CTX AU 34 26/11/15	2015年11月26日	(34,139)	(24,907)	9,232
AUD	(711)	C CTX AU 34.5 29/10/15	2015年10月29日	(20,786)	(6,977)	13,809
AUD	(393)	C CTX AU 35 26/11/15	2015年11月26日	(17,903)	(7,850)	10,053
USD	(82)	C CVS UN 102 30/10/15	2015年10月30日	(11,972)	(6,642)	5,330
USD	(75)	C CVS UN 106 02/10/15	2015年10月2日	(18,501)	(75)	18,426
USD	(233)	C CYH UN 54.5 09/10/15	2015年10月9日	(22,670)	(13,980)	8,690
USD	(400)	C CYH UN 57.5 02/10/15	2015年10月2日	(66,782)	(68,000)	(1,218)
EUR	(51,210)	C DAI GY 75.5577 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(54,730)	(76,485)	(21,755)
EUR	(12,314)	C DAI GY 79.6279 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(5,395)	(44)	5,351
EUR	(46,834)	C DAI GY 83.507 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(67,682)	(13,542)	54,140
EUR	(50,524)	C DAI GY 84.91 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(73,722)	(5,588)	68,134
EUR	(50,524)	C DAI GY 87.1606 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(80,998)	(991)	80,007
SGD	(300,000)	C DBS SP 17.5199 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(22,140)	(7,563)	14,577
SGD	(250,000)	C DBS SP 18.566 22/10/15 OTC	2015年10月22日	(24,050)	(211)	23,839
USD	(584)	C DFS UN 53 02/10/15	2015年10月2日	(60,059)	(2,920)	57,139
USD	(360)	C DFS UN 54 06/11/15	2015年11月6日	(35,624)	(36,000)	(376)
USD	(585)	C DFS UN 56 09/10/15	2015年10月9日	(62,569)	(8,775)	53,794
USD	(520)	C DFS UN 57.5 16/10/15	2015年10月16日	(52,073)	(2,600)	49,473
EUR	(67,908)	C DG FP 61.3025 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(78,117)	(14,520)	63,597
EUR	(23,425)	C DG FP 61.3655 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(8,177)	(494)	7,683
EUR	(68,835)	C DG FP 61.3823 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(54,449)	(72,763)	(18,314)
EUR	(61,032)	C DG FP 61.7238 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(67,381)	(28,795)	38,586
EUR	(62,948)	C DG FP 62.524 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(61,966)	(38,211)	23,755
USD	(21,700)	C DGX UN 70.1662 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(37,252)	(444)	36,808
EUR	(174,670)	C DL NA 16.7275 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(49,429)	(498)	48,931
GBP	(1,132,591)	C DLG LN 3.6938568 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(27,353)	(123,253)	(95,900)
GBP	(998,611)	C DLG LN 3.7047375 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(91,180)	(137,834)	(46,654)
GBP	(926,902)	C DLG LN 3.8623552 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(57,476)	(75,501)	(18,025)
GBP	(1,221,315)	C DLG LN 3.8632972 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(106,429)	(75,713)	30,716
AUD	(110,633)	C DLX AU 5.9747 18/11/15 OTC	2015年11月18日	(7,841)	(1,140)	6,701

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)
NOK	(35, 219)	C DNB NO 121.6148 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(5, 563)	(12, 052)	(6, 489)
NOK	(294, 123)	C DNB NO 124.0771 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(68, 925)	(66, 918)	2, 007
NOK	(259, 919)	C DNB NO 126.8363 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(19, 908)	(308)	19, 600
NOK	(269, 772)	C DNB NO 134.1938 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(78, 938)	(9, 472)	69, 466
NOK	(269, 772)	C DNB NO 140.5526 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(70, 436)	(517)	69, 919
DKK	(41, 356)	C DNORD DC 166.2752 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(11, 873)	(10, 472)	1, 401
DKK	(29, 988)	C DNORD DC 169.8372 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(3, 081)	(14)	3, 067
DKK	(78, 884)	C DNORD DC 197.6913 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(31, 419)	(526)	30, 893
EUR	(64, 314)	C DTE GY 17.3613 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(6, 733)	(1, 068)	5, 665
EUR	(551, 879)	C DTE GY 17.384 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(168, 821)	(234, 928)	(66, 107)
EUR	(527, 573)	C DTE GY 17.6133 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(183, 523)	(105, 370)	78, 153
EUR	(468, 116)	C DTE GY 17.618 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(134, 827)	(36, 299)	98, 528
EUR	(575, 195)	C DTE GY 17.6426 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(175, 399)	(170, 536)	4, 863
USD	(19, 000)	C DYN UN 19.839 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(19, 217)	(22, 243)	(3, 026)
USD	(50, 000)	C DYN UN 25.14 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(45, 185)	(8, 151)	37, 034
USD	(256)	C DYN UN 30 16/10/15	2015年10月16日	(16, 373)	(2, 560)	13, 813
AUD	(2, 417)	C EGP AU 5.25 17/12/15	2015年12月17日	(19, 466)	(21, 176)	(1, 710)
AUD	(4, 649)	C EGP AU 5.25 26/11/15	2015年11月26日	(45, 064)	(29, 326)	15, 738
AUD	(2, 359)	C EGP AU 5.5 17/12/15	2015年12月17日	(11, 241)	(11, 574)	(333)
AUD	(1, 898)	C EGP AU 5.5 29/10/15	2015年10月29日	(17, 175)	(1, 995)	15, 180
EUR	(52, 618)	C ELE SM 19.6907 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(4, 916)	(3, 425)	1, 491
EUR	(492, 514)	C ELE SM 19.7333 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(185, 671)	(97, 356)	88, 315
EUR	(453, 793)	C ELE SM 19.9172 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(95, 424)	(249, 842)	(154, 418)
EUR	(393, 708)	C ELE SM 20.1061 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(144, 596)	(108, 756)	35, 840
EUR	(355, 796)	C ELE SM 20.1977 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(99, 237)	(136, 262)	(37, 025)
USD	(115, 000)	C ERIC UQ 10.01 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(37, 099)	(11, 302)	25, 797
USD	(150, 000)	C ERIC UQ 9.656 12/11/15 OTC	2015年11月12日	(41, 085)	(65, 417)	(24, 332)
USD	(96)	C ESRX UQ 84 06/11/15	2015年11月6日	(17, 301)	(14, 784)	2, 517
USD	(56)	C ESRX UQ 91.5 02/10/15	2015年10月2日	(8, 822)	(168)	8, 654
USD	(90, 000)	C EXC UN 31.209 05/11/15 OTC	2015年11月5日	(81, 000)	(44, 691)	36, 309
USD	(47, 200)	C EXC UN 31.588 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(38, 676)	(14, 676)	24, 000
USD	(508)	C EXC UN 35 16/10/15	2015年10月16日	(29, 300)	(508)	28, 792
USD	(160)	C F UN 14.5 02/10/15	2015年10月2日	(3, 861)	(160)	3, 701
USD	(160)	C F UN 15 16/10/15	2015年10月16日	(2, 713)	(320)	2, 393
SGD	(150, 000)	C FCOT SP 1.3156 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(1, 080)	(2, 802)	(1, 722)
SGD	(150, 000)	C FCOT SP 1.3685 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(1, 530)	(2, 054)	(524)
EUR	(34, 264)	C GBF GY 38.2894 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(18, 674)	(31, 874)	(13, 200)
EUR	(26, 728)	C GBF GY 40.1039 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(5, 692)	(209)	5, 483
EUR	(24, 448)	C GBF GY 41.1407 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(14, 404)	(8, 981)	5, 423
EUR	(103, 701)	C GBF GY 41.6992 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(80, 475)	(19, 175)	61, 300
EUR	(61, 342)	C GBF GY 42.5457 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(40, 283)	(3, 376)	36, 907
USD	(58, 000)	C GNC UN 47.693 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(99, 638)	(2, 242)	97, 396
USD	(19, 000)	C GNC UN 50.12 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(40, 470)	0	40, 470
USD	(300)	C GPOR UQ 37.5 16/10/15	2015年10月16日	(14, 687)	(6, 300)	8, 387
USD	(223)	C GPS UN 33.5 23/10/15	2015年10月23日	(11, 802)	(11, 819)	(17)

