

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

運用報告書(全体版)

第26期(決算日2024年11月18日)

作成対象期間(2024年5月18日~2024年11月18日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
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2026年11月17日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-日本円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-日本円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(円コース)年2回決算型	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-日本円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-日本円クラス	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(円コース)年2回決算型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行ないません。
	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。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ないません。	

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

●サポートダイヤル
0120-753104 (受付時間) 営業日の午前9時~午後5時
●ホームページ
<https://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分 込 配 金	期 騰 落 中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
22期(2022年11月17日)	17,114	10	△2.6	0.0	—	98.2	1,190
23期(2023年5月17日)	17,825	10	4.2	0.0	—	98.7	1,246
24期(2023年11月17日)	17,830	10	0.1	0.0	—	98.8	797
25期(2024年5月17日)	19,549	10	9.7	0.1	—	98.4	808
26期(2024年11月18日)	19,464	10	△0.4	0.1	—	98.6	757

* 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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	率			
(期 首)	円	%	%	%	%	%
2024年5月17日	19,549	—	0.1	—	98.4	98.4
5月末	19,328	△1.1	0.1	—	98.4	98.4
6月末	19,279	△1.4	0.1	—	98.8	98.8
7月末	19,328	△1.1	0.0	—	98.9	98.9
8月末	19,310	△1.2	0.1	—	98.8	98.8
9月末	19,628	0.4	0.1	—	98.6	98.6
10月末	19,592	0.2	0.1	—	98.3	98.3
(期 末)						
2024年11月18日	19,474	△0.4	0.1	—	98.6	98.6

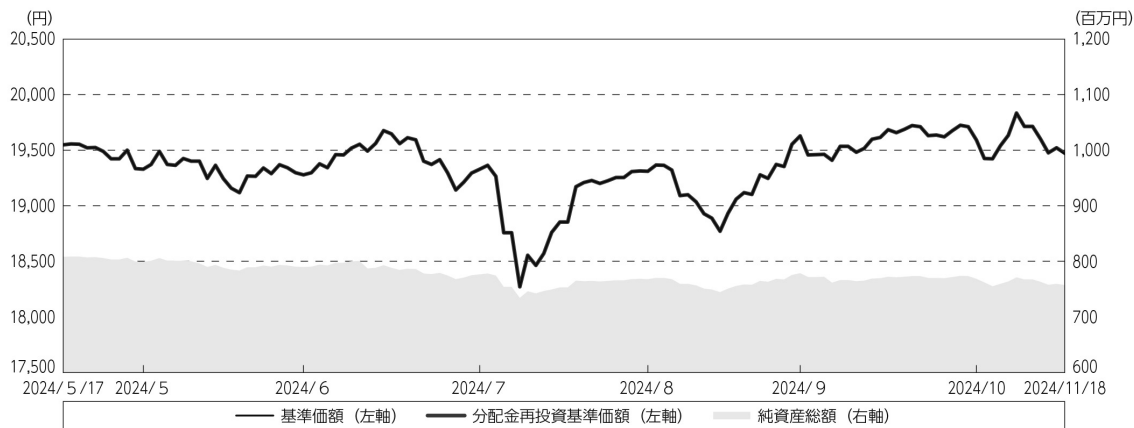
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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

○期中の基準価額等の推移



期 首：19,549円

期 末：19,464円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△0.4%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2024年5月17日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

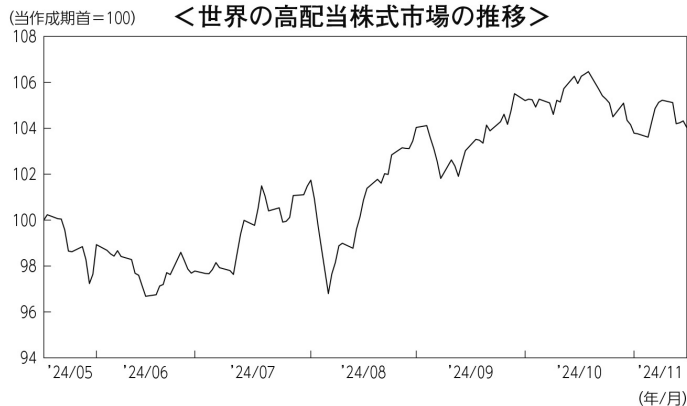
基準価額は、当作成期首19,549円から当作成期末には19,464円となりました。

- ・ 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）

○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のようになりました。



(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、当作成期間で上昇となりました。米国において経済指標の悪化などから景気減速懸念が高まり、下落する局面もございましたが、良好な米企業決算や、FOMC（米連邦公開市場委員会）において政策金利の引き下げが決定される等、FRB（米連邦準備制度理事会）が労働市場を下支えする姿勢を明確化したことなどが好感され、上昇となりました。

●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。

○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（円コース）年2回決算型]

[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・プレミアムー日本円クラス] 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・プレミアムー日本円クラス] 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・プレミアムー日本円クラス]

・ポートフォリオ特性値

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

ポートフォリオ特性値	
組入比率	89.3%
カバー率	38.3%
平均行使価格	112.2%
平均行使期間	36.7日
配当利回り(年率、米ドル為替取引後ベース)*	4.4%
プレミアム(年率)	3.8%

- ・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なった場合は、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ないます。また、当該為替取引では、米ドルの金利が株式など組入資産にかかる通貨の金利より低い場合は為替取引によるコストが発生する場合があります。配当利回りは、組入資産（現地通貨建て）の配当利回りに当該為替取引によるプレミアム／コストを反映し、表示しています。

主要投資対象である [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム] のポートフォリオにおける地域別比率は、当作成期末現在で、米州27.7%、欧州31.9%、アジア・太平洋29.7%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22.2%、生活必需品15.7%、テクノロジー13.6%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ない、プレミアム収入の確保を図りました。

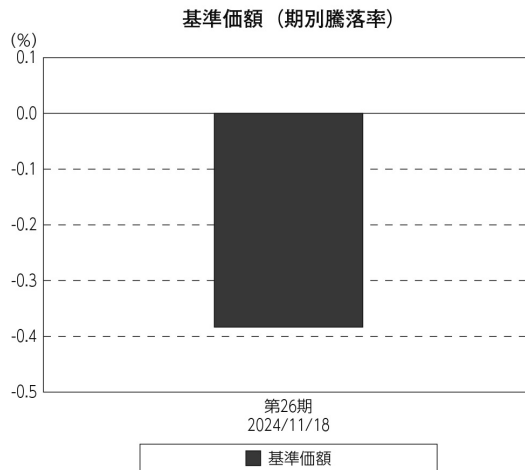
[野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債等の短期有価証券やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と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、期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、分配原資の範囲内で、基準価額水準等を勘案して、分配を行ないました。

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ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第26期
	2024年5月18日～ 2024年11月18日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.051%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	15,131

(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。

◎今後の運用方針

【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】

〔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・プレミアムー日本円クラス〕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・プレミアムー日本円クラス〕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・プレミアムー日本円クラス】

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なった場合は、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ないます。組入資産について、原則として、日本円で為替ヘッジを行ないます。

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

【野村マネー マザーファンド】

残存1年以内の公社債等の短期有価証券やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図ります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年5月18日～2024年11月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	95	0.491	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(38)	(0.195)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(54)	(0.279)	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 ）	(3)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 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	95	0.493	
期中の平均基準価額は、19,410円です。			

* 期中の費用（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。

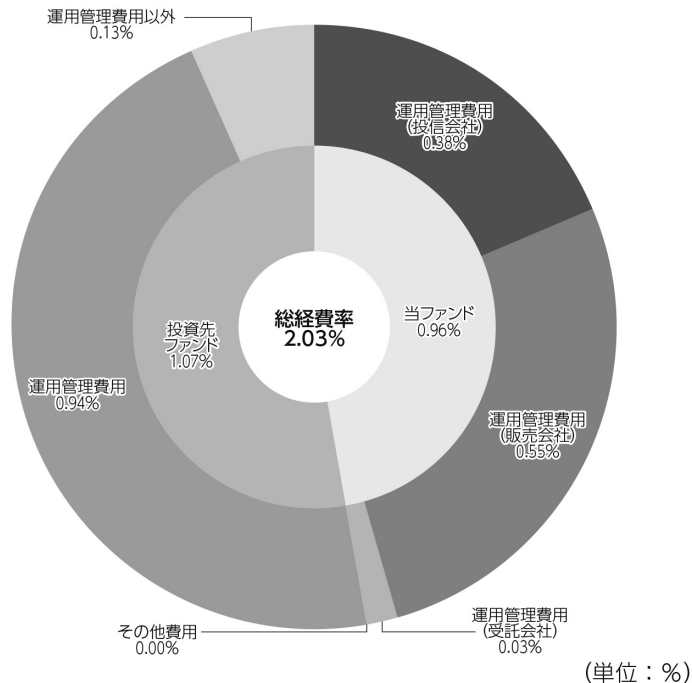
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.03%です。



総経費率 (①+②+③)	2.03
①当ファンドの費用の比率	0.96
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.94
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.13

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

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

(注) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。

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

○売買及び取引の状況

(2024年5月18日～2024年11月18日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 日本円クラス	632	4,852 千円	3,197	25,644 千円

*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

(2024年5月18日～2024年11月18日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型>
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	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 130	百万円 130	100.0	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

(2024年11月18日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額 比 率
	口	口	千円 %
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 日本円クラス	96,194	93,629	746,504 98.6
合 計	96,194	93,629	746,504 98.6

*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	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
野村マネー マザーファンド	983	983	1,003

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年11月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	746,504	98.0
野村マネー マザーファンド	1,003	0.1
コール・ローン等、その他	14,307	1.9
投資信託財産総額	761,814	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（2024年11月18日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	761,814,434
コール・ローン等	14,307,179
投資信託受益証券(評価額)	746,504,017
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,146
未収利息	92
(B) 負債	4,501,544
未払収益分配金	389,088
未払解約金	294,530
未払信託報酬	3,805,014
その他未払費用	12,912
(C) 純資産総額(A-B)	757,312,890
元本	389,088,824
次期繰越損益金	368,224,066
(D) 受益権総口数	389,088,824口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,464円

(注) 期首元本額は413,477,131円、期中追加設定元本額は2,194,760円、期中一部解約元本額は26,583,067円、1口当たり純資産額は1,9464円です。

○損益の状況（2024年5月18日～2024年11月18日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	27,714,204
受取配当金	27,703,311
受取利息	10,893
(B) 有価証券売買損益	△ 26,945,093
売買益	1,255,598
売買損	△ 28,200,691
(C) 信託報酬等	△ 3,817,926
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 3,048,815
(E) 前期繰越損益金	154,563,686
(F) 追加信託差損益金	217,098,283
(配当等相当額)	(323,729,237)
(売買損益相当額)	(△106,630,954)
(G) 計(D+E+F)	368,613,154
(H) 収益分配金	△ 389,088
次期繰越損益金(G+H)	368,224,066
追加信託差損益金	217,098,283
(配当等相当額)	(323,729,237)
(売買損益相当額)	(△106,630,954)
分配準備積立金	265,026,359
繰越損益金	△113,900,576

*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(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（2024年5月18日～2024年11月18日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2024年5月18日～ 2024年11月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	23,897,258円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	323,729,237円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	241,518,189円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	589,144,684円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	15,141円
g. 分配金	389,088円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10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

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する必要の約款変更を行ないました。

<変更適用日：2024年7月4日>

Nomura Multi Managers Fund V – Global High Dividend Equity Premium

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

2023年9月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託								
投 資 目 的	<ul style="list-style-type: none"> ◆世界の高配当株を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行なうことを基本とします。 ◆高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。 								
投 資 態 度	<ul style="list-style-type: none"> ●高配当株を上場市場や所在地、発行通貨等から、「米州」、「欧州」、「アジア・太平洋」の各地域に属する株式に分類します。 ●各地域の株式への投資比率は、原則として、下記の通りとします。 <table border="1"> <thead> <tr> <th>地域名</th> <th>米州</th> <th>欧州</th> <th>アジア・太平洋</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>投資比率</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> </tr> </tbody> </table> <p>※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ●為替にかかる含み損益の状況によっては、一時的に上記のような運用ができない場合があります。 ●高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。 ※市場環境によっては、株式オプションのコール売り以外のオプション取引を行なう場合があります。 ●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なった場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行ないます。ファンドには2つのクラス(日本円クラス、通貨セレクトクラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、米ドルを売り、各クラスの通貨(通貨セレクトクラスについては、米ドル以外の選定通貨)を買う為替取引を行なうことで、各通貨への投資効果を追求します。 <p><通貨セレクトクラスにおける通貨運用方針></p> <ul style="list-style-type: none"> ●原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に(原則、毎月)見直すこととします。 ●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%～30%程度の範囲内に維持することを基本とします。 ●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。 ●投資顧問会社が、高配当株や株式オプションの運用を行な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ないます。 ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋	投資比率	25～50%	25～50%	25～50%
	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋					
投資比率	25～50%	25～50%	25～50%						
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー								
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社								
通 貨 運 用 会 社	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド								
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 銀 行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー								