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	(3, 226)	C GPT AU 4.8 26/11/15	2015年11月26日	(10, 262)	(12, 436)	(2, 174)
USD	(81)	C HAL UN 41.5 02/10/15	2015年10月2日	(6, 047)	(405)	5, 642
USD	(156)	C HIG UN 45.5 02/10/15	2015年10月2日	(10, 757)	(8, 112)	2, 645
USD	(59)	C HIG UN 46.5 02/10/15	2015年10月2日	(5, 720)	(1, 475)	4, 245
USD	(156)	C HIG UN 46.5 23/10/15	2015年10月23日	(12, 005)	(12, 948)	(943)
USD	(255)	C HIG UN 47 06/11/15	2015年11月6日	(27, 529)	(29, 580)	(2, 051)
USD	(117)	C HIG UN 47 09/10/15	2015年10月9日	(12, 514)	(12, 051)	463
USD	(125)	C HIG UN 47 16/10/15	2015年10月16日	(25, 585)	(6, 375)	19, 210
USD	(150)	C HOLX UQ 41 16/10/15	2015年10月16日	(8, 843)	(3, 000)	5, 843
USD	(210)	C HOLX UQ 42 16/10/15	2015年10月16日	(22, 881)	(2, 100)	20, 781
USD	(41, 000)	C HOLX UQ 42.5 05/10/15 OTC	2015年10月5日	(64, 354)	(86)	64, 268
USD	(13)	C HON UN 100 16/10/15	2015年10月16日	(2, 852)	(338)	2, 514
USD	(15)	C HON UN 100.6 03/11/15 FLEX	2015年11月3日	(3, 359)	(954)	2, 405
USD	(10)	C HON UN 105 16/10/15	2015年10月16日	(820)	(20)	800
USD	(50)	C HON UN 106.6 09/10/15 FLEX	2015年10月9日	(12, 598)	(1)	12, 597
USD	(140)	C HRS UN 80 16/10/15	2015年10月16日	(17, 094)	(1, 400)	15, 694
GBP	(984, 154)	C HSBA LN 5.321628 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(90, 599)	(129, 712)	(39, 113)
GBP	(859, 326)	C HSBA LN 5.38954 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(35, 502)	(3, 983)	31, 519
GBP	(1, 127, 687)	C HSBA LN 5.474688 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(132, 721)	(75, 186)	57, 535
GBP	(1, 113, 513)	C HSBA LN 5.81436 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(164, 959)	(10, 996)	153, 963
GBP	(1, 385, 784)	C HSBA LN 5.9169979 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(200, 720)	(2, 624)	198, 096
AUD	(3, 579)	C IAG AU 5.25 26/11/15	2015年11月26日	(40, 630)	(12, 543)	28, 087
AUD	(4, 796)	C IAG AU 5.5 29/10/15	2015年10月29日	(16, 683)	(1, 008)	15, 675
USD	(100)	C IPG UN 20 16/10/15	2015年10月16日	(2, 696)	(2, 500)	196
USD	(56, 000)	C IPG UN 20.54 16/11/15 OTC	2015年11月16日	(34, 507)	(16, 579)	17, 928
USD	(250)	C IPG UN 21 16/10/15	2015年10月16日	(8, 489)	(3, 250)	5, 239
AUD	(3, 025)	C IPL AU 3.6 26/11/15	2015年11月26日	(30, 791)	(87, 989)	(57, 198)
AUD	(2, 616)	C IPL AU 3.7 17/12/15	2015年12月17日	(25, 390)	(65, 091)	(39, 701)
AUD	(3, 613)	C IPL AU 3.7 26/11/15	2015年11月26日	(31, 168)	(87, 366)	(56, 198)
AUD	(4, 700)	C IPL AU 3.7 29/10/15	2015年10月29日	(26, 788)	(97, 180)	(70, 392)
AUD	(4, 318)	C IPL AU 3.8 29/10/15	2015年10月29日	(21, 982)	(69, 609)	(47, 627)
USD	(180)	C JEC UN 42.5 16/10/15	2015年10月16日	(12, 412)	(3, 600)	8, 812
AUD	(751)	C JHX AU 18.18 29/10/15	2015年10月29日	(21, 444)	(11, 580)	9, 864
AUD	(1, 046)	C JHX AU 19.16 17/12/15	2015年12月17日	(32, 783)	(19, 795)	12, 988
AUD	(1, 031)	C JHX AU 19.16 26/11/15	2015年11月26日	(32, 067)	(14, 814)	17, 253
AUD	(1, 137)	C JHX AU 19.16 29/10/15	2015年10月29日	(21, 791)	(5, 180)	16, 611
AUD	(937)	C JHX AU 20.14 29/10/15	2015年10月29日	(21, 174)	(985)	20, 189
USD	(40)	C JLL UN 155 16/10/15	2015年10月16日	(9, 718)	(6, 680)	3, 038
USD	(154)	C JNJ UN 95.5 20/11/15 FLEX	2015年11月20日	(22, 631)	(33, 356)	(10, 725)
USD	(96)	C JNJ UN 98 30/10/15	2015年10月30日	(8, 924)	(6, 432)	2, 492
USD	(186)	C JPM UN 62.5 30/10/15	2015年10月30日	(13, 570)	(19, 344)	(5, 774)
USD	(278)	C JPM UN 63 06/11/15	2015年11月6日	(29, 714)	(30, 024)	(310)
USD	(462)	C JPM UN 64 23/10/15	2015年10月23日	(58, 653)	(17, 556)	41, 097
USD	(703)	C JPM UN 64.5 30/10/15	2015年10月30日	(93, 896)	(28, 120)	65, 776
USD	(278)	C JPM UN 65 20/11/15	2015年11月20日	(18, 665)	(18, 070)	595

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	(300)	C JPM UN 67.5 16/10/15	2015年10月16日	(44,086)	(1,200)	42,886
USD	(483)	C JPM UN 69.5 02/10/15	2015年10月2日	(42,000)	(1,932)	40,068
USD	(186)	C K UN 67.5 16/10/15	2015年10月16日	(26,776)	(13,950)	12,826
USD	(452)	C KEY UN 14 16/10/15	2015年10月16日	(16,605)	(2,712)	13,893
USD	(500)	C KEY UN 14 20/11/15	2015年11月20日	(10,479)	(9,500)	979
USD	(39,000)	C KEY UN 14.8419 05/10/15 OTC	2015年10月5日	(9,731)	(1)	9,730
USD	(23,000)	C KKR UN 19.628 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(16,919)	(788)	16,131
USD	(231)	C KKR UN 20 16/10/15	2015年10月16日	(13,619)	(1,386)	12,233
USD	(65)	C KMB UN 110 26/10/15 FLEX	2015年10月26日	(10,202)	(13,577)	(3,375)
USD	(65)	C KMB UN 115.4 05/10/15 FLEX	2015年10月5日	(10,007)	(29)	9,978
USD	(230)	C KR UN 36.25 16/10/15	2015年10月16日	(22,875)	(17,940)	4,935
USD	(33,700)	C KR UN 37.461 02/11/15 OTC	2015年11月2日	(20,469)	(19,075)	1,394
USD	(26,800)	C KR UN 38.4208 02/11/15 OTC	2015年11月2日	(25,393)	(8,785)	16,608
USD	(17,800)	C LEA UN 101.75 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(101,994)	(144,783)	(42,789)
USD	(89)	C LEA UN 110 16/10/15	2015年10月16日	(16,817)	(12,460)	4,357
USD	(40)	C LEA UN 110 20/11/15	2015年11月20日	(8,878)	(10,000)	(1,122)
USD	(89)	C LEA UN 115 16/10/15	2015年10月16日	(8,807)	(2,047)	6,760
GBP	(2,383,455)	C LGEN LN 2.4567552 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(125,070)	(216,491)	(91,421)
GBP	(1,743,993)	C LGEN LN 2.6440806 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(36,556)	(185)	36,371
GBP	(2,400,530)	C LGEN LN 2.6674824 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(136,756)	(5,199)	131,557
GBP	(2,282,719)	C LGEN LN 2.682438 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(115,140)	(21,159)	93,981
GBP	(1,233,805)	C LGEN LN 2.7899976 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(77,266)	(1,476)	75,790
USD	(265)	C LH UN 125 16/10/15	2015年10月16日	(33,643)	(5,300)	28,343
USD	(145)	C LH UN 125 20/11/15	2015年11月20日	(34,980)	(5,800)	29,180
AUD	(621)	C LLC AU 14.5 17/12/15	2015年12月17日	(11,416)	(3,917)	7,499
AUD	(923)	C LLC AU 14.5 26/11/15	2015年11月26日	(18,816)	(3,235)	15,581
AUD	(1,857)	C LLC AU 14.5 29/10/15	2015年10月29日	(40,699)	(1,952)	38,747
AUD	(1,725)	C LLC AU 16 29/10/15	2015年10月29日	(46,094)	(121)	45,973
AUD	(766)	C LLC AU 16.5 29/10/15	2015年10月29日	(17,421)	(54)	17,367
USD	(235)	C LNC UN 52.5 16/10/15	2015年10月16日	(14,795)	(1,880)	12,915
USD	(85)	C LNC UN 57.5 16/10/15	2015年10月16日	(10,961)	(425)	10,536
USD	(100)	C LOW UN 70 16/10/15	2015年10月16日	(6,366)	(5,500)	866
USD	(35)	C LOW UN 70 20/11/15	2015年11月20日	(5,161)	(5,635)	(474)
USD	(6,200)	C LOW UN 71.127 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(7,955)	(4,294)	3,661
USD	(62)	C LOW UN 72.5 16/10/15	2015年10月16日	(4,367)	(744)	3,623
USD	(215)	C LYB UN 85 16/10/15	2015年10月16日	(58,470)	(43,000)	15,470
USD	(215)	C LYB UN 90 16/10/15	2015年10月16日	(27,296)	(10,750)	16,546
USD	(725)	C M UN 62 09/10/15	2015年10月9日	(45,053)	(35,525)	9,528
USD	(305)	C M UN 65 02/10/15	2015年10月2日	(23,937)	(305)	23,632
MYR	(800,000)	C MAY MK 8.5547 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(10,080)	(17,232)	(7,152)
USD	(16,600)	C MDLZ UQ 43.86 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(15,561)	(11,676)	3,885
USD	(166)	C MDLZ UQ 44 16/10/15	2015年10月16日	(10,451)	(4,482)	5,969
USD	(262)	C MDT UN 70.5 06/11/15	2015年11月6日	(25,927)	(26,200)	(273)
USD	(216)	C MDT UN 77.5 02/10/15	2015年10月2日	(28,070)	(864)	27,206
USD	(252)	C MET UN 50 16/10/15	2015年10月16日	(32,704)	(3,780)	28,924