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

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

純資産計算書
2023年9月30日現在
(金額は米ドル表示)

資産	
投資有価証券時価 (取得原価: 314,979,059米ドル)	319,199,552
現金預金等	35,022,112
デリバティブに係る未収証拠金	525,579
ブローカーからの未収金	28,480
未収収益	597,882
現金および現金同等物に係る利息	3,449
	355,377,054
資産合計	355,377,054
負債	
投資オプション契約時価(売り) (取得原価: 2,079,034米ドル)	1,686,322
外国為替先渡し契約に係る評価差損	4,679,976
未払費用	1,035,620
	7,401,918
負債合計	7,401,918
純資産総額	347,975,136

受益証券一口当たり情報:

	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)	7,860	431,368	3,390,549,503
通貨セレクトクラス(円)	4,040	9,432,357	38,104,227,737

運用計算書
2023年9月30日に終了する計測期間
(金額は米ドル表示)

収益	
銀行口座利息	1,215,951
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	10,360,644
雑収益	3,642
	11,580,237
収益合計	
費用	
投資顧問報酬	3,236,901
事務管理代行報酬	355,732
保管費用	107,075
取引銀行報酬	91,311
銀行手数料	87,066
受託報酬	71,216
法務報酬	8,551
立替費用	71,131
専門家報酬	42,880
その他税金	3,055
雑費用	184,417
	4,259,335
費用合計	
純投資損益	7,320,902
投資有価証券売買に係る損益	7,224,109
オプション契約に係る損益	(1,265,661)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	21,168,958
	27,127,406
当期実現純損益	
投資有価証券評価損益の増減	52,955,246
オプション契約に係る評価損益の増減	(1,359,766)
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(653,285)
	50,942,195
当期評価差損益	
運用の結果による純資産の増減額	85,390,503

純資産変動計算書
2023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	317,720,395
純投資損益	7,320,902
当期実現純損益	27,127,406
当期評価差損益	50,942,195
運用の結果による純資産の増減額	85,390,503
受益証券の発行手取金	11,104,635
受益証券の買戻支払金	(47,055,973)
	(35,951,338)
受益者への支払分配金	(19,184,424)
期末純資産総額	347,975,136

発行済受益証券数の変動表
2023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	458,576
発行受益証券数	38,149
買戻受益証券数	(65,357)
期末発行済受益証券数	431,368
通貨セレクトクラス	
期首受益証券数	10,389,423
発行受益証券数	44,844
買戻受益証券数	(1,001,910)
期末発行済受益証券数	9,432,357

統計情報
2023年9月30日現在
(未監査)

期末純資産総額(米ドル)	2023 347,975,136	2022 317,720,395	2021 438,365,524
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	3,390,549,503	3,407,576,013	4,005,974,076
期末1口当たり純資産価格	7,860	7,431	8,953
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	38,104,227,737	32,931,614,403	36,350,011,146
期末1口当たり純資産価格	4,040	3,170	2,958

組入資産明細
2023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	純資産比率(%)
オーストラリア				
普通株式				
181,770	BHP GROUP LTD *	5,336,152	5,211,668	1.49
21,057	CSL LTD *	4,286,317	3,421,884	0.98
51,994	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA *	3,656,742	3,367,938	0.97
147,947	NTL AUSTRALIA BANK LTD *	2,913,404	2,786,714	0.80
999,397	SOUTH32 LTD-DI	2,291,434	2,219,541	0.64
18,750	MACQUARIE GROUP LTD	2,369,785	2,037,761	0.59
27,673	RIO TINTO LTD	2,313,215	2,036,032	0.59
164,998	QBE INSURANCE	1,527,074	1,679,562	0.48
114,819	GOODMAN GROUP STAPLED	1,637,379	1,595,814	0.46
166,495	BRAMBLES LTD	1,468,314	1,544,847	0.44
60,823	WOOLWORTHS GROUP	1,570,343	1,470,790	0.42
566,367	TELSTRA GROUP LT	1,584,883	1,412,862	0.41
262,483	SANTOS LTD	1,381,724	1,343,598	0.39
47,965	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,303,521	1,269,573	0.36
68,798	COMPUTERSHARE LIMITED	1,145,036	1,157,235	0.33
66,257	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING	1,113,351	1,101,614	0.32
128,188	TRANSURBAN GROUP	1,262,092	1,054,023	0.30
40,932	WOODSIDE ENERGY	935,411	967,783	0.28
131,345	NORTHERN STAR RE	954,850	890,198	0.26
57,536	WESTPAC BANKING CORP *	918,223	788,481	0.23
169,707	BAPCOR LTD	790,406	747,739	0.21
63,834	CORPORATE TRAVEL	908,289	696,936	0.20
82,162	ORIGIN ENERGY LTD	409,491	467,419	0.13
566,215	EML PAYMENTS LTD	1,356,951	431,083	0.12
134,664	SITEMINDER LTD	641,813	403,993	0.12
153,100	STOCKLAND	421,205	388,868	0.11
9,176	WISETECH GLOBAL	370,850	386,760	0.11
197,829	APM HUMAN SERVICE	266,141	236,498	0.07
2,432	MINERAL RESOURCE	131,254	106,572	0.03
950	REA GROUP LTD	85,342	94,992	0.03
		45,350,992	41,318,778	11.87
	合計：オーストラリア	45,350,992	41,318,778	11.87
オーストリア				
普通株式				
36,736	OMV AG	1,688,342	1,770,054	0.51
		1,688,342	1,770,054	0.51
	合計：オーストリア	1,688,342	1,770,054	0.51
ベルギー				
普通株式				
59,232	AGEAS NV	2,403,773	2,461,346	0.71
		2,403,773	2,461,346	0.71
	合計：ベルギー	2,403,773	2,461,346	0.71
バミューダ諸島				
普通株式				
470,000	KUNLUN ENERGY	410,975	405,231	0.12
		410,975	405,231	0.12
	合計：バミューダ諸島	410,975	405,231	0.12
カナダ				
普通株式				
66,120	GILDAN ACTIVEWEA	2,036,155	1,870,535	0.54

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
24,050	SUNCOR ENERGY	824,527	845,598	0.24
15,353	ROGERS COMMUNI-B	781,630	595,082	0.17
		3,642,312	3,311,215	0.95
	合計：カナダ	3,642,312	3,311,215	0.95
	ケイマン諸島			
普通株式				
15,080	ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR	1,500,965	1,322,515	0.39
298,000	CHINA RES LAND	1,258,176	1,187,605	0.34
122,000	CK ASSET HOLDINGS LTD	742,565	642,813	0.18
280,000	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	526,854	362,658	0.10
34,500	SHENZHOU INTL GROUP LTD	339,952	330,508	0.09
5,000	PARADE TECH	157,852	153,137	0.04
84,000	CHINA MEDICAL SY	177,960	127,252	0.04
19,167	CHAILEASE	154,299	107,981	0.03
58,000	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	79,987	97,496	0.03
		4,938,610	4,331,965	1.24
	合計：ケイマン諸島	4,938,610	4,331,965	1.24
	中国			
普通株式				
3,240,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	2,387,395	1,829,229	0.52
2,330,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	1,410,790	1,122,014	0.32
144,500	PING AN	962,753	827,811	0.24
134,800	FUYAO GLASS IN-H	577,491	618,138	0.18
234,000	CHINA PACIFIC INSURANCE CO LTD H	631,434	585,832	0.17
185,000	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD H	977,431	492,696	0.14
290,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	313,516	261,890	0.08
196,000	CHINA NATL BDG-H	199,604	102,896	0.03
		7,460,414	5,840,506	1.68
	合計：中国	7,460,414	5,840,506	1.68
	デンマーク			
普通株式				
137,319	SCANDINAVIAN TOB	2,269,597	2,099,707	0.60
15,520	NOVO-NORDISK- ADR	1,170,332	1,427,995	0.41
		3,439,929	3,527,702	1.01
	合計：デンマーク	3,439,929	3,527,702	1.01
	フィンランド			
普通株式				
142,546	FORTUM OYJ	2,767,678	1,675,123	0.48
		2,767,678	1,675,123	0.48
	合計：フィンランド	2,767,678	1,675,123	0.48
	フランス			
普通株式				
44,735	SANOFI *	4,104,101	4,825,256	1.39
344,242	ORANGE SA	3,935,033	3,964,291	1.14
114,479	AXA	2,441,214	3,440,336	0.99
49,380	BNP PARIBAS	2,680,905	3,169,057	0.91
22,333	ARKEMA	2,050,375	2,240,259	0.64
39,070	AMUNDI SA	2,568,707	2,229,346	0.64
40,230	SANOFI- ADR	1,968,990	2,162,363	0.62
2,186	PUBLICIS GROUPE	119,879	166,652	0.05
		19,869,204	22,197,560	6.38
	合計：フランス	19,869,204	22,197,560	6.38
	ドイツ			
普通株式				
14,668	ALLIANZ AG HOLDING REG	3,253,165	3,522,857	1.00
60,712	BASF SE	2,726,885	2,786,207	0.80
57,411	BAYER AG	3,363,123	2,783,897	0.80
86,114	FRESENIUS SE & CO.KG&A	3,106,216	2,706,184	0.78
35,044	CONTINENTAL A.G.	3,070,509	2,524,429	0.73
37,560	HENKEL KG&A AG & CO	3,095,841	2,388,576	0.69

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
27,696	HEIDELBERG MATER	1,409,193	2,189,567	0.63
113,029	EVONIK INDUSTRIES AG	2,338,321	2,091,283	0.60
913,776	TELEFONICA DEUTS	2,500,324	1,657,249	0.48
111,760	BAYER AG- ADR	2,125,510	1,344,473	0.39
	合計：ドイツ	26,989,087	23,994,722	6.90
	香港			
普通株式				
171,000	LINK REIT REIT	1,450,705	838,741	0.24
76,500	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	1,052,011	818,854	0.23
81,000	AIA GROUP LTD	683,978	660,613	0.19
13,300	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	559,969	497,081	0.14
355,000	HANG LUNG PROPERTIES LTD	731,009	486,098	0.14
351,000	HKT TRUST AND HKT LTD	431,801	366,743	0.11
161,000	CHINA OVERSEAS LAND&INVEST LTD	484,129	333,974	0.10
220,000	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING CO LTD	334,163	273,986	0.08
90,000	SINO LAND	162,887	101,509	0.03
	合計：香港	5,890,652	4,377,599	1.26
	アイルランド			
普通株式				
21,690	MEDTRONIC PLC	1,950,523	1,698,109	0.49
56,687	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	1,663,779	1,498,230	0.43
4,260	WILLIS TOWERS WA	866,966	899,968	0.26
	合計：アイルランド	4,481,268	4,096,307	1.18
	イタリア			
普通株式				
216,645	ENI SPA	3,101,621	3,526,569	1.01
111,430	UNICREDIT SPA	1,032,219	2,705,793	0.78
	合計：イタリア	4,133,840	6,232,362	1.79
	日本			
普通株式				
100,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	602,359	852,630	0.24
75,300	HONDA MOTOR CO LTD	682,746	851,317	0.24
44,300	TOYOTA MOTOR CORP	643,120	797,266	0.23
618,000	NIPPON TELG & TEL CORP	595,326	733,583	0.21
30,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	493,905	698,706	0.20
36,300	ORIX CORP	609,644	681,471	0.20
23,300	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	599,108	628,798	0.18
41,500	ASTELLAS PHARMA INC	632,002	578,531	0.17
15,700	mitsui & CO LTD	348,225	572,281	0.16
33,200	DENSO CORP	488,145	535,797	0.15
8,000	TOYOTA TSUSHO CORP	344,310	472,929	0.14
36,300	ISUZU MOTORS LTD	441,682	458,828	0.13
9,200	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	333,750	454,326	0.13
11,500	ITOCHU CORP	394,830	417,872	0.12
5,100	TOYOTA INDUSTRIES CORP	305,571	403,646	0.12
15,100	CANON INC	370,892	365,891	0.11
18,600	MURATA MANUFACTURING CO LTD	368,575	341,807	0.10
22,300	INPEX CORP	210,015	338,153	0.10
45,500	CHIBA BANK LTD	287,678	332,591	0.10
11,500	mitsui O. S. K. LINES LTD	289,463	317,694	0.09
2,300	TOKYO ELECTRON LTD	253,552	315,994	0.09
8,000	TDK CORP	272,604	298,007	0.09
10,100	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	260,223	294,836	0.08
6,000	MITSUBISHI CORP	186,522	287,468	0.08
31,200	RICOH CO LTD	248,949	270,634	0.08
11,000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	244,782	264,621	0.08
5,000	NIPPON EXPRESS H	296,133	262,242	0.08
31,000	CASIO COMPUTER CO LTD	355,004	261,190	0.08

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
19,700	SUMCO CORP	279,311	258,076	0.07
9,900	MITSUMI CHEMICALS INC	257,015	257,989	0.07
7,300	AGC INC	277,902	257,309	0.07
8,500	MABUCHI MOTOR CO LTD	266,845	255,386	0.07
19,100	SG HOLDINGS CO L	278,803	245,851	0.07
2,100	HIROSE ELECTRIC	264,860	244,476	0.07
6,000	SUZUKI MOTOR CORP	238,243	242,621	0.07
43,000	RESONA HOLDINGS INC	215,241	239,401	0.07
50,500	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	208,572	231,327	0.07
17,000	NISSHIN SEIFUN GROUP INC	232,367	217,735	0.06
17,000	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	204,894	211,279	0.06
29,500	SHIKOKU ELEC PWR	232,540	202,946	0.06
9,000	AICA KOGYO CO	240,311	201,869	0.06
32,500	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	203,486	200,996	0.06
30,500	KYUSHU ELEC PWR	209,581	199,964	0.06
14,300	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	138,181	199,686	0.06
6,900	KOMATSU LTD	161,533	187,509	0.05
14,000	NOK	191,065	186,839	0.05
7,200	MITSUMI MINING & SMELTING CO LTD	182,403	183,660	0.05
12,500	TOKYO TATEMONO CO LTD	154,940	173,752	0.05
4,600	ASAHI GROUP HOLDINGS	169,681	172,838	0.05
4,400	BRIDGESTONE CORP	179,157	172,392	0.05
7,400	IDEMITSU KOSAN CO LTD	177,504	171,004	0.05
11,300	KUBOTA CORP	174,631	167,402	0.05
18,600	OBAYASHI CORP	137,517	164,590	0.05
4,500	MORINAGA & CO	143,662	163,394	0.05
9,500	T&D HOLDINGS INC	127,753	157,594	0.05
11,700	NGK INSULATORS LTD	193,117	155,869	0.04
7,000	NICHIREI CORP	158,205	154,562	0.04
3,600	OTSUKA CORP	141,114	153,219	0.04
6,100	BIPROGY INC	144,001	153,100	0.04
14,500	ZEON CORPORATION	142,968	152,334	0.04
4,300	COSMO ENERGY HD	120,922	152,028	0.04
14,300	BELLSYSTEM24 HOLDINGS INC	168,141	151,867	0.04
7,900	YOKOGAWA BRIDGE	128,512	148,362	0.04
5,000	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	171,299	147,841	0.04
9,200	SUMITOMO WAREHOU	155,125	147,484	0.04
5,700	SUMITOMO OSAKA CEMENT CO LTD	153,401	140,723	0.04
9,800	SATO HOLDINGS CORP	182,037	139,054	0.04
9,800	SEINO HOLDINGS	106,448	138,033	0.04
32,000	OJI HOLDINGS CORPORATION	139,801	135,291	0.04
8,100	KAJIMA CORP	97,399	132,491	0.04
6,200	COMSYS HOLDINGS CORP	134,474	130,272	0.04
3,700	SANKYU INC	132,144	128,602	0.04
21,500	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	116,895	128,501	0.04
17,900	SENKO GROUP HOLDINGS	132,661	126,091	0.04
2,500	TOKYO SEIMITSU CO LTD	101,986	125,861	0.04
4,600	JSR CORPORATION	102,039	124,202	0.04
4,500	TAIYO YUDEN CO LTD	127,468	122,470	0.04
7,100	TAIYO HOLDINGS CO LTD	149,773	122,362	0.04
6,700	DENKA CO LTD	170,580	121,728	0.03
6,900	SCSK CORP	109,499	121,002	0.03
7,100	USS CO LTD	118,158	117,995	0.03
11,600	AMADA CO LTD	117,067	117,306	0.03
7,800	SEKISUI CHEM CO	116,656	112,878	0.03
7,600	KOEI TECMO HOLDI	131,936	108,579	0.03
2,500	NIPPON SHINYAKU CO LTD	140,304	106,352	0.03
21,500	NISSUI CORP	98,766	105,741	0.03
3,900	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	91,334	101,973	0.03
16,400	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	82,786	101,305	0.03
3,700	SUNDRUG CO LTD	100,591	100,847	0.03
4,800	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	111,512	98,145	0.03
2,000	SCREEN HOLDINGS CO LTD	62,633	97,879	0.03
7,700	STAR MICRONICS CO LTD	102,327	97,198	0.03
2,700	NOEVIR HOLDING CO LTD	120,125	96,004	0.03
4,300	INABA DENKISANGYO CO LTD	96,125	93,500	0.03
4,900	NET ONE SYSTEMS	109,976	93,471	0.03

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)	
13,700	MITSUBISHI HC CAPITAL INC	60,094	91,717	0.03	
5,500	BROTHER INDS LTD	87,599	89,039	0.03	
1,400	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	66,715	83,713	0.02	
4,400	MEITEC GROUP HOL	73,295	79,970	0.02	
1,800	SUMITOMO BAKELIT	55,827	78,920	0.02	
500	HIKARI TSUSHIN INC	79,070	76,542	0.02	
5,700	SANWA HOLDINGS CORP	58,640	76,166	0.02	
3,400	SOJITZ CORPORATION	59,077	74,913	0.02	
4,800	TOYO TIRE CORP	69,234	74,271	0.02	
3,600	FUJIMI INC	52,473	72,714	0.02	
6,400	PANASONIC HOLDINGS	63,504	72,356	0.02	
1,900	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	66,669	71,913	0.02	
3,400	INABATA & CO	48,230	71,531	0.02	
5,600	PIGEON CORP	159,403	63,556	0.02	
6,100	ITOCHE ENEX CO	56,524	61,707	0.02	
5,400	FURUKAWA CO	59,163	60,978	0.02	
8,000	NISSHINBO HOLDINGS INC	60,214	59,795	0.02	
3,300	TOYO SEIKAN GROUP HOLDINGS LTD	41,842	54,288	0.02	
2,900	KANAMOTO CO LTD	66,882	51,187	0.01	
2,600	NSD CO LTD	45,811	49,562	0.01	
4,500	SANKI ENGINEERING CO LTD	49,716	49,091	0.01	
4,500	SANTEN PHARM	34,753	41,544	0.01	
4,400	SAKATA INX CORP	51,275	38,092	0.01	
1,000	KAO CORP	64,928	37,311	0.01	
1,200	DENTSU GROUP INC	39,115	35,490	0.01	
		23,357,471	25,275,882	7.26	
	合計：日本	23,357,471	25,275,882	7.26	
	ジャージー				
普通株式	244,433	WPP PLC ORD GBP 0.1	2,815,670	2,203,746	0.63
			2,815,670	2,203,746	0.63
	合計：ジャージー		2,815,670	2,203,746	0.63
	ルクセンブルグ				
普通株式	410,239	SES SA	3,067,313	2,701,969	0.77
	44,032	RTL GROUP	2,467,077	1,522,432	0.44
			5,534,390	4,224,401	1.21
	合計：ルクセンブルグ		5,534,390	4,224,401	1.21
	オランダ				
普通株式	219,651	ING GROEP NV - CVA	2,617,513	2,932,525	0.85
	38,730	SHELL PLC-WI-ADR	2,003,240	2,521,323	0.72
			4,620,753	5,453,848	1.57
	合計：オランダ		4,620,753	5,453,848	1.57
	ニュージーランド				
普通株式	13,184	XERO LTD	876,111	960,441	0.28
			876,111	960,441	0.28
	合計：ニュージーランド		876,111	960,441	0.28
	韓国				
普通株式	46,800	SAMSUNG ELECT CO LTD N/VOTING SHS	1,822,491	1,896,945	0.54
	79,000	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	694,850	717,390	0.21
	2,280	LG CHEM-PREFER	688,817	529,056	0.15
	7,900	DB INSURANCE CO LTD	365,219	525,263	0.15
	12,400	KB FINANCIAL GRO	520,237	509,987	0.15
	1,070	KOREA ZINC CO LTD	382,734	402,668	0.12

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
5,100	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	418,525	327,336	0.09
1,450	HYUNDAI MOBIS	286,609	259,355	0.07
4,300	SK TELECOM CO LTD	199,588	166,297	0.05
	合計：韓国	5,379,070	5,334,297	1.53
	合計：韓国	5,379,070	5,334,297	1.53
	シンガポール			
投資信託				
600,000	LENLEASE GLOBAL REIT	353,050	240,132	0.07
		353,050	240,132	0.07
普通株式				
70,051	DBS GROUP HOLDING LTD	1,183,114	1,730,505	0.49
64,508	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	1,188,098	1,350,085	0.39
109,000	KEPPEL CORP LTD	533,495	544,300	0.16
300,000	SINGAPORE TELECO	641,959	533,138	0.15
64,000	BOC AVIATION LTD	506,225	446,757	0.13
	合計：シンガポール	4,052,891	4,604,785	1.32
	合計：シンガポール	4,405,941	4,844,917	1.39
	スペイン			
普通株式				
195,585	REPSOL SA	3,110,432	3,252,621	0.94
127,236	ENDESA	2,701,215	2,614,590	0.75
	合計：スペイン	5,811,647	5,867,211	1.69
	合計：スペイン	5,811,647	5,867,211	1.69
	スイス			
普通株式				
36,450	SWISS RE AG	3,154,509	3,791,666	1.10
8,912	SWATCH GROUP-BR	2,042,095	2,334,796	0.67
52,264	ADECCO GROUP AG	1,666,624	2,174,220	0.62
	合計：スイス	6,863,228	8,300,682	2.39
	合計：スイス	6,863,228	8,300,682	2.39
	台湾			
普通株式				
79,000	MEDIATEK INCORPORATION	2,470,891	1,807,299	0.51
543,000	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	1,809,749	1,757,716	0.50
102,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	892,636	1,660,418	0.48
1,640,000	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,290,989	1,250,620	0.36
107,000	E INK HOLDINGS	245,414	597,811	0.17
23,000	LOTES	641,977	589,174	0.17
316,000	TECO ELECTRIC & MACHINERY CO LTD	273,368	511,453	0.15
9,000	WIWYNN CORP	188,412	418,793	0.12
46,000	CHROMA ATE	287,195	395,169	0.11
22,402	POYA CO LTD	383,797	336,085	0.10
85,000	FORMOSA PLASTICS CORP	273,423	211,124	0.06
90,000	PRIMAX ELECTRONICS LTD	153,654	193,849	0.06
86,000	NANYA TECH	158,967	175,597	0.05
12,000	GLOBAL WAFERS	204,828	169,385	0.05
16,211	GIANT MANUFACTUR	171,279	90,067	0.03
	合計：台湾	9,446,579	10,164,560	2.92
	合計：台湾	9,446,579	10,164,560	2.92
	タイ			
普通株式				
1,420,000	PTT PCL/FOREIGN	1,772,592	1,304,508	0.38
128,000	PTT EXPL & PRO-F	610,866	600,232	0.17
206,000	TISCO FINANCIAL GROUP PUB CO NVDR	465,278	557,850	0.16
1,250,000	DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F	439,752	311,935	0.09
	合計：タイ	3,288,488	2,774,525	0.80
	合計：タイ	3,288,488	2,774,525	0.80
	イギリス			
普通株式				
407,140	HSBC HOLDINGS PL	2,689,441	3,226,043	0.94