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	(126)	C MET UN 50.5 09/10/15	2015年10月9日	(14,247)	(10,458)	3,789
USD	(80)	C MET UN 50.5 23/10/15	2015年10月23日	(7,197)	(6,400)	797
AUD	(341,545)	C MGR AU 1.7966 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(6,562)	(10,631)	(4,069)
USD	(453)	C MPC UN 49 23/10/15	2015年10月23日	(57,348)	(43,035)	14,313
USD	(190)	C MPC UN 52.5 02/10/15	2015年10月2日	(13,396)	(9,500)	3,896
USD	(190)	C MPC UN 52.5 16/10/15	2015年10月16日	(18,417)	(2,280)	16,137
AUD	(5,867)	C MPL AU 2.4 26/11/15	2015年11月26日	(20,349)	(41,122)	(20,773)
AUD	(483)	C MQG AU 79 29/10/15	2015年10月29日	(53,734)	(60,428)	(6,694)
AUD	(448)	C MQG AU 80 26/11/15	2015年11月26日	(37,883)	(64,685)	(26,802)
AUD	(373)	C MQG AU 81 26/11/15	2015年11月26日	(53,728)	(43,790)	9,938
AUD	(240)	C MQG AU 81.53 17/12/15	2015年12月17日	(19,298)	(29,858)	(10,560)
AUD	(384)	C MQG AU 85 29/10/15	2015年10月29日	(31,454)	(6,729)	24,725
AUD	(193)	C MQG AU 87 29/10/15	2015年10月29日	(15,184)	(1,488)	13,696
USD	(240)	C MRK UN 53.5 02/10/15	2015年10月2日	(15,722)	(720)	15,002
USD	(406)	C MRK UN 54 30/10/15	2015年10月30日	(39,364)	(11,368)	27,996
USD	(161)	C MRK UN 54.5 23/10/15	2015年10月23日	(11,567)	(6,923)	4,644
USD	(370)	C MRK UN 55 09/10/15	2015年10月9日	(39,573)	(1,850)	37,723
USD	(370)	C MRK UN 55 16/10/15	2015年10月16日	(45,863)	(2,590)	43,273
USD	(1,230)	C MRO UN 18 16/10/15	2015年10月16日	(27,008)	(7,380)	19,628
USD	(1,230)	C MRO UN 18 23/10/15	2015年10月23日	(35,618)	(22,140)	13,478
USD	(1,230)	C MRO UN 18 30/10/15	2015年10月30日	(41,768)	(36,900)	4,868
USD	(1,000)	C MRO UN 18.5 02/10/15	2015年10月2日	(54,229)	(8,000)	46,229
GBP	(1,716,036)	C MRW LN 1.7583104 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(50,750)	(156,570)	(105,820)
GBP	(1,788,535)	C MRW LN 1.7649262 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(65,108)	(138,561)	(73,453)
GBP	(1,456,834)	C MRW LN 1.82902 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(20,358)	(4,237)	16,121
GBP	(1,318,317)	C MRW LN 1.9125946 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(62,176)	(25,059)	37,117
GBP	(973,430)	C MRW LN 1.9324925 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(44,364)	(6,428)	37,936
USD	(120)	C MSFT UN 44 09/10/15	2015年10月9日	(11,995)	(7,560)	4,435
USD	(81)	C MSFT UN 45 16/10/15	2015年10月16日	(4,168)	(3,321)	847
USD	(80)	C MSFT UN 45.5 23/10/15	2015年10月23日	(5,777)	(5,360)	417
USD	(81)	C MSFT UN 45.5 30/10/15	2015年10月30日	(8,743)	(5,670)	3,073
USD	(200)	C MSFT UN 46 16/10/15	2015年10月16日	(18,730)	(3,400)	15,330
USD	(81)	C MSFT UN 46 30/10/15	2015年10月30日	(6,017)	(5,184)	833
USD	(100)	C MSFT UQ 45.5 09/10/15	2015年10月9日	(5,410)	(1,400)	4,010
USD	(200)	C MSFT UQ 47.5 02/10/15	2015年10月2日	(17,408)	(200)	17,208
SGD	(200,000)	C MI SP 2.9901 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(3,100)	(607)	2,493
SGD	(200,000)	C MI SP 3.1512 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(3,920)	(1)	3,919
AUD	(1,149)	C NAB AU 31.5 26/11/15	2015年11月26日	(49,739)	(48,320)	1,419
AUD	(1,200)	C NAB AU 31.63 17/12/15	2015年12月17日	(60,673)	(55,932)	4,741
AUD	(1,249)	C NAB AU 31.63 29/10/15	2015年10月29日	(118,757)	(31,953)	86,804
AUD	(1,492)	C NAB AU 32.01 26/11/15	2015年11月26日	(67,113)	(38,692)	28,421
AUD	(1,407)	C NAB AU 32.12 17/12/15	2015年12月17日	(64,397)	(50,788)	13,609
AUD	(1,455)	C NAB AU 32.12 29/10/15	2015年10月29日	(65,723)	(24,985)	40,738
AUD	(978)	C NAB AU 33 26/11/15	2015年11月26日	(66,543)	(15,423)	51,120
AUD	(1,454)	C NAB AU 33.11 29/10/15	2015年10月29日	(61,378)	(10,191)	51,187

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	(2, 276)	C NCM AU 12.25 29/10/15	2015年10月29日	(62, 216)	(153, 941)	(91, 725)
AUD	(1, 690)	C NCM AU 13.25 29/10/15	2015年10月29日	(20, 202)	(54, 488)	(34, 286)
USD	(440)	C NDAQ UQ 51.55 27/10/15 FLEX	2015年10月27日	(68, 620)	(66, 985)	1, 635
USD	(38, 000)	C NDAQ UQ 52.378 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(21, 747)	(27, 572)	(5, 825)
USD	(630)	C NDAQ UQ 53.1 12/10/15 FLEX	2015年10月12日	(111, 481)	(21, 000)	90, 481
USD	(295)	C NLSN UN 46 16/10/15	2015年10月16日	(35, 977)	(23, 895)	12, 082
USD	(260)	C NLSN UN 47 16/10/15	2015年10月16日	(36, 128)	(11, 960)	24, 168
USD	(11, 000)	C NLSN UN 47.83 06/10/15 OTC	2015年10月 6 日	(15, 070)	(294)	14, 776
USD	(555)	C NLSN UN 48 16/10/15	2015年10月16日	(50, 102)	(41, 625)	8, 477
USD	(260)	C NLSN UN 48 20/11/15	2015年11月20日	(44, 768)	(39, 000)	5, 768
USD	(6, 800)	C NOC UN 168.5052 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(29, 338)	(23, 454)	5, 884
USD	(17)	C NOC UN 172.6 06/10/15 FLEX	2015年10月 6 日	(6, 425)	(1, 176)	5, 249
CHF	(5, 513)	C NOVN VX 100.926 09/10/15 OTC	2015年10月 9 日	(3, 180)	(40)	3, 140
CHF	(22, 718)	C NOVN VX 103.924 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(33, 026)	(1, 482)	31, 544
CHF	(22, 718)	C NOVN VX 104.4944 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(34, 950)	(3, 800)	31, 150
CHF	(22, 148)	C NOVN VX 94.0672 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(34, 827)	(51, 245)	(16, 418)
CHF	(21, 964)	C NOVN VX 99.7512 09/12/15 OTC	2015年12月 9 日	(36, 038)	(16, 311)	19, 727
USD	(600)	C NWL UN 43 16/10/15	2015年10月16日	(46, 809)	(1, 800)	45, 009
USD	(56, 000)	C NWL UN 43.04 12/10/15 OTC	2015年10月12日	(46, 794)	(2, 243)	44, 551
USD	(56, 000)	C NWL UN 43.04 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(56, 224)	(10, 886)	45, 338
USD	(89)	C OMC UN 70 16/10/15	2015年10月16日	(18, 775)	(2, 225)	16, 550
USD	(100)	C OMC UN 70 20/11/15	2015年11月20日	(11, 696)	(9, 500)	2, 196
PLN	(597, 457)	C OPL PW 8.12 09/10/15 OTC	2015年10月 9 日	(6, 277)	(348)	5, 929
PLN	(718, 253)	C OPL PW 8.12 09/12/15 OTC	2015年12月 9 日	(23, 905)	(25, 147)	(1, 242)
PLN	(416, 920)	C OPL PW 9.26 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(12, 529)	(83)	12, 446
AUD	(527, 245)	C ORA AU 2.4176 09/12/15 OTC	2015年12月 9 日	(24, 581)	(43, 004)	(18, 423)
AUD	(382, 724)	C ORA AU 2.4725 18/11/15 OTC	2015年11月18日	(15, 742)	(19, 446)	(3, 704)
USD	(360)	C ORCL UN 38.5 02/10/15	2015年10月 2 日	(27, 044)	(360)	26, 684
USD	(190)	C ORCL UN 39 09/10/15	2015年10月 9 日	(12, 744)	(570)	12, 174
AUD	(840)	C ORI AU 17 29/10/15	2015年10月29日	(20, 826)	(4, 416)	16, 410
USD	(19)	C PCG UN 52.51 29/10/15 FLEX	2015年10月29日	(1, 025)	(2, 255)	(1, 230)
USD	(87)	C PEG UN 40.65 03/11/15 FLEX	2015年11月 3 日	(6, 869)	(13, 246)	(6, 377)
USD	(6, 400)	C PEG UN 41.49 06/10/15 OTC	2015年10月 6 日	(6, 047)	(2, 404)	3, 643
USD	(634)	C PFE UN 33 16/10/15	2015年10月16日	(28, 502)	(12, 046)	16, 456
USD	(1, 708)	C PFE UN 33.5 23/10/15	2015年10月23日	(109, 262)	(46, 116)	63, 146
USD	(1, 171)	C PFE UN 33.5 30/10/15	2015年10月30日	(88, 475)	(35, 130)	53, 345
USD	(1, 422)	C PFE UN 34 09/10/15	2015年10月 9 日	(73, 417)	(4, 266)	69, 151
USD	(1, 171)	C PFE UN 34 20/11/15	2015年11月20日	(82, 343)	(39, 814)	42, 529
PLN	(218, 640)	C PGE PW 15.98 09/10/15 OTC	2015年10月 9 日	(4, 323)	(20)	4, 303
PLN	(376, 446)	C PGE PW 16.58 09/12/15 OTC	2015年12月 9 日	(23, 155)	(5, 042)	18, 113
PLN	(349, 302)	C PGE PW 16.87 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(28, 400)	(2, 011)	26, 389
PLN	(355, 880)	C PGE PW 18.48 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(23, 316)	(128)	23, 188
USD	(37)	C PM UN 81.5 23/10/15	2015年10月23日	(2, 907)	(4, 144)	(1, 237)
USD	(18)	C PM UN 82 16/10/15	2015年10月16日	(1, 259)	(954)	305
USD	(33)	C PM UN 82.5 16/10/15	2015年10月16日	(2, 921)	(1, 386)	1, 535