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
992,857	TESCO PLC	3,528,508	3,221,220	0.93
343,074	STANDARD CHARTERED PLC	2,980,465	3,176,233	0.91
155,137	GSK REGISTERED SHS	2,859,317	2,834,579	0.81
66,940	BP PLC-ADR	2,508,836	2,626,056	0.75
805,846	NATWEST GROUP PL	2,555,776	2,329,356	0.67
40,616	UNILEVER PLC-ADR	2,224,968	2,018,615	0.58
91,777	IMPERIAL BRANDS PLC	1,794,043	1,882,635	0.54
1,309,992	BT GROUP PLC	2,545,957	1,880,483	0.54
60,516	ANGLO AMER PLC	1,688,628	1,705,546	0.49
52,360	BRIT AMER TO-ADR	1,974,451	1,649,864	0.47
24,640	RIO TINTO PLC	1,635,211	1,575,911	0.45
359,554	BRITISH LAND CO PLC	1,662,195	1,411,288	0.41
		30,647,796	29,537,829	8.49
	合計：イギリス	30,647,796	29,537,829	8.49
	アメリカ			
投資信託				
11,560	SPDR S&P BIOTECH ETF	924,844	854,630	0.25
		924,844	854,630	0.25
普通株式				
27,284	MICROSOFT CORP *	5,039,582	8,695,957	2.49
50,312	APPLE INC *	3,611,258	8,688,882	2.49
44,210	AMAZON.COM INC *	4,087,295	5,676,564	1.63
13,457	META PLATFORMS-A	2,256,214	4,160,635	1.20
28,900	ALPHABET INC A	2,754,839	3,864,219	1.11
47,933	COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP A	3,131,386	3,267,353	0.94
62,210	WESTERN DIGITAL *	3,063,261	2,851,084	0.82
54,675	WELLS FARGO & CO	2,349,901	2,251,517	0.65
3,850	ELI LILLY & CO	1,382,229	2,079,000	0.60
11,550	L3HARRIS TECHNOL	2,594,146	1,989,372	0.57
63,780	CARLYLE GROUP IN	2,153,584	1,967,294	0.57
8,819	LABORATORY CP	1,484,146	1,777,646	0.51
39,344	COMCAST CORP A *	1,501,544	1,755,136	0.50
44,360	BAXTER INTL INC	2,215,274	1,663,500	0.48
28,730	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	2,342,864	1,601,123	0.46
29,610	CISCO SYSTEMS INC	1,114,965	1,598,940	0.46
6,680	VISA INC CLASS A SHS	1,428,294	1,549,760	0.45
17,340	CARDINAL HEALTH	1,075,312	1,513,782	0.44
35,952	FIDELITY NATIONA	1,289,891	1,498,839	0.43
26,382	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	1,810,182	1,403,786	0.40
13,092	DOLLAR TREE INC	1,386,169	1,398,880	0.40
42,062	GENERAL MOTORS CO	1,605,245	1,398,141	0.40
22,720	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	930,968	1,386,374	0.40
32,690	CITIGROUP INC *	1,748,366	1,361,212	0.39
40,280	KRAFT HEINZ CO/THE	1,574,406	1,357,436	0.39
86,720	RESMED INC-CDI	1,924,440	1,326,088	0.38
127,650	DUN & BRADSTREET	1,641,744	1,295,648	0.37
10,429	RALPH LAUREN COR	1,051,065	1,219,880	0.35
10,793	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,583,606	1,215,184	0.35
4,038	THE CIGNA GROUP	727,566	1,157,573	0.33
8,389	LEAR CORP	1,384,730	1,136,961	0.33
32,982	SEALED AIR CORP	2,086,753	1,084,778	0.31
4,470	ZEBRA TECH CORP	1,172,715	1,077,449	0.31
764	FIRST CITIZENS-A	648,851	1,057,880	0.30
17,367	PUBLIC SERV ENTERPRISE GROUP	971,516	987,488	0.28
13,960	INTL FLVR & FRAG	1,139,077	958,773	0.28
13,238	MONDELEZ INTER-A	900,534	919,644	0.26
110,350	KOSMOS ENERGY LT	830,407	901,008	0.26
11,935	AMERICAN ELECTRI	977,165	900,257	0.26
12,734	SEMPRA	885,558	873,934	0.25
28,550	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	948,457	772,563	0.22
1,565	HUMANA INC	626,823	768,384	0.22
50,300	AT&T INC	761,592	755,003	0.22
22,146	VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,110,242	722,070	0.21
7,560	LEIDOS HOLDINGS	662,311	702,626	0.20
3,320	UNION PACIFIC CORP	659,771	678,674	0.20
37,430	NEWELL BRANDS IN	672,038	334,811	0.10

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
8,959	FORTREA HOLDINGS	241,713	259,005	0.07
		77,539,995	87,862,113	25.24
	合計：アメリカ	78,464,839	88,716,743	25.49
	組入資産合計	314,979,059	319,199,552	91.73

* 部分的にデリバティブの担保として差し入れられている有価証券

財務書類に関する注記

2023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

2023年9月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	170,078	JPY	25,050,000	2023年10月10日	1,367
USD	170,480	JPY	25,050,000	2023年10月25日	1,312
USD	96,954	JPY	14,280,000	2023年10月10日	779
USD	97,184	JPY	14,280,000	2023年10月25日	748
USD	53,512	JPY	7,852,775	2023年10月10日	624
USD	26,437	JPY	3,880,000	2023年10月10日	306
USD	21,625	JPY	3,173,500	2023年10月10日	252
ZAR	209,500,000	USD	10,948,772	2023年10月20日	169,380
ZAR	207,000,000	USD	10,805,933	2023年12月8日	129,934
ZAR	216,000,000	USD	11,333,861	2023年11月22日	94,250
USD	2,636,478	BRL	13,000,000	2023年10月17日	60,683
MXN	230,000,000	USD	13,032,859	2023年11月14日	33,786
USD	14,391,505	PLN	62,700,000	2023年10月6日	21,516
INR	1,005,000,000	USD	12,036,057	2023年12月8日	21,380
INR	798,250,000	USD	9,594,235	2023年10月20日	4,041
PLN	13,000,000	USD	2,979,862	2023年11月8日	(3,221)
INR	544,500,000	USD	6,546,320	2023年11月22日	(8,752)
USD	2,958,785	ZAR	56,000,000	2023年10月6日	(16,887)
PLN	53,800,000	USD	12,333,083	2023年11月22日	(18,806)
USD	12,073,072	INR	1,005,000,000	2023年10月6日	(19,997)
ZAR	38,000,000	USD	2,039,540	2023年10月6日	(20,333)
INR	440,000,000	USD	5,309,661	2023年11月8日	(23,529)
PLN	62,700,000	USD	14,366,265	2023年12月8日	(29,269)
INR	964,250,000	USD	11,623,351	2023年11月8日	(38,911)
BRL	67,200,000	USD	13,355,327	2023年11月14日	(86,636)
INR	1,005,000,000	USD	12,180,415	2023年10月6日	(87,346)
PLN	6,900,000	USD	1,689,267	2023年10月6日	(107,881)
USD	10,867,380	ZAR	207,000,000	2023年10月6日	(131,983)
ZAR	248,500,000	USD	13,318,862	2023年11月8日	(154,097)
MXN	226,000,000	USD	12,960,945	2023年12月1日	(158,342)
BRL	71,500,000	USD	14,376,482	2023年12月1日	(284,713)
MXN	338,000,000	USD	19,581,148	2023年10月17日	(285,744)
BRL	77,100,000	USD	15,623,100	2023年10月17日	(346,655)
MXN	204,000,000	USD	11,989,421	2023年10月27日	(364,709)
ZAR	225,000,000	USD	12,487,080	2023年10月6日	(531,251)
BRL	105,200,000	USD	21,365,742	2023年10月27日	(552,732)
PLN	44,600,000	USD	10,803,980	2023年11月8日	(591,810)
PLN	44,600,000	USD	10,957,735	2023年10月20日	(740,207)
PLN	55,800,000	USD	13,866,840	2023年10月6日	(1,078,237)
JPY	4,455,000	USD	30,364	2023年10月10日	(360)

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
JPY	1,808,978,197	USD	12,315,782	2023年10月25日	(99,293)
JPY	1,788,858,958	USD	12,366,552	2023年10月10日	(318,655)
USD	69,173,412	EUR	64,642,962	2023年10月26日	534,280
USD	26,978,360	GBP	21,775,318	2023年10月26日	314,428
USD	13,337,274	JPY	1,940,000,000	2023年10月13日	264,369
USD	13,510,336	JPY	1,980,000,000	2023年10月20日	150,994
USD	8,090,129	CHF	7,234,470	2023年10月26日	113,124
USD	2,929,940	THB	104,000,000	2023年10月20日	72,433
USD	5,479,123	KRW	7,300,000,000	2023年10月20日	43,534
USD	4,391,211	SGD	5,930,000	2023年10月13日	33,771
USD	10,946,929	TWD	350,000,000	2023年10月20日	24,721
USD	2,078,497	DKK	14,473,423	2023年10月26日	16,813
USD	680,057	JPY	100,000,000	2023年10月20日	5,344
USD	113,166	KRW	150,000,000	2023年10月20日	1,476
USD	313,458	TWD	10,000,000	2023年10月20日	1,396
TWD	10,000,000	USD	311,390	2023年10月20日	672
SGD	180,000	USD	131,744	2023年10月13日	522
USD	110,383	SGD	150,000	2023年10月13日	162
USD	110,249	SGD	150,000	2023年10月13日	28
USD	255,488	HKD	2,000,000	2023年10月13日	(52)
USD	319,358	HKD	2,500,000	2023年10月13日	(67)
HKD	2,500,000	USD	319,714	2023年10月13日	(289)
JPY	110,000,000	USD	742,533	2023年10月20日	(348)
KRW	150,000,000	USD	112,210	2023年10月20日	(521)
THB	3,000,000	USD	83,089	2023年10月20日	(661)
USD	13,858,001	HKD	108,500,000	2023年10月13日	(5,067)
JPY	70,000,000	USD	481,989	2023年10月20日	(9,690)
USD	10,784,626	AUD	16,882,000	2023年10月31日	(167,061)
USD	10,780,380	AUD	16,882,000	2023年10月31日	(171,307)
USD	10,780,359	AUD	16,882,000	2023年10月31日	(171,329)
USD	10,780,034	AUD	16,882,000	2023年10月31日	(171,653)
					(4,679,976)

注記 2 オプション契約

2023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)
売り持ちポジション						
SGD	(21,000)	C DBS SP 37.4306 03/10/23 OTC	2023年10月3日	(538)	0	538
AUD	(11,136)	C JHX AT 51.2228 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(4,107)	0	4,107
EUR	(131,502)	C O2D GY 2.7447 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,973)	0	4,973
USD	(2,000)	C ZBH UN 138.15 06/10/23 OTC	2023年10月6日	(5,190)	0	5,190
HKD	(700,000)	C 1398 HK 4.484 04/10/23 OTC	2023年10月4日	(560)	0	560
TWD	(28,000)	C 2330 TT 636.84 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(580)	0	580
TWD	(33,000)	C 2454 TT 845.1975 06/10/23 OTC	2023年10月6日	(2,079)	0	2,079
HKD	(250,000)	C 868 HK 15.7952 03/10/23 OTC	2023年10月3日	(1,100)	0	1,100
GBP	(7,488)	C AAL LN 25.26552 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(948)	(694)	254
GBP	(7,488)	C AAL LN 25.85426 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(2,532)	(3,928)	(1,396)
GBP	(7,738)	C AAL LN 26.85895 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(2,761)	(833)	1,928
GBP	(7,149)	C AAL LN 27.04622 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(2,893)	(33)	2,860
USD	(40)	C AAPL UW 185 03/11/23	2023年11月3日	(9,111)	(5,680)	3,431
USD	(65)	C AAPL UW 185 13/10/23	2023年10月13日	(14,213)	(910)	13,303
USD	(12)	C AAPL UW 185 20/10/23	2023年10月20日	(3,507)	(372)	3,135
USD	(59)	C AAPL UW 185 27/10/23	2023年10月27日	(13,170)	(3,363)	9,807
CHF	(5,051)	C ADEN SE 36.1935 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(2,899)	(10,056)	(7,157)
CHF	(7,055)	C ADEN SE 39.828 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,330)	(939)	391
CHF	(5,468)	C ADEN SE 41.3844 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,816)	(1,131)	2,685