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	(19)	C PM UN 82.5 30/10/15	2015年10月30日	(1,785)	(1,805)	(20)
USD	(25)	C PM UN 85 02/10/15	2015年10月2日	(2,847)	(950)	1,897
USD	(155)	C PRU UN 80 20/11/15	2015年11月20日	(26,037)	(27,125)	(1,088)
USD	(154)	C PRU UN 90 12/10/15 FLEX	2015年10月12日	(27,713)	(25)	27,688
USD	(20)	C PSX UN 80 02/10/15	2015年10月2日	(3,079)	(140)	2,939
USD	(50)	C PSX UN 80 16/10/15	2015年10月16日	(5,621)	(4,250)	1,371
USD	(35)	C PSX UN 81 23/10/15	2015年10月23日	(6,644)	(5,775)	869
USD	(32)	C PSX UN 83.5 09/10/15	2015年10月9日	(4,607)	(2,080)	2,527
AUD	(7,467)	C QAN AU 3.7 29/10/15	2015年10月29日	(50,127)	(94,205)	(44,078)
AUD	(6,025)	C QAN AU 4 29/10/15	2015年10月29日	(73,958)	(27,449)	46,509
AUD	(1,437)	C QBE AU 14 17/12/15	2015年12月17日	(35,427)	(26,691)	8,736
AUD	(1,208)	C QBE AU 14 26/11/15	2015年11月26日	(28,579)	(15,240)	13,339
AUD	(1,115)	C QBE AU 14.25 26/11/15	2015年11月26日	(15,900)	(10,160)	5,740
AUD	(2,474)	C QBE AU 14.5 29/10/15	2015年10月29日	(34,627)	(4,335)	30,292
AUD	(1,886)	C QBE AU 15 26/11/15	2015年11月26日	(36,320)	(6,609)	29,711
AUD	(1,676)	C QBE AU 15 29/10/15	2015年10月29日	(39,944)	(822)	39,122
AUD	(1,691)	C QBE AU 15.5 29/10/15	2015年10月29日	(30,352)	(237)	30,115
USD	(397)	C QCOM UN 56.5 30/10/15	2015年10月30日	(48,726)	(16,277)	32,449
USD	(458)	C QCOM UN 60.5 09/10/15	2015年10月9日	(40,049)	(4,580)	35,469
USD	(350)	C QCOM UN 62.5 16/10/15	2015年10月16日	(39,184)	(700)	38,484
USD	(350)	C QCOM UN 63.5 02/10/15	2015年10月2日	(19,585)	(1,050)	18,535
USD	(329)	C QCOM UQ 57 23/10/15	2015年10月23日	(47,690)	(10,857)	36,833
GBP	(567,324)	C RBS LN 3.5053874 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(39,837)	(52,235)	(12,398)
GBP	(539,251)	C RBS LN 3.63552 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(14,661)	(90)	14,571
GBP	(115,957)	C RBS LN 3.6896 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(9,998)	(4,104)	5,894
GBP	(559,694)	C RBS LN 3.728088 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(56,727)	(8,596)	48,131
GBP	(559,694)	C RBS LN 3.738535 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(47,872)	(1,645)	46,227
EUR	(191,173)	C REN NA 14.8763 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(50,768)	(130,934)	(80,166)
EUR	(168,941)	C REN NA 14.8813 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(15,558)	(31,243)	(15,685)
EUR	(175,346)	C REN NA 15.2328 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(53,604)	(71,637)	(18,033)
EUR	(183,424)	C REN NA 15.4674 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(36,546)	(89,527)	(52,981)
USD	(600)	C RF UN 10 16/10/15	2015年10月16日	(8,827)	(2,400)	6,427
AUD	(325)	C RIO AU 52 26/11/15	2015年11月26日	(22,410)	(29,499)	(7,089)
AUD	(326)	C RIO AU 53 29/10/15	2015年10月29日	(16,877)	(13,138)	3,739
AUD	(358)	C RIO AU 54 17/12/15	2015年12月17日	(19,593)	(25,720)	(6,127)
AUD	(479)	C RIO AU 54 26/11/15	2015年11月26日	(44,354)	(25,851)	18,503
AUD	(763)	C RIO AU 55 26/11/15	2015年11月26日	(56,519)	(31,285)	25,234
AUD	(446)	C RIO AU 56 26/11/15	2015年11月26日	(22,697)	(13,911)	8,786
AUD	(495)	C RIO AU 57 29/10/15	2015年10月29日	(32,865)	(5,204)	27,661
AUD	(2,330)	C RMD AU 7.75 26/11/15	2015年11月26日	(19,593)	(21,230)	(1,637)
AUD	(1,332)	C RMD AU 7.75 29/10/15	2015年10月29日	(14,208)	(7,002)	7,206
AUD	(2,672)	C RMD AU 8 29/10/15	2015年10月29日	(26,060)	(6,555)	19,505
AUD	(3,206)	C RMD AU 8.25 29/10/15	2015年10月29日	(23,211)	(3,371)	19,840
AUD	(3,458)	C RMD AU 8.5 29/10/15	2015年10月29日	(55,278)	(1,212)	54,066
USD	(7,200)	C RTN UN 106.2136 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(9,652)	(28,330)	(18,678)

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	(78)	C RTN UN 107.01 06/10/15 FLEX	2015年10月6日	(17,546)	(13,560)	3,986
USD	(90)	C RTN UN 110 20/11/15	2015年11月20日	(18,172)	(22,500)	(4,328)
EUR	(56,882)	C SAN FP 100.7383 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(113,374)	(21,834)	91,540
EUR	(56,882)	C SAN FP 104.0735 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(97,571)	(4,322)	93,249
EUR	(57,657)	C SAN FP 92.3213 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(107,916)	(153,415)	(45,499)
EUR	(11,136)	C SAN FP 97.3067 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(6,572)	(278)	6,294
EUR	(55,457)	C SAN FP 97.4049 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(93,861)	(60,435)	33,426
AUD	(2,504)	C SCG AU 3.9 26/11/15	2015年11月26日	(16,349)	(26,326)	(9,977)
AUD	(5,095)	C SCG AU 4 26/11/15	2015年11月26日	(27,521)	(35,711)	(8,190)
AUD	(5,088)	C SCG AU 4 29/10/15	2015年10月29日	(17,902)	(21,397)	(3,495)
AUD	(451,454)	C SCG AU 4.0765 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(24,247)	(28,285)	(4,038)
AUD	(5,080)	C SCG AU 4.1 26/11/15	2015年11月26日	(23,549)	(23,144)	405
AUD	(4,784)	C SCG AU 4.1 29/10/15	2015年10月29日	(18,716)	(10,059)	8,657
AUD	(1,112)	C SEK AU 13.5 29/10/15	2015年10月29日	(12,945)	(3,118)	9,827
AUD	(855)	C SEK AU 15.5 29/10/15	2015年10月29日	(23,399)	(599)	22,800
EUR	(221,385)	C SGO FP 42.7214 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(165,840)	(229,197)	(63,357)
EUR	(81,531)	C SGO FP 44.6453 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(21,998)	(197)	21,801
EUR	(200,403)	C SGO FP 46.1881 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(180,014)	(25,188)	154,826
EUR	(206,687)	C SGO FP 46.4656 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(144,108)	(47,155)	96,953
EUR	(222,972)	C SGO FP 47.2139 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(126,391)	(3,160)	123,231
USD	(41,500)	C SLM UQ 8.2951 12/10/15 OTC	2015年10月12日	(8,088)	(1,119)	6,969
USD	(68,000)	C SLM UQ 9.272 12/10/15 OTC	2015年10月12日	(13,947)	(69)	13,878
EUR	(17,802)	C SOLB BB 103.5996 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(22,677)	(30,709)	(8,032)
EUR	(18,555)	C SOLB BB 112.4344 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(31,555)	(8,477)	23,078
EUR	(16,397)	C SOLB BB 114.4488 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(11,320)	(1)	11,319
EUR	(17,018)	C SOLB BB 123.5106 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(46,355)	(800)	45,555
USD	(135)	C SON UN 40 16/10/15	2015年10月16日	(9,309)	(2,700)	6,609
USD	(73,000)	C SPN UN 14.175 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(58,400)	(27,581)	30,819
USD	(10,600)	C SPR UN 52.6948 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(18,004)	(5,614)	12,390
USD	(20)	C SPX UN 1950 30/09/15	2015年9月30日	(58,938)	(100)	58,838
USD	(25)	C SPX UN 1975 20/11/15	2015年11月20日	(84,722)	(60,125)	24,597
USD	(25)	C SPX UN 1980 16/10/15	2015年10月16日	(43,223)	(17,850)	25,373
USD	(35)	C SPXW UN 1950 06/11/15	2015年11月6日	(93,332)	(109,025)	(15,693)
USD	(10)	C SPXW UN 1975 02/10/15	2015年10月2日	(30,889)	(400)	30,489
USD	(25)	C SPXW UN 1985 30/09/15	2015年9月30日	(48,473)	(125)	48,348
CHF	(52,335)	C SREN VX 86.7442 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(66,462)	(100,583)	(34,121)
CHF	(12,312)	C SREN VX 87.8983 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(5,757)	(1,163)	4,594
CHF	(52,114)	C SREN VX 88.2525 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(67,898)	(63,202)	4,696
CHF	(53,454)	C SREN VX 89.175 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(67,336)	(14,245)	53,091
CHF	(53,454)	C SREN VX 89.61 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(71,473)	(30,825)	40,648
SGD	(1,000,000)	C ST SP 3.7275 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(21,100)	(26,881)	(5,781)
SGD	(1,000,000)	C ST SP 3.8213 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(35,800)	(8,073)	27,727
USD	(16,000)	C STJ UN 72.8773 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(25,389)	(6)	25,383
NOK	(106,949)	C STL NO 132.1819 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(26,550)	(36,972)	(10,422)
NOK	(102,614)	C STL NO 134.5074 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(18,104)	(32,666)	(14,562)

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)
NOK	(94,511)	C STL NO 134.6681 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(6,154)	(1,824)	4,330
NOK	(98,095)	C STL NO 142.4038 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(30,022)	(6,535)	23,487
USD	(210)	C STLD UQ 21 16/10/15	2015年10月16日	(9,231)	(1,050)	8,181
AUD	(295,468)	C STO AU 5.7308 18/11/15 OTC	2015年11月18日	(40,277)	(9,506)	30,771
AUD	(1,387)	C STO AU 7.5 29/10/15	2015年10月29日	(19,839)	(97)	19,742
AUD	(2,751)	C STO AU 7.75 29/10/15	2015年10月29日	(37,880)	(193)	37,687
USD	(325)	C SU UN 28 02/10/15	2015年10月2日	(16,724)	(7,150)	9,574
USD	(320)	C SU UN 30 02/10/15	2015年10月2日	(11,826)	(12,160)	(334)
AUD	(1,470)	C SUN AU 12.89 26/11/15	2015年11月26日	(35,853)	(19,061)	16,792
AUD	(1,585)	C SUN AU 13.63 26/11/15	2015年11月26日	(20,163)	(5,555)	14,608
AUD	(1,396)	C SUN AU 14.38 29/10/15	2015年10月29日	(24,667)	(98)	24,569
SEK	(170,390)	C SWEDA SS 200.2288 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(55,722)	(67,671)	(11,949)
SEK	(130,727)	C SWEDA SS 204.2489 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(16,077)	(408)	15,669
SEK	(108,446)	C SWEDA SS 207.7827 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(42,984)	(11,166)	31,818
SEK	(163,431)	C SWEDA SS 210.4044 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(57,637)	(21,827)	35,810
SEK	(179,944)	C SWEDA SS 210.4902 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(67,563)	(3,530)	64,033
USD	(45)	C SWK UN 105 16/10/15	2015年10月16日	(5,578)	(450)	5,128
AUD	(2,212)	C SYD AU 6 26/11/15	2015年11月26日	(15,511)	(32,558)	(17,047)
AUD	(2,224)	C TCL AU 10 29/10/15	2015年10月29日	(25,200)	(35,852)	(10,652)
AUD	(249,933)	C TCL AU 10.1278 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(31,239)	(48,253)	(17,014)
AUD	(2,591)	C TCL AU 10.25 26/11/15	2015年11月26日	(19,913)	(37,229)	(17,316)
AUD	(4,089)	C TCL AU 10.5 29/10/15	2015年10月29日	(52,499)	(17,196)	35,303
AUD	(232,546)	C TCL AU 10.5294 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(24,647)	(21,539)	3,108
USD	(43,000)	C TDS UN 27.81 05/11/15 OTC	2015年11月5日	(45,163)	(3,561)	41,602
USD	(49,000)	C TDS UN 27.86 05/10/15 OTC	2015年10月5日	(43,174)	(3)	43,171
USD	(49,000)	C TDS UN 27.86 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(50,842)	(1,519)	49,323
PHP	(20,000)	C TEL PM 2627.04 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(8,652)	(85)	8,567
USD	(140)	C TER UN 19 16/10/15	2015年10月16日	(5,514)	(840)	4,674
USD	(320)	C TER UN 20 16/10/15	2015年10月16日	(14,066)	(640)	13,426
USD	(140)	C TER UN 20 20/11/15	2015年11月20日	(7,554)	(2,100)	5,454
USD	(81)	C TEVA UN 62 06/11/15	2015年11月6日	(6,620)	(2,997)	3,623
USD	(80)	C TEVA UN 63 23/10/15	2015年10月23日	(7,733)	(2,640)	5,093
USD	(272)	C TEVA UN 64.5 09/10/15	2015年10月9日	(27,732)	(1,360)	26,372
USD	(44)	C TEVA UN 66 23/10/15	2015年10月23日	(4,288)	(1,540)	2,748
USD	(138)	C TEVA UN 70 02/10/15	2015年10月2日	(26,766)	(690)	26,076
AUD	(426,847)	C TLS AU 5.8906 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(22,061)	(7,438)	14,623
AUD	(7,607)	C TLS AU 6 26/11/15	2015年11月26日	(53,161)	(26,659)	26,502
AUD	(8,095)	C TLS AU 6.5 29/10/15	2015年10月29日	(63,700)	(567)	63,133
USD	(10,000)	C TOT UN 46.559 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(11,700)	(10,095)	1,605
USD	(74)	C TOT UN 47.5 16/10/15	2015年10月16日	(4,745)	(1,850)	2,895
USD	(120)	C TOT UN 48 09/11/15 FLEX	2015年11月9日	(11,395)	(9,805)	1,590
USD	(120)	C TOT UN 48 20/11/15 FLEX	2015年11月20日	(13,195)	(12,024)	1,171
USD	(2,800)	C TOT UN 50.8099 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(2,624)	(8)	2,616
GBP	(2,878,112)	C TSCO LN 1.9848531 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(93,411)	(268,266)	(174,855)
GBP	(2,999,705)	C TSCO LN 2.004525 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(123,079)	(220,671)	(97,592)

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	(2,650,858)	C TSCO LN 2.0465657 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(41,069)	(9,676)	31,393
GBP	(2,751,354)	C TSCO LN 2.184567 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(130,622)	(41,505)	89,117
GBP	(2,751,354)	C TSCO LN 2.277792 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(148,154)	(8,293)	139,861
USD	(181)	C TSN UN 44 16/10/15	2015年10月16日	(15,196)	(5,430)	9,766
USD	(189)	C TSN UN 44 20/11/15	2015年11月20日	(23,800)	(24,759)	(959)
USD	(34,800)	C TSS UN 46.124 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(54,034)	(31,117)	22,917
TRY	(672,877)	C TTKOM TI 6.39113 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(6,390)	(3,188)	3,202
TRY	(763,867)	C TTKOM TI 6.612 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(21,731)	(33,724)	(11,993)
TRY	(464,715)	C TTKOM TI 6.7275 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(11,076)	(20,148)	(9,072)
TRY	(399,305)	C TTKOM TI 7.31696 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(19,432)	(1,877)	17,555
TRY	(634,649)	C TTKOM TI 7.7056 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(28,207)	(399)	27,808
USD	(49)	C UAL UN 57.5 06/11/15	2015年11月6日	(10,582)	(7,203)	3,379
USD	(97)	C UAL UN 60 02/10/15	2015年10月2日	(14,793)	(97)	14,696
USD	(260)	C UGI UN 35 16/10/15	2015年10月16日	(11,429)	(11,700)	(271)
SGD	(120,000)	C UOB SP 19.4565 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(6,696)	(7,497)	(801)
SGD	(120,000)	C UOB SP 20.14 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(10,380)	(696)	9,684
EUR	(159,574)	C UPM1V FH 15.1772 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(35,838)	(43,521)	(7,683)
EUR	(114,371)	C UPM1V FH 16.2393 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(11,196)	(4)	11,192
EUR	(153,486)	C UPM1V FH 16.514 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(37,460)	(10,073)	27,387
EUR	(73,865)	C UPM1V FH 18.0044 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(25,654)	(388)	25,266
EUR	(157,428)	C UPM1V FH 18.312 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(46,307)	(27)	46,280
USD	(27)	C UPS UN 99 02/10/15	2015年10月2日	(4,077)	(2,430)	1,647
USD	(194)	C VIAB UQ 45 16/10/15	2015年10月16日	(21,137)	(19,400)	1,737
USD	(843)	C VIAB UQ 45.75 10/11/15 FLEX	2015年11月10日	(188,793)	(140,961)	47,832
EUR	(24,979)	C VIG AV 28.8451 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(9,098)	(9,194)	(96)
EUR	(23,510)	C VIG AV 29.5392 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(12,279)	(4,229)	8,050
EUR	(29,177)	C VIG AV 29.8632 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(5,315)	(9)	5,306
EUR	(21,579)	C VIG AV 32.5218 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(13,892)	(166)	13,726
EUR	(27,033)	C VIG AV 33.9012 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(14,856)	(16)	14,840
EUR	(91,106)	C VK FP 10.7807 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(12,457)	(14,998)	(2,541)
EUR	(83,913)	C VK FP 12.441 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(5,239)	(4)	5,235
EUR	(94,955)	C VK FP 12.5512 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(11,464)	(4,036)	7,428
EUR	(133,207)	C VK FP 14.8096 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(35,359)	(709)	34,650
USD	(500)	C VLO UN 62 30/10/15	2015年10月30日	(98,477)	(75,000)	23,477
USD	(667)	C VLO UN 63 02/10/15	2015年10月2日	(62,836)	(8,671)	54,165
USD	(795)	C VLO UN 65 16/10/15	2015年10月16日	(75,090)	(39,750)	35,340
GBP	(2,660,896)	C VOD LN 2.2415152 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(123,890)	(164,916)	(41,026)
GBP	(2,409,640)	C VOD LN 2.4237028 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(105,559)	(41,861)	63,698
GBP	(1,191,641)	C VOD LN 2.5121615 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(22,444)	(18)	22,426
GBP	(2,271,575)	C VOD LN 2.594345 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(161,057)	(9,840)	151,217
GBP	(2,679,959)	C VOD LN 2.636165 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(161,877)	(1,502)	160,375
USD	(607)	C VZ UN 45 06/11/15	2015年11月6日	(29,717)	(21,245)	8,472
USD	(607)	C VZ UN 45 20/11/15	2015年11月20日	(39,429)	(30,350)	9,079
USD	(528)	C VZ UN 46 30/10/15	2015年10月30日	(18,002)	(6,336)	11,666
USD	(449)	C VZ UN 47 09/10/15	2015年10月9日	(23,664)	(898)	22,766