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
CHF	(5,291)	C ADEN SE 41.3883 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,495)	(2,729)	766
USD	(54)	C AEP UW 82 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(5,658)	(2,526)	3,132
EUR	(7,329)	C AGS BB 39.1017 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,683)	(5,936)	(2,253)
EUR	(7,574)	C AGS BB 40.4457 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,427)	(1,516)	2,911
EUR	(6,997)	C AGS BB 40.9845 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,496)	(1,056)	2,440
EUR	(7,329)	C AGS BB 42.3976 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,406)	(668)	738
USD	(14)	C AIG UN 60 06/10/23	2023年10月6日	(963)	(2,212)	(1,249)
USD	(13)	C AIG UN 60 20/10/23	2023年10月20日	(1,310)	(3,250)	(1,940)
USD	(30)	C AIG UN 61 27/10/23	2023年10月27日	(4,193)	(5,520)	(1,327)
USD	(29)	C AIG UN 62.5 17/11/23	2023年11月17日	(4,140)	(6,206)	(2,066)
USD	(16)	C AIG UN 63.35 03/11/23 FLEX	2023年11月3日	(2,212)	(1,602)	610
EUR	(3,077)	C AKE FP 101.4128 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,225)	(230)	3,995
EUR	(3,331)	C AKE FP 107.3438 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,938)	(391)	4,547
EUR	(3,223)	C AKE FP 107.448 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(4,778)	(1,425)	3,353
EUR	(3,366)	C AKE FP 96.884 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,477)	(2,739)	(1,262)
AUD	(13,455)	C ALL AT 42.6594 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(5,199)	(401)	4,798
AUD	(12,786)	C ALL AT 43.3962 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(4,493)	(777)	3,716
AUD	(7,935)	C ALL AT 44.4223 08/11/23 OTC	2023年11月8日	(2,072)	(576)	1,496
EUR	(2,363)	C ALV GY 222.812 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(6,690)	(14,276)	(7,586)
EUR	(2,557)	C ALV GY 226.84 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(8,390)	(14,788)	(6,398)
EUR	(2,475)	C ALV GY 236.0146 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(8,424)	(8,431)	(7)
EUR	(2,475)	C ALV GY 241.5703 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,834)	(392)	1,442
EUR	(5,889)	C AMUN FP 56.8166 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,009)	(631)	378
EUR	(6,086)	C AMUN FP 60.2786 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,996)	(376)	3,620
EUR	(5,889)	C AMUN FP 60.3065 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(4,401)	(1,541)	2,860
EUR	(5,622)	C AMUN FP 60.9118 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,724)	(3)	4,721
USD	(33)	C AMZN UW 134.5 13/10/23 FLEX	2023年10月13日	(21,706)	(3,194)	18,512
USD	(88)	C AMZN UW 137 06/10/23	2023年10月6日	(28,621)	(1,320)	27,301
USD	(33)	C AMZN UW 141 03/11/23	2023年11月3日	(9,857)	(6,666)	3,191
AUD	(16,094)	C ANZ AT 25.7118 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(2,507)	(4,991)	(2,484)
AUD	(24,507)	C ANZ AT 25.734 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(6,087)	(8,803)	(2,716)
AUD	(17,120)	C ANZ AT 26.4711 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(3,750)	(710)	3,040
USD	(36)	C BABA UN 94 27/10/23	2023年10月27日	(5,671)	(4,824)	847
USD	(31)	C BABA UN 99 06/10/23	2023年10月6日	(7,179)	(93)	7,086
AUD	(47,644)	C BAP AT 6.9582 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(1,988)	(1,871)	117
AUD	(42,166)	C BAP AT 6.9833 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(2,767)	(3,863)	(1,096)
EUR	(6,147)	C BAS GY 48.527 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,337)	(100)	1,237
EUR	(5,868)	C BAS GY 50.7844 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,020)	(3)	4,017
EUR	(6,147)	C BAS GY 51.5735 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(4,374)	(684)	3,690
EUR	(6,351)	C BAS GY 52.2766 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,589)	(85)	4,504
USD	(17)	C BAX UN 39 03/11/23	2023年11月3日	(1,753)	(1,819)	(66)
USD	(29)	C BAX UN 40 20/10/23	2023年10月20日	(2,490)	(754)	1,736
USD	(142)	C BAX UN 41 27/10/23	2023年10月27日	(11,185)	(2,982)	8,203
USD	(7)	C BAX UN 42.88 13/10/23 FLEX	2023年10月13日	(684)	(4)	680
USD	(4)	C BAX UN 43 06/10/23	2023年10月6日	(351)	(32)	319
EUR	(7,104)	C BAYN GY 52.0745 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,106)	(90)	1,016
EUR	(7,104)	C BAYN GY 56.2622 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(4,897)	(575)	4,322
EUR	(6,782)	C BAYN GY 57.4718 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,587)	(1)	4,586
EUR	(7,341)	C BAYN GY 58.4184 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(5,188)	(40)	5,148
AUD	(197)	C BHP AT 45.51 19/10/23	2023年10月19日	(5,915)	(6,318)	(403)
AUD	(19,209)	C BHP AT 45.6349 08/11/23 OTC	2023年11月8日	(7,805)	(11,142)	(3,337)
AUD	(192)	C BHP AT 46.01 16/11/23	2023年11月16日	(8,192)	(11,259)	(3,067)
AUD	(18,831)	C BHP AT 46.9136 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(7,402)	(3,416)	3,986
AUD	(19,375)	C BHP AT 47.156 29/11/23 OTC	2023年11月29日	(8,592)	(9,523)	(931)
AUD	(18,508)	C BHP AT 48.0759 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(5,989)	(208)	5,781
GBP	(44,494)	C BLND LN 3.37899 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(2,479)	(3,966)	(1,487)
GBP	(44,494)	C BLND LN 3.50423 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(766)	(691)	75
GBP	(45,977)	C BLND LN 3.74934 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(2,429)	(721)	1,708
EUR	(7,106)	C BNP FP 62.8347 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(5,428)	(2,467)	2,961
EUR	(7,444)	C BNP FP 63.957 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(2,148)	(1,711)	437
EUR	(7,444)	C BNP FP 65.2749 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(6,733)	(6,669)	64
EUR	(7,692)	C BNP FP 65.6162 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(6,243)	(2,731)	3,512
USD	(61)	C BP UN 38 06/10/23	2023年10月6日	(3,097)	(9,455)	(6,358)
USD	(120)	C BP UN 38 20/10/23	2023年10月20日	(13,708)	(19,440)	(5,732)
USD	(120)	C BP UN 40 27/10/23	2023年10月27日	(4,976)	(7,800)	(2,824)
GBP	(132,636)	C BT/A LN 1.32853 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(871)	(424)	447

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
GBP	(137,057)	C BT/A LN 1.38455 03/11/23 OTC	2023年11月 3 日	(2,198)	(1,341)	857
GBP	(132,636)	C BT/A LN 1.3848 01/12/23 OTC	2023年12月 1 日	(2,721)	(2,637)	84
GBP	(126,620)	C BT/A LN 1.41204 13/10/23 OTC	2023年10月13 日	(2,138)	(73)	2,065
USD	(110)	C BTI UN 33 20/10/23	2023年10月20 日	(4,815)	(1,100)	3,715
USD	(22)	C BTI UN 33.13 20/10/23 FLEX	2023年10月20 日	(875)	(322)	553
USD	(102)	C BTI UN 33.63 17/11/23 FLEX	2023年11月17 日	(4,770)	(2,342)	2,428
AUD	(24,960)	C BXB AT 14.6326 18/10/23 OTC	2023年10月18 日	(3,064)	(1,810)	1,254
AUD	(32,825)	C BXB AT 15.1875 20/12/23 OTC	2023年12月20 日	(4,846)	(3,989)	857
AUD	(32,288)	C BXB AT 15.5259 22/11/23 OTC	2023年11月22 日	(4,130)	(1,419)	2,711
USD	(25)	C C UN 43 03/11/23	2023年11月 3 日	(1,644)	(2,375)	(731)
USD	(27)	C C UN 43 13/10/23	2023年10月13 日	(1,749)	(1,404)	345
USD	(26)	C C UN 43 27/10/23	2023年10月27 日	(2,185)	(1,716)	469
USD	(22)	C C UN 44 17/11/23	2023年11月17 日	(2,402)	(1,584)	818
USD	(19)	C C UN 44 20/10/23	2023年10月20 日	(1,763)	(741)	1,022
USD	(28)	C C UN 44.5 20/10/23	2023年10月20 日	(1,808)	(728)	1,080
USD	(36)	C CAH UN 88 13/10/23	2023年10月13 日	(5,266)	(9,540)	(4,274)
USD	(7)	C CAH UN 89 06/10/23	2023年10月 6 日	(1,037)	(385)	652
USD	(35)	C CAH UN 90 27/10/23	2023年10月27 日	(4,392)	(3,570)	822
AUD	(81)	C CBA AT 102.01 19/10/23	2023年10月19 日	(8,924)	(3,543)	5,381
AUD	(8,582)	C CBA AT 104.4614 11/10/23 OTC	2023年10月11 日	(4,746)	(401)	4,345
USD	(45)	C CFG UN 30 17/11/23	2023年11月17 日	(2,924)	(1,800)	1,124
USD	(83)	C CFG UN 30 20/10/23	2023年10月20 日	(9,270)	(1,660)	7,610
USD	(145)	C CG UW 30.6 20/10/23 FLEX	2023年10月20 日	(16,642)	(15,104)	1,538
USD	(142)	C CG UW 34 17/11/23 FLEX	2023年11月17 日	(11,824)	(5,183)	6,641
USD	(7)	C CI UN 290 06/10/23	2023年10月 6 日	(3,318)	(2,716)	602
USD	(10)	C CI UN 290 29/09/23	2023年 9月29 日	(4,308)	(250)	4,058
USD	(7)	C CI UN 295 20/10/23	2023年10月20 日	(2,192)	(4,060)	(1,868)
USD	(19)	C CMCSA UW 45 13/10/23	2023年10月13 日	(1,763)	(1,292)	471
USD	(11)	C CMCSA UW 45 20/10/23	2023年10月20 日	(1,152)	(682)	470
USD	(95)	C CMCSA UW 46 03/11/23	2023年11月 3 日	(7,863)	(8,455)	(592)
USD	(21)	C CMCSA UW 47 06/10/23	2023年10月 6 日	(1,690)	(84)	1,606
USD	(31)	C CMCSA UW 47.5 17/11/23	2023年11月17 日	(2,442)	(1,798)	644
EUR	(3,548)	C CON GY 72.5472 16/10/23 OTC	2023年10月16 日	(1,126)	(2,332)	(1,206)
EUR	(3,548)	C CON GY 77.9986 01/12/23 OTC	2023年12月 1 日	(3,626)	(3,257)	369
EUR	(3,387)	C CON GY 80.6646 13/10/23 OTC	2023年10月13 日	(3,553)	(72)	3,481
EUR	(3,666)	C CON GY 82.4993 03/11/23 OTC	2023年11月 3 日	(4,011)	(488)	3,523
AUD	(21,162)	C CPU AT 26.2386 08/11/23 OTC	2023年11月 8 日	(5,630)	(9,263)	(3,633)
AUD	(21,581)	C CPU AT 26.3878 25/10/23 OTC	2023年10月25 日	(3,602)	(6,066)	(2,464)
AUD	(17,284)	C CPU AT 26.7486 11/10/23 OTC	2023年10月11 日	(4,702)	(1,448)	3,254
EUR	(18,441)	C CS FP 28.6826 13/10/23 OTC	2023年10月13 日	(6,572)	(5,787)	785
EUR	(19,962)	C CS FP 29.7338 03/11/23 OTC	2023年11月 3 日	(8,404)	(5,137)	3,267
EUR	(19,318)	C CS FP 29.9443 01/12/23 OTC	2023年12月 1 日	(7,290)	(8,293)	(1,003)
EUR	(19,318)	C CS FP 30.2857 16/10/23 OTC	2023年10月16 日	(3,594)	(834)	2,760
USD	(47)	C CSCO UW 55 03/11/23	2023年11月 3 日	(2,480)	(2,961)	(481)
USD	(44)	C CSCO UW 55 20/10/23	2023年10月20 日	(5,798)	(1,496)	4,302
USD	(20)	C CSCO UW 56 27/10/23	2023年10月27 日	(1,535)	(480)	1,055
USD	(10)	C CSCO UW 57 06/10/23	2023年10月 6 日	(800)	(20)	780
USD	(12)	C CSCO UW 57.5 17/11/23	2023年11月17 日	(1,524)	(564)	960
AUD	(33)	C CSL AT 270 21/12/23	2023年12月21 日	(7,304)	(6,318)	986
AUD	(2,701)	C CSL AT 270.4484 06/12/23 OTC	2023年12月 6 日	(5,927)	(3,797)	2,130
AUD	(3,138)	C CSL AT 275.5422 29/11/23 OTC	2023年11月29 日	(6,970)	(2,306)	4,664
AUD	(3,133)	C CSL AT 278.7583 08/11/23 OTC	2023年11月 8 日	(6,841)	(642)	6,199
AUD	(2,613)	C CSL AT 281.2434 11/10/23 OTC	2023年10月11 日	(6,461)	(2)	6,459
AUD	(31)	C CSL AT 284 16/11/23	2023年11月16 日	(8,779)	(422)	8,357
AUD	(2,646)	C CSL AT 285.2194 25/10/23 OTC	2023年10月25 日	(6,654)	(47)	6,607
USD	(44)	C CTSH UW 70.06 03/10/23 FLEX	2023年10月 3 日	(6,810)	(131)	6,679
USD	(62)	C CTSH UW 72 12/10/23 FLEX	2023年10月12 日	(10,712)	(313)	10,399
USD	(44)	C CTSH UW 72.5 17/11/23	2023年11月17 日	(9,472)	(4,840)	4,632
USD	(65)	C CTSH UW 72.5 20/10/23	2023年10月20 日	(20,005)	(975)	19,030
SGD	(21,000)	C DBS SP 36.729 27/10/23 OTC	2023年10月27 日	(414)	(122)	292
SGD	(21,000)	C DBS SP 36.751 02/11/23 OTC	2023年11月 2 日	(569)	(219)	350
USD	(12)	C DLTR UW 116 27/10/23	2023年10月27 日	(2,267)	(588)	1,679
USD	(11)	C DLTR UW 157.5 29/09/23	2023年 9月29 日	(3,237)	(77)	3,160
USD	(3,100)	C DNB UN 10.471 02/11/23 OTC	2023年11月 2 日	(896)	(740)	156
USD	(46,100)	C DNB UN 10.806 02/11/23 OTC	2023年11月 2 日	(17,601)	(7,888)	9,713
USD	(8,200)	C DNB UN 10.833 25/10/23 OTC	2023年10月25 日	(5,085)	(1,125)	3,960

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)
EUR	(15,745)	C ELE SQ 20.2891 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(4,076)	(4,852)	(776)
EUR	(15,031)	C ELE SQ 20.7887 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,963)	(165)	3,798
EUR	(16,270)	C ELE SQ 21.0193 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,715)	(885)	2,830
EUR	(15,745)	C ELE SQ 21.4638 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,004)	(53)	951
EUR	(37,709)	C ENI IM 14.2512 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(7,597)	(45,348)	(37,751)
EUR	(40,818)	C ENI IM 14.5763 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(8,588)	(41,593)	(33,005)
EUR	(39,501)	C ENI IM 15.1733 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(8,714)	(26,438)	(17,724)
EUR	(36,558)	C ENI IM 15.552 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(3,502)	(7,175)	(3,673)
EUR	(11,444)	C EVK GY 19.2996 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,083)	(1,967)	1,116
EUR	(11,444)	C EVK GY 19.3318 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(654)	(276)	378
EUR	(11,825)	C EVK GY 20.4239 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,334)	(245)	3,089
EUR	(10,554)	C EVK GY 20.4302 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,228)	(26)	3,202
USD	(4)	C FCNCA UW 1400 20/10/23	2023年10月20日	(30,508)	(10,360)	20,148
USD	(16)	C FIS UN 57.5 20/10/23	2023年10月20日	(3,132)	(1,360)	1,772
USD	(113)	C FIS UN 58.25 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(22,122)	(21,716)	406
USD	(138)	C FNF UN 42.48 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(15,562)	(6,087)	9,475
USD	(23)	C FNF UN 42.65 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(2,801)	(1,993)	808
EUR	(17,640)	C FORTUM FH 13.0181 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(700)	(21)	679
EUR	(18,228)	C FORTUM FH 13.0319 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(2,949)	(210)	2,739
EUR	(16,506)	C FORTUM FH 13.1675 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(2,627)	(5)	2,622
EUR	(17,640)	C FORTUM FH 13.489 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(2,974)	(427)	2,547
EUR	(8,323)	C FRE GY 29.7507 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,294)	(5,407)	(2,113)
EUR	(9,009)	C FRE GY 31.2589 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,566)	(4,899)	(333)
EUR	(8,719)	C FRE GY 32.5115 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,260)	(732)	528
EUR	(8,719)	C FRE GY 33.154 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,896)	(3,687)	209
USD	(20)	C FTRE UW 30 17/11/23	2023年11月17日	(1,783)	(3,300)	(1,517)
USD	(200)	C GIL UN 29.08 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(23,554)	(28,775)	(5,221)
USD	(196)	C GIL UN 31 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(14,851)	(17,574)	(2,723)
USD	(163)	C GM UN 35 03/11/23	2023年11月3日	(11,739)	(15,322)	(3,583)
USD	(26)	C GM UN 35 27/10/23	2023年10月27日	(2,308)	(1,768)	540
AUD	(26,896)	C GMG AT 21.6892 04/10/23 OTC	2023年10月4日	(4,976)	(2,509)	2,467
AUD	(25,791)	C GMG AT 22.3209 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(6,107)	(2,727)	3,380
USD	(8)	C GOOGL UW 135 17/11/23	2023年11月17日	(2,753)	(4,424)	(1,671)
USD	(24)	C GOOGL UW 137 27/10/23	2023年10月27日	(13,525)	(7,872)	5,653
USD	(24)	C GOOGL UW 138 06/10/23	2023年10月6日	(8,126)	(744)	7,382
USD	(14)	C GOOGL UW 139 13/10/23	2023年10月13日	(3,875)	(714)	3,161
USD	(21)	C GOOGL UW 140 20/10/23	2023年10月20日	(6,723)	(1,953)	4,770
USD	(10)	C GOOGL UW 141.24 03/11/23 FLEX	2023年11月3日	(4,358)	(1,858)	2,500
GBP	(14,995)	C GSK LN 14.28044 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(2,718)	(13,552)	(10,834)
GBP	(16,231)	C GSK LN 14.29571 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,479)	(17,351)	(13,872)
GBP	(15,707)	C GSK LN 14.69468 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,451)	(12,688)	(9,237)
EUR	(4,175)	C HEI GY 76.1484 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,429)	(4,361)	(2,932)
EUR	(3,985)	C HEI GY 78.7101 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,788)	(1,002)	3,786
EUR	(4,175)	C HEI GY 80.5087 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(5,172)	(5,268)	(96)
EUR	(3,863)	C HEI GY 82.1758 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(5,333)	(1,399)	3,934
GBP	(61,376)	C HSBA LN 6.28304 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(5,713)	(25,907)	(20,194)
GBP	(61,376)	C HSBA LN 6.59757 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(2,130)	(4,038)	(1,908)
GBP	(58,592)	C HSBA LN 6.60535 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(6,395)	(2,986)	3,409
GBP	(63,422)	C HSBA LN 6.70129 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(7,193)	(6,085)	1,108
USD	(5)	C HUM UN 470 06/10/23	2023年10月6日	(8,639)	(8,835)	(5,196)
USD	(4)	C HUM UN 485 20/10/23	2023年10月20日	(6,269)	(6,628)	(359)
USD	(62)	C IFF UN 70 20/10/23	2023年10月20日	(4,589)	(9,300)	(4,711)
GBP	(13,835)	C IMB LN 18.53811 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(905)	(161)	744
GBP	(13,835)	C IMB LN 18.62152 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,905)	(950)	2,955
GBP	(13,207)	C IMB LN 18.74907 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,191)	(47)	3,144
GBP	(14,296)	C IMB LN 19.47582 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,643)	(169)	3,474
EUR	(33,112)	C INGA NA 13.6939 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(2,034)	(746)	1,288
EUR	(31,610)	C INGA NA 14.0114 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(6,173)	(170)	6,003
EUR	(34,216)	C INGA NA 14.3512 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(8,315)	(1,061)	7,254
EUR	(33,112)	C INGA NA 14.4294 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(6,558)	(2,762)	3,796
AUD	(9,831)	C JHX AT 45.3454 10/01/24 OTC	2024年1月10日	(6,425)	(6,117)	308
AUD	(10,910)	C JHX AT 48.5088 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(3,429)	(21)	3,408
AUD	(11,329)	C JHX AT 51.3608 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(5,388)	(9)	5,379
USD	(25)	C KHC UQ 33 06/10/23	2023年10月6日	(1,044)	(2,300)	(1,256)
USD	(25)	C KHC UQ 33 13/10/23	2023年10月13日	(1,332)	(3,775)	(2,443)
USD	(42)	C KHC UQ 34 27/10/23	2023年10月27日	(2,132)	(3,402)	(1,270)

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
USD	(47)	C KHC UQ 35 20/10/23	2023年10月20日	(1,963)	(846)	1,117
USD	(42)	C KHC UQ 36 03/11/23	2023年11月3日	(1,712)	(1,134)	578
USD	(496)	C KOS UN 8 17/11/23	2023年11月17日	(12,286)	(29,760)	(17,474)
USD	(17)	C LDOS UN 95 17/11/23	2023年11月17日	(5,589)	(4,131)	1,458
USD	(17)	C LDOS UN 95 20/10/23	2023年10月20日	(2,665)	(1,530)	1,135
USD	(36)	C LEA UN 145 17/11/23	2023年11月17日	(12,160)	(10,620)	1,540
USD	(1)	C LEA UN 150 20/10/23	2023年10月20日	(386)	(40)	346
USD	(21)	C LH UN 214.5 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(6,988)	(4,638)	2,350
USD	(18)	C LH UN 220 20/10/23	2023年10月20日	(9,860)	(432)	9,428
USD	(26)	C LHX UN 175 20/10/23	2023年10月20日	(6,364)	(8,216)	(1,852)
USD	(26)	C LHX UN 180 17/11/23	2023年11月17日	(7,534)	(8,710)	(1,176)
USD	(10)	C LLY UN 540 20/10/23	2023年10月20日	(18,043)	(12,820)	5,223
USD	(10)	C LLY UN 555 03/11/23	2023年11月3日	(16,468)	(15,550)	918
USD	(4)	C LLY UN 560 13/10/23	2023年10月13日	(5,141)	(2,796)	2,345
USD	(41)	C MDLZ UW 72 03/11/23	2023年11月3日	(4,891)	(3,690)	1,201
USD	(18)	C MDLZ UW 72 27/10/23	2023年10月27日	(1,815)	(1,206)	609
USD	(24)	C MDT UN 82.5 20/10/23	2023年10月20日	(2,826)	(480)	2,346
USD	(2)	C MDT UN 83 27/10/23	2023年10月27日	(198)	(102)	96
USD	(22)	C MDT UN 84 06/10/23	2023年10月6日	(1,821)	(88)	1,733
USD	(9)	C MDT UN 84.37 03/11/23 FLEX	2023年11月3日	(1,258)	(256)	1,002
USD	(40)	C MDT UN 85 17/11/23	2023年11月17日	(4,912)	(1,960)	2,952
USD	(8)	C META UW 310 20/10/23	2023年10月20日	(4,455)	(8,000)	(3,545)
USD	(52)	C META UW 320 06/10/23	2023年10月6日	(27,731)	(8,736)	18,995
AUD	(3,418)	C MQG AT 181.58 29/11/23 OTC	2023年11月29日	(6,383)	(2,345)	4,038
AUD	(3,436)	C MQG AT 181.9126 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(6,505)	(2,930)	3,575
AUD	(3,447)	C MQG AT 185.3276 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(3,366)	(279)	3,087
AUD	(3,409)	C MQG AT 187.2744 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(4,256)	(53)	4,203
USD	(14)	C MSFT UW 335 27/10/23	2023年10月27日	(11,994)	(5,572)	6,422
USD	(43)	C MSFT UW 340 20/10/23	2023年10月20日	(24,495)	(3,870)	20,625
USD	(20)	C MSFT UW 345 13/10/23	2023年10月13日	(9,195)	(400)	8,795
USD	(18)	C MSFT UW 350 17/11/23	2023年11月17日	(17,150)	(4,824)	12,326
AUD	(19,409)	C NAB AT 29.2953 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(4,528)	(3,106)	1,422
AUD	(242)	C NAB AT 29.51 21/12/23	2023年12月21日	(8,977)	(8,389)	588
AUD	(25,808)	C NAB AT 29.9602 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(7,679)	(5,499)	2,180
AUD	(47,935)	C NST AT 12.3375 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(5,563)	(4,098)	1,465
USD	(28)	C NVO UN 92.5 27/10/23	2023年10月27日	(7,035)	(8,204)	(1,169)
USD	(15)	C NVO UN 95 03/11/23	2023年11月3日	(4,113)	(2,850)	1,263
USD	(26)	C NVO UN 95 20/10/23	2023年10月20日	(7,891)	(3,770)	4,121
GBP	(121,481)	C NWG LN 2.4998 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,054)	(1,532)	(478)
GBP	(135,986)	C NWG LN 2.68137 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(5,028)	(2,914)	2,114
GBP	(129,817)	C NWG LN 2.76192 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(5,657)	(24)	5,633
GBP	(140,519)	C NWG LN 2.7809 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,668)	(466)	4,202
USD	(15)	C NWL UW 10 20/10/23	2023年10月20日	(312)	(75)	237
USD	(108)	C NWL UW 11 20/10/23	2023年10月20日	(5,158)	(216)	4,942
USD	(45)	C NWL UW 9.95 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(1,880)	(1,155)	725
EUR	(4,546)	C OMV AV 48.3846 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,050)	(3,314)	(264)
EUR	(53,624)	C ORA FP 10.8085 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(6,519)	(17,912)	(11,393)
EUR	(51,894)	C ORA FP 11.0814 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(6,453)	(14,938)	(8,485)
EUR	(49,540)	C ORA FP 11.2793 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(6,133)	(1,878)	4,255
EUR	(51,894)	C ORA FP 11.5917 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(2,768)	(865)	1,903
EUR	(92,519)	C O2D GY 2.0713 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(780)	(157)	623
EUR	(142,343)	C O2D GY 2.2636 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,227)	(1,194)	2,033
USD	(1,200)	C PEG UN 61.964 30/10/23 OTC	2023年10月30日	(1,510)	(188)	1,322
USD	(4,400)	C PEG UN 62.145 05/10/23 OTC	2023年10月5日	(4,295)	(3)	4,292
USD	(2,200)	C PEG UN 62.75 23/10/23 OTC	2023年10月23日	(2,127)	(133)	1,994
EUR	(2,186)	C PUB FP 80.8207 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(2,665)	(76)	2,589
AUD	(19,038)	C QBE AT 15.6926 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(2,524)	(6,420)	(3,896)
AUD	(35,172)	C QBE AT 15.9095 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(3,816)	(3,354)	462
AUD	(36,984)	C QBE AT 16.3055 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(4,685)	(3,139)	1,546
AUD	(36,928)	C QBE AT 16.9497 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(4,241)	(458)	3,783
USD	(69)	C RCI UN 41.03 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(7,436)	(1,954)	5,482
EUR	(33,666)	C REP SQ 14.2188 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(5,746)	(53,538)	(47,792)
EUR	(36,442)	C REP SQ 15.3343 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(6,047)	(27,755)	(21,708)
EUR	(35,266)	C REP SQ 16.1516 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(7,872)	(17,872)	(10,000)
EUR	(33,004)	C REP SQ 16.205 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(3,249)	(3,761)	(512)
AUD	(5,317)	C RIO AT 114.3096 08/11/23 OTC	2023年11月8日	(5,445)	(12,037)	(6,592)