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	(400)	C VZ UN 47 16/10/15	2015年10月16日	(13, 183)	(800)	12, 383
USD	(900)	C VZ UN 48 02/10/15	2015年10月2日	(48, 056)	(900)	47, 156
AUD	(1, 448)	C WBC AU 31.01 26/11/15	2015年11月26日	(91, 961)	(64, 954)	27, 007
AUD	(1, 496)	C WBC AU 31.8 17/12/15	2015年12月17日	(111, 473)	(67, 631)	43, 842
AUD	(882)	C WBC AU 32 29/10/15	2015年10月29日	(50, 415)	(14, 837)	35, 578
AUD	(1, 191)	C WBC AU 32.3 17/12/15	2015年12月17日	(57, 533)	(42, 573)	14, 960
AUD	(930)	C WBC AU 32.5 26/11/15	2015年11月26日	(73, 082)	(22, 488)	50, 594
AUD	(1, 130)	C WBC AU 32.5 28/01/16	2016年1月28日	(60, 552)	(46, 729)	13, 823
AUD	(1, 137)	C WBC AU 34 26/11/15	2015年11月26日	(41, 201)	(11, 157)	30, 044
AUD	(1, 406)	C WBC AU 34.5 29/10/15	2015年10月29日	(52, 260)	(2, 464)	49, 796
AUD	(1, 197)	C WBC AU 36.5 29/10/15	2015年10月29日	(46, 960)	(252)	46, 708
AUD	(747)	C WES AU 41.5 26/11/15	2015年11月26日	(25, 780)	(30, 105)	(4, 325)
AUD	(810)	C WES AU 41.5 29/10/15	2015年10月29日	(36, 139)	(15, 045)	21, 094
AUD	(698)	C WES AU 42.5 26/11/15	2015年11月26日	(21, 785)	(17, 123)	4, 662
USD	(69)	C WFC UN 52.5 06/11/15	2015年11月6日	(4, 277)	(6, 693)	(2, 416)
USD	(70)	C WFC UN 52.5 16/10/15	2015年10月16日	(10, 788)	(4, 480)	6, 308
USD	(35)	C WFC UN 53 09/10/15	2015年10月9日	(3, 393)	(665)	2, 728
USD	(35)	C WFC UN 53 23/10/15	2015年10月23日	(4, 271)	(1, 995)	2, 276
USD	(75)	C WFC UN 53 30/10/15	2015年10月30日	(4, 434)	(5, 475)	(1, 041)
USD	(17)	C WFC UN 53.5 30/10/15	2015年10月30日	(1, 070)	(935)	135
AUD	(2, 011)	C WFD AU 10.25 29/10/15	2015年10月29日	(20, 133)	(22, 552)	(2, 419)
AUD	(1, 049)	C WFD AU 10.5 26/11/15	2015年11月26日	(11, 312)	(13, 970)	(2, 658)
AUD	(2, 113)	C WFD AU 10.5 29/10/15	2015年10月29日	(20, 761)	(13, 329)	7, 432
AUD	(1, 741)	C WFD AU 10.75 17/12/15	2015年12月17日	(19, 271)	(21, 965)	(2, 694)
AUD	(1, 915)	C WFD AU 10.75 26/11/15	2015年11月26日	(26, 316)	(16, 778)	9, 538
EUR	(94, 460)	C WKL NA 29.0703 22/12/15 OTC	2015年12月22日	(57, 642)	(79, 527)	(21, 885)
EUR	(90, 859)	C WKL NA 30.5942 09/12/15 OTC	2015年12月9日	(49, 748)	(30, 681)	19, 067
EUR	(18, 241)	C WKL NA 30.963 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(3, 197)	(15)	3, 182
EUR	(93, 191)	C WKL NA 30.9937 17/11/15 OTC	2015年11月17日	(58, 287)	(15, 167)	43, 120
EUR	(93, 191)	C WKL NA 31.5079 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(49, 246)	(1, 659)	47, 587
USD	(190)	C WMT UN 68 09/10/15	2015年10月9日	(15, 558)	(950)	14, 608
AUD	(560)	C WOW AU 27 17/12/15	2015年12月17日	(24, 454)	(19, 036)	5, 418
AUD	(853)	C WOW AU 27 26/11/15	2015年11月26日	(44, 122)	(21, 224)	22, 898
AUD	(700)	C WOW AU 29 29/10/15	2015年10月29日	(37, 668)	(1, 472)	36, 196
AUD	(559)	C WPL AU 31.26 17/12/15	2015年12月17日	(40, 528)	(43, 960)	(3, 432)
AUD	(455)	C WPL AU 33 26/11/15	2015年11月26日	(20, 225)	(13, 554)	6, 671
AUD	(565)	C WPL AU 34 26/11/15	2015年11月26日	(29, 935)	(10, 494)	19, 441
USD	(210)	C WU UN 19 16/10/15	2015年10月16日	(5, 987)	(2, 730)	3, 257
USD	(210)	C WU UN 20 20/11/15	2015年11月20日	(6, 204)	(4, 200)	2, 004
USD	(75)	C WYN UN 82.5 16/10/15	2015年10月16日	(7, 422)	(7, 125)	297
USD	(32, 000)	C XL UN 37.72 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(25, 437)	(12, 840)	12, 597
USD	(175)	C XL UN 38 16/10/15	2015年10月16日	(7, 693)	(5, 075)	2, 618
USD	(175)	C XL UN 40 16/10/15	2015年10月16日	(8, 020)	(2, 275)	5, 745
KRW	(20, 000)	C 005830 KS 55608.6321 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(28, 836)	(97, 091)	(68, 255)
KRW	(15, 000)	C 017670 KS 256897.36 22/10/15 OTC	2015年10月22日	(52, 464)	(122, 864)	(70, 400)

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
KRW	(18,000)	C 033780 KS 109212.6476 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(29,086)	(48,518)	(19,432)
KRW	(30,000)	C 035250 KS 45156 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(23,130)	(4,248)	18,882
HKD	(300,000)	C 1052 HK 4.8654 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(2,640)	(3,555)	(915)
HKD	(300,000)	C 1052 HK 4.872 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(2,340)	(3,219)	(879)
HKD	(150,000)	C 1113 HK 58.422 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(15,105)	(16,288)	(1,183)
HKD	(800,000)	C 1199 HK 10.1535 13/11/15 OTC	2015年11月13日	(10,320)	(29,058)	(18,738)
HKD	(800,000)	C 1199 HK 10.228 30/11/15 OTC	2015年11月30日	(10,320)	(30,833)	(20,513)
HKD	(4,500,000)	C 1288 HK 3.074 22/10/15 OTC	2015年10月22日	(30,150)	(22,749)	7,401
HKD	(4,500,000)	C 1288 HK 3.3496 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(39,600)	(801)	38,799
HKD	(6,000,000)	C 1398 HK 4.988 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(65,400)	(11,574)	53,826
HKD	(6,000,000)	C 1398 HK 5.2587 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(54,000)	(31)	53,969
HKD	(500,000)	C 177 HK 10.0028 22/10/15 OTC	2015年10月22日	(10,350)	(14,440)	(4,090)
HKD	(600,000)	C 177 HK 9.7202 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(12,120)	(25,971)	(13,851)
HKD	(600,000)	C 1813 HK 5.2909 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(9,300)	(10,479)	(1,179)
HKD	(150,000)	C 1836 HK 19.7789 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(2,850)	(2,579)	271
HKD	(150,000)	C 1836 HK 19.7912 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(2,985)	(1,022)	1,963
JPY	(11,000)	C 1878 JT 13140.135 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(6,263)	(2,630)	3,633
JPY	(8,000)	C 1878 JT 13456.0971 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(8,704)	(107)	8,597
JPY	(50,000)	C 1925 JT 3015.7201 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(11,459)	(32,435)	(20,976)
JPY	(45,000)	C 1925 JT 3102.5229 02/11/15 OTC	2015年11月2日	(16,328)	(32,416)	(16,088)
JPY	(60,000)	C 1925 JT 3157.5096 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(13,740)	(9,479)	4,261
HKD	(800,000)	C 1928 HK 27.195 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(92,240)	(10,019)	82,221
JPY	(120,000)	C 1928 JT 1813.9935 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(23,360)	(67,260)	(43,900)
JPY	(90,000)	C 1928 JT 1980.9922 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(13,610)	(7,608)	6,002
TWD	(2,000,000)	C 2325 TT 35.6035 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(36,201)	(319,479)	(283,278)
TWD	(750,000)	C 2330 TT 133.6867 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(29,700)	(17,660)	12,040
TWD	(1,100,000)	C 2330 TT 136.21 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(56,430)	(31,312)	25,118
TWD	(600,000)	C 2330 TT 141.775 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(25,140)	(38)	25,102
TWD	(300,000)	C 2347 TT 34.2825 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(3,660)	(3,039)	621
HKD	(1,500,000)	C 2380 HK 4.7939 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(26,850)	(57,884)	(31,034)
TWD	(250,000)	C 2382 TT 60.883 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(5,600)	(2,865)	2,735
TWD	(250,000)	C 2382 TT 62.2272 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(3,650)	(34)	3,616
HKD	(1,100,000)	C 2388 HK 23.8875 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(73,590)	(72,508)	1,082
HKD	(1,100,000)	C 2388 HK 24.3329 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(103,620)	(19,185)	84,435
JPY	(28,000)	C 2503 JT 1720.6122 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(2,079)	(1,540)	539
JPY	(22,000)	C 2503 JT 1742.8576 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(1,654)	(148)	1,506
HKD	(300,000)	C 2601 HK 29.754 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(36,900)	(28,526)	8,374
HKD	(350,000)	C 2628 HK 29.0287 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(29,295)	(7,667)	21,628
HKD	(400,000)	C 2628 HK 29.1384 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(22,960)	(21,119)	1,841
JPY	(5,000)	C 2651 JT 9208.5771 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(2,378)	(4,577)	(2,199)
JPY	(6,000)	C 2651 JT 9365.6057 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(2,983)	(1,729)	1,254
JPY	(40,000)	C 2914 JT 4604.6 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(15,266)	(525)	14,741
JPY	(60,000)	C 2914 JT 4647.2818 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(11,745)	0	11,745
JPY	(60,000)	C 2914 JT 4889.9496 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(14,475)	(20)	14,455
HKD	(300,000)	C 321 HK 7.0808 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(6,420)	(8,182)	(1,762)