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

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
AUD	(5,933)	C RIO AT 114.5944 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(5,401)	(9,663)	(4,262)
AUD	(6,218)	C RIO AT 118.4617 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(4,820)	(1,575)	3,245
GBP	(3,545)	C RIO LN 55.41197 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,539)	(848)	2,691
GBP	(3,838)	C RIO LN 55.43292 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,060)	(2,946)	114
GBP	(3,714)	C RIO LN 55.75732 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,274)	(4,899)	(1,625)
GBP	(3,714)	C RIO LN 56.64897 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,085)	(582)	503
USD	(62)	C RL UN 123 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(11,208)	(5,388)	5,820
EUR	(5,448)	C RRTL GY 34.657 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(565)	(409)	156
EUR	(6,575)	C RRTL GY 36.8356 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,021)	(937)	2,084
EUR	(6,443)	C RRTL GY 39.6228 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,178)	(2)	3,176
EUR	(6,859)	C RRTL GY 41.7202 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,632)	(10)	3,622
EUR	(5,720)	C SAN FP 100.701 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(8,237)	(20,222)	(11,985)
EUR	(5,284)	C SAN FP 100.9395 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(7,539)	(11,576)	(4,037)
EUR	(5,535)	C SAN FP 105.0624 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(8,284)	(12,745)	(4,461)
EUR	(5,535)	C SAN FP 105.8997 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(3,602)	(2,121)	1,481
AUD	(64,463)	C SDR AT 5.0257 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(2,941)	(999)	1,942
AUD	(60,330)	C SDR AT 5.0713 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(3,206)	(7,075)	(3,869)
USD	(50)	C SEE UN 37.5 20/10/23	2023年10月20日	(1,940)	(250)	1,690
USD	(35)	C SEE UN 37.75 10/10/23 FLEX	2023年10月10日	(3,089)	(39)	3,050
USD	(63)	C SEE UN 47.5 20/10/23	2023年10月20日	(10,430)	(315)	10,115
EUR	(39,652)	C SESG FP 6.3833 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(3,280)	(3,112)	168
EUR	(31,008)	C SESG FP 7.0522 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(946)	(209)	737
EUR	(22,293)	C SESG FP 7.8697 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(2,018)	(455)	1,563
EUR	(42,449)	C SESG FP 8.0326 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(3,896)	(140)	3,756
AUD	(77,548)	C SGP AT 4.2137 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(2,206)	(1,574)	632
AUD	(74,478)	C SGP AT 4.4681 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(2,461)	(4)	2,457
USD	(32)	C SHEL UN 62.95 27/10/23 FLEX	2023年10月27日	(6,233)	(9,895)	(3,662)
USD	(48)	C SHEL UN 63 13/10/23	2023年10月13日	(7,237)	(11,808)	(4,571)
USD	(6)	C SHEL UN 63 29/09/23	2023年9月29日	(395)	(1,470)	(1,075)
USD	(88)	C SHEL UN 65.42 03/11/23 FLEX	2023年11月3日	(15,028)	(14,863)	165
USD	(89)	C SNY UW 53.82 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(13,507)	(9,326)	4,181
USD	(92)	C SNY UW 55 17/11/23	2023年11月17日	(14,975)	(9,200)	5,775
USD	(16)	C SRE UN 72.5 20/10/23	2023年10月20日	(2,821)	(400)	2,421
USD	(27)	C SRE UN 75 17/11/23	2023年11月17日	(4,435)	(1,080)	3,355
USD	(14)	C SRE UN 75 20/10/23	2023年10月20日	(1,194)	(140)	1,054
CHF	(4,510)	C SREN SE 91.4518 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(5,463)	(26,005)	(20,542)
CHF	(4,661)	C SREN SE 93.8176 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(6,542)	(13,973)	(7,431)
CHF	(4,306)	C SREN SE 96.1643 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(6,099)	(2,913)	3,186
CHF	(4,510)	C SREN SE 97.4272 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(2,120)	(2,005)	115
USD	(52)	C SSNC UW 57.2 17/11/23 FLEX	2023年11月17日	(8,204)	(3,509)	4,695
USD	(66)	C SSNC UW 58.5 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(6,981)	(269)	6,712
SGD	(140,000)	C ST SP 2.6705 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(308)	(145)	163
GBP	(55,577)	C STAN LN 8.27138 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(3,044)	(2,696)	348
GBP	(33,160)	C STAN LN 8.28626 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,483)	(1,137)	3,346
GBP	(53,442)	C STAN LN 8.67672 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(8,326)	(2,738)	5,588
GBP	(51,718)	C STAN LN 8.70142 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(7,302)	(5,298)	2,004
DKK	(12,613)	C STG DC 118.1057 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(875)	(40)	835
AUD	(72,347)	C STO AT 8.0954 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(4,404)	(4,441)	(37)
AUD	(75,767)	C STO AT 8.2637 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(3,759)	(6,643)	(2,884)
USD	(54)	C SU UN 35 13/10/23	2023年10月13日	(3,660)	(4,266)	(606)
USD	(54)	C SU UN 35 27/10/23	2023年10月27日	(5,118)	(7,182)	(2,064)
GBP	(119,941)	C S32 LN 2.09317 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,357)	(4,562)	(1,205)
GBP	(108,416)	C S32 LN 2.27109 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,595)	(516)	4,079
GBP	(157,844)	C S32 LN 2.42818 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(5,681)	(6)	5,675
USD	(110)	C T UN 15 06/10/23	2023年10月6日	(2,742)	(1,980)	762
USD	(116)	C T UN 15 20/10/23	2023年10月20日	(3,453)	(3,944)	(491)
AUD	(62,760)	C TCL AT 13.6395 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(5,656)	(2,241)	3,415
AUD	(213,741)	C TLS AT 3.9919 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(4,688)	(4,695)	(7)
AUD	(141,787)	C TLS AT 4.0069 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(4,823)	(4,539)	284
AUD	(210,577)	C TLS AT 4.169 18/10/23 OTC	2023年10月18日	(5,029)	(281)	4,748
GBP	(142,883)	C TSCO LN 2.62664 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(5,591)	(9,432)	(3,841)
GBP	(154,662)	C TSCO LN 2.65813 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(6,162)	(10,712)	(4,550)
GBP	(149,673)	C TSCO LN 2.78359 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(5,516)	(4,500)	1,016
GBP	(149,673)	C TSCO LN 2.83853 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(2,263)	(2,727)	(464)
EUR	(18,803)	C UCG IM 23.5931 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,954)	(6,398)	(4,444)
EUR	(17,951)	C UCG IM 25.3582 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(6,655)	(572)	6,083

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)
EUR	(19,430)	C UCG IM 25.4562 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(7,839)	(3,853)	3,986
EUR	(18,803)	C UCG IM 25.7016 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(6,376)	(7,532)	(1,156)
CHF	(1,343)	C UHR SE 266.4613 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,091)	(192)	899
CHF	(1,343)	C UHR SE 278.6917 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(4,774)	(1,305)	3,469
CHF	(1,388)	C UHR SE 305.7244 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(5,395)	(41)	5,354
CHF	(1,282)	C UHR SE 307.2412 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(5,542)	0	5,542
USD	(89)	C UL UN 50.83 20/10/23 FLEX	2023年10月20日	(6,476)	(3,142)	3,334
USD	(93)	C UL UN 51.25 11/10/23 FLEX	2023年10月11日	(9,093)	(1,075)	8,018
USD	(14)	C UNP UN 230 20/10/23	2023年10月20日	(4,046)	(280)	3,766
USD	(6)	C V UN 245 03/11/23	2023年11月3日	(2,017)	(1,044)	973
USD	(8)	C V UN 245 20/10/23	2023年10月20日	(2,263)	(344)	1,919
USD	(5)	C V UN 250 06/10/23	2023年10月6日	(1,639)	(15)	1,624
USD	(8)	C V UN 250 13/10/23	2023年10月13日	(3,041)	(72)	2,969
USD	(3)	C V UN 250 17/11/23	2023年11月17日	(2,424)	(465)	1,959
USD	(24)	C VZ UN 34 03/11/23	2023年11月3日	(1,026)	(720)	306
USD	(25)	C VZ UN 35 06/10/23	2023年10月6日	(1,619)	(75)	1,544
USD	(50)	C VZ UN 36 20/10/23	2023年10月20日	(1,788)	(200)	1,588
AUD	(31,780)	C WBC AT 21.9683 29/11/23 OTC	2023年11月29日	(5,431)	(2,316)	3,115
AUD	(23,650)	C WBC AT 22.0933 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(3,342)	(1,433)	1,909
USD	(140)	C WDC UW 42.5 20/10/23	2023年10月20日	(35,501)	(51,659)	(16,158)
USD	(140)	C WDC UW 43 06/10/23	2023年10月6日	(9,803)	(31,639)	(21,836)
AUD	(18,236)	C WDS AT 39.239 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(6,359)	(4,077)	2,282
USD	(70)	C WFC UN 43 03/11/23	2023年11月3日	(4,114)	(4,970)	(856)
USD	(176)	C WFC UN 43 06/10/23	2023年10月6日	(10,343)	(1,232)	9,111
AUD	(22,078)	C WOW AT 38.1456 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(5,617)	(4,224)	1,393
AUD	(16,639)	C WOW AT 38.9598 15/11/23 OTC	2023年11月15日	(5,825)	(3,170)	2,655
AUD	(18,210)	C WOW AT 39.0775 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(7,536)	(5,716)	1,820
GBP	(36,848)	C WPP LN 7.961 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(1,032)	(386)	646
GBP	(36,848)	C WPP LN 8.36213 01/12/23 OTC	2023年12月1日	(3,952)	(1,380)	2,572
GBP	(38,076)	C WPP LN 9.16814 03/11/23 OTC	2023年11月3日	(4,362)	(172)	4,190
GBP	(35,176)	C WPP LN 9.23947 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(4,686)	(13)	4,683
AUD	(5,095)	C WTC AT 76.7927 13/12/23 OTC	2023年12月13日	(4,274)	(2,823)	1,451
USD	(19)	C WTW LW 210 17/11/23	2023年11月17日	(9,782)	(19,570)	(9,788)
USD	(52)	C XBI UP 77.5 27/10/23	2023年10月27日	(8,009)	(5,252)	2,757
AUD	(3,719)	C XRO AT 125.3808 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(4,369)	(28)	4,341
AUD	(3,830)	C XRO AT 125.7869 10/01/24 OTC	2024年1月10日	(10,176)	(6,190)	3,986
USD	(14)	C ZBH UN 125 17/11/23	2023年11月17日	(4,309)	(1,050)	3,259
USD	(14)	C ZBH UN 125 20/10/23	2023年10月20日	(2,335)	(210)	2,125
USD	(10)	C ZBRA UW 280 17/11/23	2023年11月17日	(11,212)	(2,810)	8,402
USD	(10)	C ZBRA UW 280 20/10/23	2023年10月20日	(4,807)	(250)	4,557
KRW	(7,000)	C 005830 KP 94109.72 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(417)	(3,716)	(3,299)
HKD	(135,000)	C 1109 HK 40.1835 10/11/23 OTC	2023年11月10日	(810)	(750)	60
HKD	(800,000)	C 1398 HK 4.2665 27/10/23 OTC	2023年10月27日	(560)	(177)	383
HKD	(700,000)	C 1398 HK 4.3268 10/11/23 OTC	2023年11月10日	(350)	(380)	(30)
HKD	(36,000)	C 16 HK 90.287 10/11/23 OTC	2023年11月10日	(259)	(1,903)	(1,644)
JPY	(21,000)	C 1605 JT 2776.36 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(288)	(361)	(73)
JPY	(12,000)	C 1925 JT 4258.1558 02/11/23 OTC	2023年11月2日	(482)	(1,719)	(1,237)
JPY	(17,000)	C 2002 JT 2091.1177 12/10/23 OTC	2023年10月12日	(241)	(20)	221
TWD	(130,000)	C 2317 TT 120.84 10/11/23 OTC	2023年11月10日	(468)	(329)	139
HKD	(45,000)	C 2318 HK 56.889 25/10/23 OTC	2023年10月25日	(288)	(75)	213
TWD	(33,000)	C 2454 TT 865 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(1,508)	0	1,508
HKD	(110,000)	C 2601 HK 24.625 27/10/23 OTC	2023年10月27日	(308)	(227)	81
HKD	(110,000)	C 2601 HK 25.064 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(352)	(6)	346
JPY	(10,000)	C 4063 JT 5426.7638 27/10/23 OTC	2023年10月27日	(352)	(9)	343
JPY	(9,000)	C 4183 JT 4577.1 26/10/23 OTC	2023年10月26日	(222)	(22)	200
JPY	(7,000)	C 5201 JT 5721.3783 16/10/23 OTC	2023年10月16日	(242)	(392)	(150)
JPY	(5,000)	C 6201 JT 14964 20/11/23 OTC	2023年11月20日	(970)	(431)	539
JPY	(17,000)	C 6503 JT 2103.3376 27/10/23 OTC	2023年10月27日	(176)	(121)	55
JPY	(8,000)	C 6762 JT 6307.2 20/10/23 OTC	2023年10月20日	(231)	(340)	(109)
JPY	(16,000)	C 6902 JT 2765.28 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(120)	(4)	116
JPY	(16,000)	C 6902 JT 2892.75 24/11/23 OTC	2023年11月24日	(1,048)	(331)	717
JPY	(30,000)	C 6952 JT 1533.91 10/10/23 OTC	2023年10月10日	(239)	(1)	238
JPY	(34,000)	C 7202 JT 2196.72 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(404)	(705)	(301)
JPY	(25,000)	C 7203 JT 2867.1 13/10/23 OTC	2023年10月13日	(878)	(769)	109
JPY	(18,000)	C 7203 JT 3179.56 17/11/23 OTC	2023年11月17日	(436)	(354)	82
JPY	(18,000)	C 7267 JT 1753.4549 02/11/23 OTC	2023年11月2日	(5,482)	(3,103)	2,379