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)
HKD	(300,000)	C 321 HK 7.0808 12/11/15 OTC	2015年11月12日	(5,730)	(9,164)	(3,434)
HKD	(200,000)	C 321 HK 7.7099 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(4,320)	(22)	4,298
HKD	(300,000)	C 321 HK 7.844 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(5,370)	(591)	4,779
JPY	(16,000)	C 3382 JT 5460.0429 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(6,000)	(22,377)	(16,377)
JPY	(19,000)	C 3382 JT 5603.581 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(6,789)	(5,960)	829
JPY	(19,000)	C 3382 JT 5817.157 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(8,794)	(9,917)	(1,123)
JPY	(55,000)	C 3405 JT 1454.1174 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(6,579)	(21,401)	(14,822)
JPY	(50,000)	C 3405 JT 1583.9064 22/10/15 OTC	2015年10月22日	(4,569)	(4,092)	477
JPY	(120,000)	C 3407 JT 903.4337 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(7,725)	(11,981)	(4,256)
JPY	(150,000)	C 3407 JT 993.6 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(10,434)	(981)	9,453
TWD	(800,000)	C 3702 TT 33.058 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(11,040)	(2,331)	8,709
TWD	(700,000)	C 3702 TT 34.8928 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(6,860)	(4)	6,856
HKD	(4,000,000)	C 386 HK 4.767 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(61,600)	(117,397)	(55,797)
HKD	(3,000,000)	C 386 HK 5.3265 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(63,900)	(4,839)	59,061
HKD	(600,000)	C 3918 HK 5.0668 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(8,340)	(3,610)	4,730
HKD	(500,000)	C 3918 HK 5.3856 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(8,200)	(355)	7,845
HKD	(7,000,000)	C 3988 HK 3.763 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(60,900)	(15,436)	45,464
HKD	(7,000,000)	C 3988 HK 4.1462 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(60,200)	(36)	60,164
JPY	(200,000)	C 4005 JT 639.36 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(10,655)	(8,775)	1,880
JPY	(100,000)	C 4005 JT 686.482 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(5,266)	(1,805)	3,461
JPY	(30,000)	C 4185 JT 1867.17 02/11/15 OTC	2015年11月2日	(3,929)	(6,107)	(2,178)
JPY	(36,000)	C 4185 JT 1999.06 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(8,019)	(881)	7,138
JPY	(38,000)	C 4185 JT 2180.5718 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(4,677)	0	4,677
JPY	(72,000)	C 4188 JT 662.3883 22/10/15 OTC	2015年10月22日	(4,053)	(7,275)	(3,222)
JPY	(70,000)	C 4188 JT 697.2102 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(6,060)	(1,547)	4,513
JPY	(90,000)	C 4188 JT 761.147 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(6,860)	(5)	6,855
JPY	(35,000)	C 4502 JT 5793.96 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(7,643)	(5,497)	2,146
JPY	(22,000)	C 4502 JT 6159.99 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(6,186)	(262)	5,924
JPY	(29,000)	C 4502 JT 6190.699 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(10,967)	(8)	10,959
JPY	(90,000)	C 4503 JT 1787.94 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(11,774)	(1,829)	9,945
JPY	(90,000)	C 4503 JT 1794.39 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(10,496)	(327)	10,169
JPY	(30,000)	C 4578 JT 4304.5736 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(14,551)	(3,572)	10,979
JPY	(30,000)	C 4578 JT 4451.5238 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(8,020)	(197)	7,823
JPY	(80,000)	C 4902 JT 1421.628 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(7,614)	(2,422)	5,192
JPY	(100,000)	C 4902 JT 1466.31 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(8,179)	(580)	7,599
JPY	(70,000)	C 4902 JT 1469.9101 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(8,218)	(1,605)	6,613
JPY	(280,000)	C 5020 JT 458.8031 02/11/15 OTC	2015年11月2日	(9,552)	(13,500)	(3,948)
JPY	(260,000)	C 5020 JT 497.9798 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(11,407)	(1,028)	10,379
JPY	(21,000)	C 5108 JT 4313.13 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(5,930)	(7,723)	(1,793)
JPY	(25,000)	C 5108 JT 4441.176 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(6,665)	(9,527)	(2,862)
JPY	(120,000)	C 5201 JT 801.92 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(9,205)	(2,060)	7,145
JPY	(100,000)	C 5201 JT 823.9 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(5,009)	(261)	4,748
JPY	(100,000)	C 5201 JT 873.4 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(5,485)	0	5,485
JPY	(12,000)	C 5334 JT 3227.143 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(2,138)	(240)	1,898
JPY	(70,000)	C 5401 JT 2866.31 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(12,661)	0	12,661

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(45,000)	C 5411 JT 1989.1575 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(8,718)	(7)	8,711
HKD	(300,000)	C 551 HK 29.172 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(13,890)	(15,237)	(1,347)
HKD	(800,000)	C 576 HK 8.7372 06/11/15 OTC	2015年11月6日	(18,000)	(28,617)	(10,617)
HKD	(800,000)	C 576 HK 8.829 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(19,200)	(12,009)	7,191
JPY	(80,000)	C 5802 JT 1622.16 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(12,765)	(13,101)	(336)
JPY	(60,000)	C 5802 JT 1726.92 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(5,174)	(47)	5,127
HKD	(250,000)	C 590 HK 19.803 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(14,050)	(12,711)	1,339
HKD	(250,000)	C 590 HK 20.1824 05/11/15 OTC	2015年11月5日	(11,125)	(17,120)	(5,995)
JPY	(45,000)	C 6301 JT 1293.4248 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(5,048)	(5,750)	(702)
JPY	(40,000)	C 6301 JT 2147.04 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(5,207)	(132)	5,075
JPY	(40,000)	C 6301 JT 2260.98 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(6,424)	0	6,424
JPY	(160,000)	C 6501 JT 652.41 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(5,001)	(6,869)	(1,868)
JPY	(190,000)	C 6501 JT 692.15 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(6,531)	(609)	5,922
JPY	(230,000)	C 6501 JT 777.444 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(7,326)	0	7,326
JPY	(120,000)	C 6503 JT 1294.92 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(11,134)	(963)	10,171
JPY	(110,000)	C 6503 JT 1298.1633 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(12,596)	(1,743)	10,853
JPY	(80,000)	C 6503 JT 1313.45 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(8,521)	(103)	8,418
JPY	(65,000)	C 6724 JT 2083.32 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(11,827)	(373)	11,454
JPY	(60,000)	C 6724 JT 2186.01 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(8,169)	(3)	8,166
HKD	(600,000)	C 6823 HK 9.744 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(6,480)	(12,926)	(6,446)
HKD	(600,000)	C 6823 HK 9.984 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(5,400)	(1,693)	3,707
JPY	(16,000)	C 6902 JT 5521.94 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(6,454)	(1,734)	4,720
JPY	(14,000)	C 6902 JT 5665 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(4,707)	(26)	4,681
JPY	(18,000)	C 6902 JT 5743.21 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(5,202)	(2,492)	2,710
JPY	(11,000)	C 6954 JT 21373.122 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(26,575)	(877)	25,698
JPY	(5,000)	C 6954 JT 21505 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(8,151)	(615)	7,536
JPY	(8,000)	C 6954 JT 21813.0501 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(17,024)	(35)	16,989
JPY	(230,000)	C 7011 JT 618.2 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(9,560)	(2,905)	6,655
JPY	(180,000)	C 7011 JT 630.19 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(6,340)	(736)	5,604
JPY	(160,000)	C 7011 JT 641.683 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(8,169)	(111)	8,058
JPY	(170,000)	C 7201 JT 1151.3521 02/10/15 OTC	2015年10月2日	(12,901)	(269)	12,632
JPY	(150,000)	C 7201 JT 1239.3382 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(10,694)	(1,453)	9,241
JPY	(58,000)	C 7202 JT 1392.5794 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(5,060)	(1,080)	3,980
JPY	(56,000)	C 7202 JT 1464.1 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(5,553)	0	5,553
JPY	(50,000)	C 7203 JT 7395.7849 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(24,405)	(44,799)	(20,394)
JPY	(65,000)	C 7203 JT 7641.041 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(30,065)	(5,700)	24,365
JPY	(60,000)	C 7203 JT 7702.1323 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(34,211)	(12,800)	21,411
JPY	(60,000)	C 7205 JT 1411.0486 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(8,120)	(1,358)	6,762
JPY	(60,000)	C 7205 JT 1415.0299 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(7,508)	(2,428)	5,080
JPY	(29,000)	C 7259 JT 4300.05 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(14,767)	(15,318)	(551)
JPY	(24,000)	C 7259 JT 4565 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(7,829)	(2,604)	5,225
JPY	(27,000)	C 7259 JT 4900.5 05/10/15 OTC	2015年10月5日	(6,166)	(3)	6,163
JPY	(40,000)	C 7267 JT 3800.2829 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(8,866)	(12,243)	(3,377)
JPY	(48,000)	C 7267 JT 4006.9276 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(14,518)	(988)	13,530
JPY	(40,000)	C 7267 JT 4079.6847 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(12,050)	(109)	11,941

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(37,000)	C 7270 JT 4656.054 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(9,020)	(5,903)	3,117
JPY	(36,000)	C 7751 JT 3682.4303 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(7,648)	(9,320)	(1,672)
JPY	(32,000)	C 7751 JT 3997.03 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(10,971)	(578)	10,393
JPY	(42,000)	C 7751 JT 4012.29 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(7,085)	(9)	7,076
JPY	(48,000)	C 7752 JT 1200.8559 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(4,976)	(10,450)	(5,474)
JPY	(45,000)	C 7752 JT 1299.4138 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(3,072)	(2,896)	176
JPY	(100,000)	C 8001 JT 1432.7156 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(10,378)	(5,683)	4,695
JPY	(100,000)	C 8001 JT 1510.0171 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(15,730)	(1,226)	14,504
JPY	(100,000)	C 8001 JT 1510.4705 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(11,336)	(203)	11,133
JPY	(140,000)	C 8002 JT 666.871 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(4,885)	(851)	4,034
JPY	(170,000)	C 8002 JT 693.028 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(7,971)	(1)	7,970
JPY	(80,000)	C 8031 JT 1599.719 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(6,030)	(861)	5,169
JPY	(80,000)	C 8031 JT 1642.3429 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(8,248)	(191)	8,057
JPY	(80,000)	C 8031 JT 1667.8103 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(5,595)	(23)	5,572
JPY	(15,000)	C 8035 JT 6138.8306 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(7,422)	(8,533)	(1,111)
JPY	(8,000)	C 8035 JT 6725.49 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(4,442)	(202)	4,240
JPY	(16,000)	C 8035 JT 6842 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(9,603)	(28)	9,575
JPY	(70,000)	C 8058 JT 2277.3258 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(14,020)	(1,696)	12,324
JPY	(90,000)	C 8058 JT 2307.399 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(19,213)	(35)	19,178
JPY	(90,000)	C 8058 JT 2384.8903 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(11,707)	(252)	11,455
HKD	(900,000)	C 813 HK 11.655 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(29,160)	(46,284)	(17,124)
JPY	(95,000)	C 8304 JT 455.5805 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(1,329)	(1,051)	278
JPY	(90,000)	C 8304 JT 460.051 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(1,723)	(370)	1,353
JPY	(30,000)	C 8316 JT 5006.8432 27/10/15 OTC	2015年10月27日	(9,261)	(7,968)	1,293
JPY	(30,000)	C 8316 JT 5148.1198 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(12,371)	(2,579)	9,792
JPY	(60,000)	C 8332 JT 771.149 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(3,463)	(3,560)	(97)
JPY	(120,000)	C 8354 JT 608.04 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(5,467)	(8,422)	(2,955)
JPY	(800,000)	C 8411 JT 258.336 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(10,003)	(15)	9,988
JPY	(32,000)	C 8591 JT 1673.6693 05/10/15 OTC	2015年10月5日	(3,999)	(204)	3,795
JPY	(35,000)	C 8591 JT 1830.7942 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(4,168)	(206)	3,962
JPY	(120,000)	C 8601 JT 891.99 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(7,285)	(521)	6,764
JPY	(100,000)	C 8601 JT 910.8403 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(3,770)	(817)	2,953
JPY	(12,000)	C 8725 JT 3443.8635 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(4,405)	(4,125)	280
JPY	(40,000)	C 8766 JT 4771.4846 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(18,134)	(20,575)	(2,441)
JPY	(35,000)	C 8766 JT 4933.3349 16/10/15 OTC	2015年10月16日	(8,534)	(3,758)	4,776
JPY	(230,000)	C 9101 JT 314.3621 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(2,650)	(1,245)	1,405
JPY	(220,000)	C 9101 JT 351.87 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(2,943)	(11)	2,932
JPY	(16,000)	C 9201 JT 4570.5 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(4,898)	(5,111)	(213)
JPY	(12,000)	C 9201 JT 4641.45 07/10/15 OTC	2015年10月7日	(2,731)	(337)	2,394
HKD	(4,000,000)	C 939 HK 5.7452 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(45,600)	(9,724)	35,876
HKD	(5,000,000)	C 939 HK 5.9243 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(79,500)	(548)	78,952
HKD	(200,000)	C 941 HK 101.036 06/10/15 OTC	2015年10月6日	(48,860)	(1,457)	47,403
HKD	(200,000)	C 941 HK 94.605 04/11/15 OTC	2015年11月4日	(44,400)	(65,350)	(20,950)
JPY	(36,000)	C 9432 JT 4587.732 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(10,400)	(2,872)	7,528
JPY	(60,000)	C 9432 JT 4775.6465 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(19,192)	(274)	18,918