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	(27,000)	C 7267 JT 2067.36 14/12/23 OTC	2023年12月14日	(1,208)	(663)	545
JPY	(27,000)	C 7267 JT 2093.4004 08/12/23 OTC	2023年12月8日	(778)	(399)	379
JPY	(6,000)	C 7269 JT 6950.72 31/10/23 OTC	2023年10月31日	(219)	(409)	(190)
JPY	(15,000)	C 7751 JT 4140.1238 24/10/23 OTC	2023年10月24日	(259)	(23)	236
JPY	(30,000)	C 7752 JT 1522.6461 02/11/23 OTC	2023年11月2日	(161)	(146)	15
JPY	(10,000)	C 8001 JT 6390.016 27/10/23 OTC	2023年10月27日	(390)	(10)	380
JPY	(8,000)	C 8015 JT 9801.8755 06/10/23 OTC	2023年10月6日	(1,577)	(50)	1,527
JPY	(13,000)	C 8031 JT 6700.8 26/10/23 OTC	2023年10月26日	(962)	(28)	934
JPY	(2,300)	C 8035 JT 27514.5 20/10/23 OTC	2023年10月20日	(500)	(1)	499
JPY	(6,000)	C 8058 JT 8160.7729 07/11/23 OTC	2023年11月7日	(408)	(633)	(225)
JPY	(23,000)	C 8306 JT 1351.332 23/10/23 OTC	2023年10月23日	(177)	(1,341)	(1,164)
JPY	(22,000)	C 8308 JT 895.356 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(183)	(519)	(336)
JPY	(8,000)	C 8316 JT 7945.2622 27/10/23 OTC	2023年10月27日	(689)	(2,164)	(1,475)
JPY	(18,000)	C 8591 JT 2939.695 19/10/23 OTC	2023年10月19日	(481)	(2,527)	(2,046)
JPY	(18,000)	C 8591 JT 3144.12 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(409)	(1,168)	(759)
JPY	(15,000)	C 8766 JT 3604.9855 20/10/23 OTC	2023年10月20日	(419)	(2,941)	(2,522)
JPY	(15,000)	C 8766 JT 3676.7394 07/11/23 OTC	2023年11月7日	(596)	(3,567)	(2,971)
JPY	(11,000)	C 9104 JT 4708.145 30/10/23 OTC	2023年10月30日	(376)	(750)	(374)
HKD	(700,000)	C 939 HK 4.788 11/10/23 OTC	2023年10月11日	(840)	(34)	806
HKD	(800,000)	C 939 HK 4.902 20/10/23 OTC	2023年10月20日	(480)	(80)	400
HKD	(900,000)	C 939 HK 5.106 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(450)	(157)	293
JPY	(300,000)	C 9432 JT 181.7282 23/10/23 OTC	2023年10月23日	(377)	(2,519)	(2,142)
JPY	(300,000)	C 9432 JT 181.888 06/11/23 OTC	2023年11月6日	(434)	(3,830)	(3,396)
				(2,079,034)	(1,686,322)	392,712
				(2,079,034)	(1,686,322)	392,712

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日2024年8月19日）

作成対象期間（2023年8月22日～2024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ない、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ないます。
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	株式への投資は行ないません。

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<https://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
		期騰	落中率			
18期(2020年8月19日)	円 10,203		% △0.0	% 68.2	% —	百万円 3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159
20期(2022年8月19日)	10,199		△0.0	57.5	—	7,850
21期(2023年8月21日)	10,196		△0.0	5.7	—	6,733
22期(2024年8月19日)	10,198		0.0	67.7	—	3,413

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

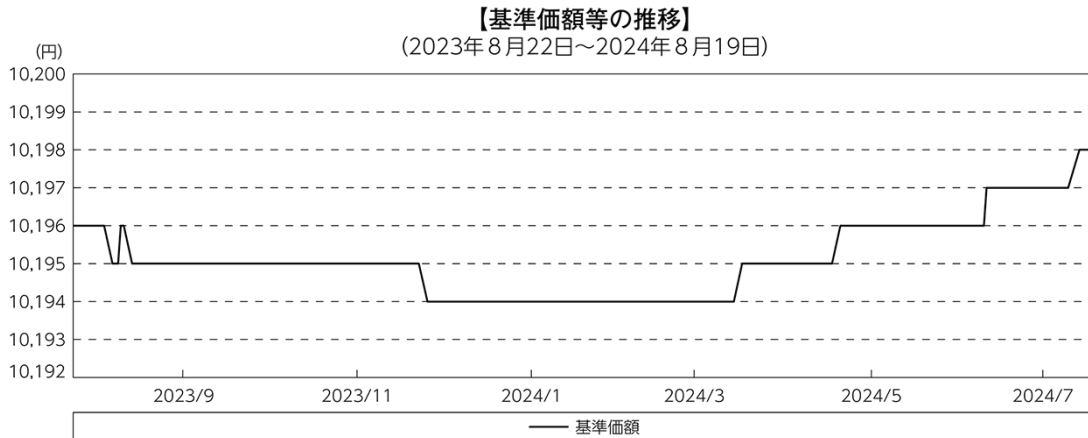
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2023年8月21日	円 10,196		% —	% 5.7	% —
8月末	10,196		0.0	5.3	—
9月末	10,195		△0.0	10.5	—
10月末	10,195		△0.0	9.3	—
11月末	10,195		△0.0	12.6	—
12月末	10,194		△0.0	10.1	—
2024年1月末	10,194		△0.0	4.3	—
2月末	10,194		△0.0	5.6	—
3月末	10,194		△0.0	11.7	—
4月末	10,195		△0.0	28.1	—
5月末	10,196		0.0	64.1	—
6月末	10,196		0.0	55.7	—
7月末	10,197		0.0	3.8	—
(期末) 2024年8月19日	10,198		0.0	67.7	—

*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のインカムゲイン（利子収入）等。

○投資環境

国内経済は、緩やかな回復が続きました。このような中、日銀は2023年10月に実質的な長期金利の上限+1%を「上限の目途」と変更しました。また2024年3月にはイールドカーブ・コントロールの運用やマイナス金利政策を解除するとともに、無担保コール翌日物レートの誘導目標を0～0.1%程度とし、7月には0～0.1%程度から0.25%程度への引き上げを決定しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りおよび無担保コール翌日物レートは期首よりそれぞれ-0.3%～-0.1%程度、-0.1%～0%程度で推移しましたが、上記のような環境のもとで、期末にかけてはそれぞれ0.1%前後、0.23%程度で推移しました。

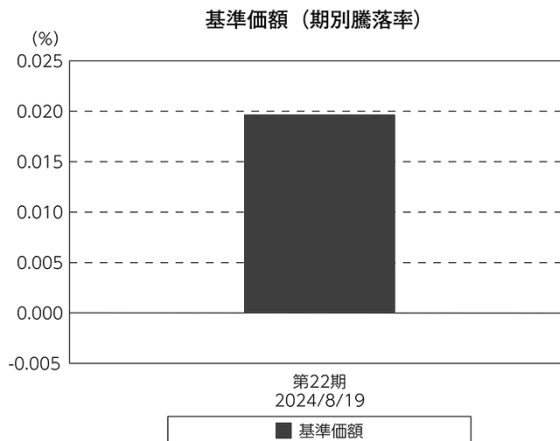
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

(2023年8月22日～2024年8月19日)

該当事項はございません。

○ 売買及び取引の状況

(2023年8月22日～2024年8月19日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	217,190,000	215,090,584
	地方債証券	570,798	(720,000)
	特殊債券	1,241,289	(1,164,000)
	社債券 (投資法人債券を含む)	120,046	(220,000)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分です。

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

○ 利害関係人との取引状況等

(2023年8月22日～2024年8月19日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 1,932	百万円 157	8.1	百万円 -	百万円 -	-

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

○組入資産の明細

(2024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BB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	2,100,000	2,100,000	61.5	—	61.5	—	—
	(2,100,000)	(2,100,000)	(61.5)	(—)	(61.5)	(—)	(—)
地方債証券	80,000	80,030	2.3	—	—	—	2.3
	(80,000)	(80,030)	(2.3)	(—)	(—)	(—)	(2.3)
特殊債券 (除く金融債)	130,000	130,078	3.8	—	—	—	3.8
	(130,000)	(130,078)	(3.8)	(—)	(—)	(—)	(3.8)
合 計	2,310,000	2,310,108	67.7	—	61.5	—	6.2
	(2,310,000)	(2,310,108)	(67.7)	(—)	(61.5)	(—)	(6.2)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期		末		償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	額	
国債証券	%	千円	千円		
国債バスケット(変動利付・利付・国庫短期証券)※	—	2,100,000	2,100,000		—
小 計		2,100,000	2,100,000		
地方債証券					
相模原市 公募平成26年度第1回	0.529	80,000	80,030		2024/9/20
小 計		80,000	80,030		
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225回	0.556	50,000	50,007		2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	0.539	80,000	80,071		2024/10/31
小 計		130,000	130,078		
合 計		2,310,000	2,310,108		

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

*※印は現先で保有している債券です。

○投資信託財産の構成

(2024年8月19日現在)

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,310,108	55.3
コール・ローン等、その他	1,867,200	44.7
投資信託財産総額	4,177,308	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 (2024年8月19日現在)

項目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,177,308,064
コール・ローン等	1,785,184,058
公社債(評価額)	2,310,108,969
未収利息	174,151
前払費用	71,886
差入委託証拠金	81,769,000
(B) 負債	763,418,000
未払解約金	763,418,000
(C) 純資産総額(A-B)	3,413,890,064
元本	3,347,617,461
次期繰越損益金	66,272,603
(D) 受益権総口数	3,347,617,461口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,198円

(注) 期首元本額は6,603,862,387円、期中追加設定元本額は23,993,903,041円、期中一部解約元本額は27,250,147,967円、1口当たり純資産額は1.0198円です。

○損益の状況 (2023年8月22日～2024年8月19日)

項目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,208,786
受取利息	3,779,241
その他収益金	175,069
支払利息	△ 745,524
(B) 有価証券売買損益	△ 2,200,748
売買益	45,802
売買損	△ 2,246,550
(C) 当期損益金(A+B)	1,008,038
(D) 前期繰越損益金	129,271,098
(E) 追加信託差損益金	467,816,959
(F) 解約差損益金	△531,823,492
(G) 計(C+D+E+F)	66,272,603
次期繰越損益金(G)	66,272,603

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	1,407,593,108
野村アンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2210(適格機関投資家販売制限付)	1,110,121,107
ノムラ・プライベート・シリーズDCアンジェロ・ゴードンDCファンド(為替ヘッジあり)2902(適格機関投資家販売制限付)	351,175,044
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	241,254,938
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投信	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
ネクストコア	2,282,012
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(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
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信(毎月分配型)	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連株投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連株投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村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
グローバル・ストック Bコース	979,528
野村日本高配当株エンハンス戦略(除く金融)オープン(適格機関投資家専用)	931,647
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	626,503
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(ブラジルレアルコース)毎月分配型	398,357
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	373,897
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	132,547
グローバル・ストック Dコース	116,529
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	100,946
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(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(インドネシアルピアコース)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株投信(円コース)年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連株投信(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株投信(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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
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
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98,078
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース	98,078
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース	98,059
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース	98,059
マイライフ・エール(資産成長型)	98,049
マイライフ・エール(年2%目標払出型)	98,049
マイライフ・エール(年6%目標払出型)	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
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
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
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(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村アバンティス米国小型株ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,809
野村アバンティス米国小型株ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,809
野村アバンティス新興国株ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,809
野村アバンティス新興国株ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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PIMCO・トレンド戦略ファンド(米ドル売り円買い)(野村SMA・EW向け)	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
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,806
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,806
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
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794

〇お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する所要の約款変更を行ないました。

＜変更適用日：2024年7月4日＞