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
JPY	(50,000)	C 9432 JT 5085.175 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(23,463)	(473)	22,990
JPY	(60,000)	C 9433 JT 2883.6048 30/10/15 OTC	2015年10月30日	(13,157)	(15,916)	(2,759)
JPY	(65,000)	C 9433 JT 2924.4081 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(13,456)	(11,102)	2,354
JPY	(65,000)	C 9433 JT 3231.414 15/10/15 OTC	2015年10月15日	(14,828)	(242)	14,586
JPY	(110,000)	C 9437 JT 2676.24 19/10/15 OTC	2015年10月19日	(29,024)	(38)	28,986
JPY	(70,000)	C 9437 JT 2771.3 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(13,238)	(1)	13,237
JPY	(44,000)	C 9504 JT 1776.7 28/10/15 OTC	2015年10月28日	(3,650)	(4,990)	(1,340)
JPY	(18,000)	C 9513 JT 3920.4 09/10/15 OTC	2015年10月9日	(7,066)	(1,122)	5,944
JPY	(25,000)	C 9513 JT 4022.1903 21/10/15 OTC	2015年10月21日	(8,762)	(3,286)	5,476
JPY	(70,000)	C 9531 JT 627.804 29/10/15 OTC	2015年10月29日	(2,037)	(2,358)	(321)
JPY	(70,000)	C 9531 JT 647.46 23/10/15 OTC	2015年10月23日	(1,604)	(705)	899
JPY	(140,000)	C 9532 JT 510.4472 26/10/15 OTC	2015年10月26日	(3,671)	(1,563)	2,108
JPY	(160,000)	C 9532 JT 532.764 08/10/15 OTC	2015年10月8日	(3,198)	(3)	3,195
JPY	(12,000)	C 9735 JT 7942.58 13/10/15 OTC	2015年10月13日	(7,198)	(722)	6,476
JPY	(12,000)	C 9735 JT 8147.6952 20/10/15 OTC	2015年10月20日	(8,058)	(860)	7,198
HKD	(1,500,000)	C 991 HK 3.0755 05/11/15 OTC	2015年11月5日	(18,300)	(15,201)	3,099
HKD	(1,500,000)	C 991 HK 3.1206 14/10/15 OTC	2015年10月14日	(22,200)	(4,179)	18,021
				(27,665,039)	(16,193,182)	11,471,857
				(27,665,039)	(16,193,182)	11,471,857

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年8月19日）

作成対象期間（2015年8月20日～2016年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		騰	落			
	円		%	%	%	百万円
10期(2012年8月20日)	10,181		0.1	100.7	—	2,216
11期(2013年8月19日)	10,191		0.1	80.9	—	5,297
12期(2014年8月19日)	10,199		0.1	59.7	—	8,648
13期(2015年8月19日)	10,206		0.1	44.7	—	22,034
14期(2016年8月19日)	10,211		0.0	68.6	—	19,722

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

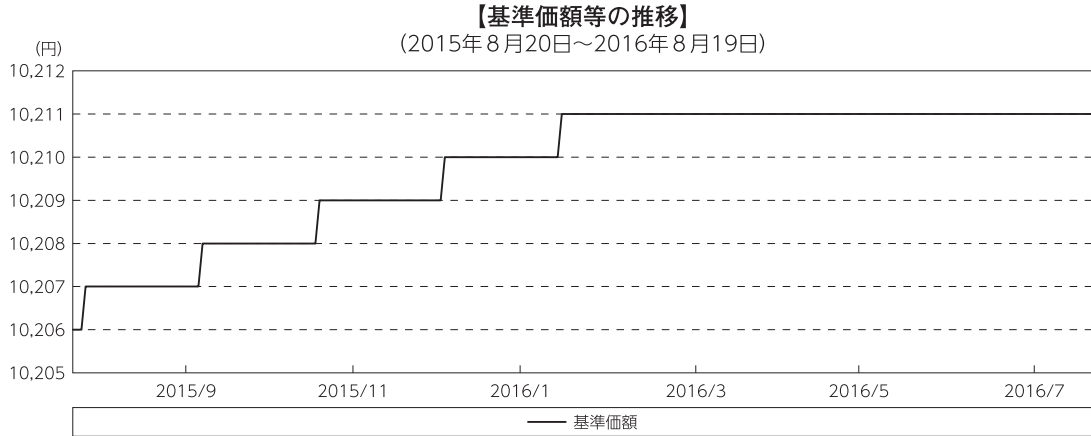
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落		
(期首) 2015年8月19日	円 10,206		% —	% 44.7	% —
8月末	10,207		0.0	48.6	—
9月末	10,207		0.0	43.6	—
10月末	10,208		0.0	44.4	—
11月末	10,209		0.0	48.8	—
12月末	10,209		0.0	48.5	—
2016年1月末	10,210		0.0	51.8	—
2月末	10,211		0.0	49.1	—
3月末	10,211		0.0	40.8	—
4月末	10,211		0.0	39.9	—
5月末	10,211		0.0	62.4	—
6月末	10,211		0.0	58.0	—
7月末	10,211		0.0	65.1	—
(期末) 2016年8月19日	円 10,211		% 0.0	% 68.6	% —

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

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

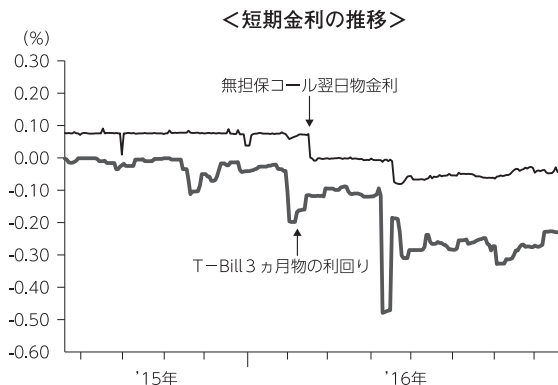
このような中、日本銀行は「量的・質的金融緩和」を継続し、2016年1月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定するなど、一層の金融緩和を図りました。

・無担保コール翌日物金利の推移

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

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

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



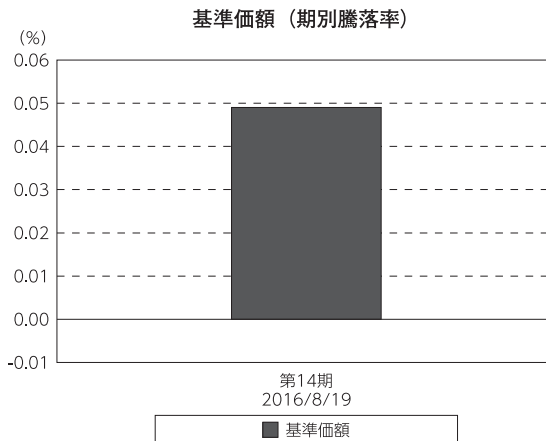
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

今後も、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用してまいります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年8月20日～2016年8月19日)

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

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売買及び取引の状況

(2015年8月20日～2016年8月19日)

公社債

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

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

その他有価証券

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

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2015年8月20日～2016年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	34,695	4,630	13.3	—	—	—
預金	231,734	231,734	100.0	231,734	231,734	100.0

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

○組入資産の明細

(2016年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	2,898,010 (2,898,010)	2,904,779 (2,904,779)	14.7 (14.7)	— (—)	— (—)	— (—)	14.7 (14.7)
特殊債券 (除く金融債)	5,325,000 (5,325,000)	5,333,466 (5,333,466)	27.0 (27.0)	— (—)	— (—)	— (—)	27.0 (27.0)
金融債券	3,780,000 (3,780,000)	3,783,502 (3,783,502)	19.2 (19.2)	— (—)	— (—)	— (—)	19.2 (19.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,500,000 (1,500,000)	1,501,704 (1,501,704)	7.6 (7.6)	— (—)	— (—)	— (—)	7.6 (7.6)
合 計	13,503,010 (13,503,010)	13,523,452 (13,523,452)	68.6 (68.6)	— (—)	— (—)	— (—)	68.6 (68.6)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

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

*比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年8月19日現在)

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	13,523,452	65.9
その他有価証券	1,199,980	5.8
コール・ローン等、その他	5,800,725	28.3
投資信託財産総額	20,524,157	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年8月19日現在)

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

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

○損益の状況 (2015年8月20日～2016年8月19日)

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

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

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

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

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

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

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

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

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。

(2016年11月17日現在)

年 月	日
2016年11月	24
12月	26、27

※2016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。