

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

運用報告書(全体版)

第20期 (決算日2021年11月17日)

作成対象期間 (2021年5月18日～2021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2026年11月17日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券を通じて、世界の高配当利回り株式(以下、「高配当株」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-通貨セレクトクラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)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-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)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。
	野村マネー マザーファンド	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

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 <http://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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 配 金	騰 落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
16期(2019年11月18日)	19,022	10	4.3	0.0	—	99.2	4,110
17期(2020年5月18日)	12,733	10	△33.0	0.0	—	99.2	2,411
18期(2020年11月17日)	16,230	10	27.5	0.0	—	99.3	2,720
19期(2021年5月17日)	20,592	10	26.9	0.0	—	98.3	2,846
20期(2021年11月17日)	22,325	10	8.5	0.0	—	98.7	2,609

* 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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期首)	円	%	%	%	%	%
2021年5月17日	20,592	—	0.0	—	98.3	
5月末	21,104	2.5	0.0	—	99.0	
6月末	21,386	3.9	0.0	—	99.2	
7月末	20,947	1.7	0.0	—	99.0	
8月末	21,018	2.1	0.0	—	99.1	
9月末	21,078	2.4	0.0	—	99.0	
10月末	21,895	6.3	0.0	—	99.0	
(期末)						
2021年11月17日	22,335	8.5	0.0	—	98.7	

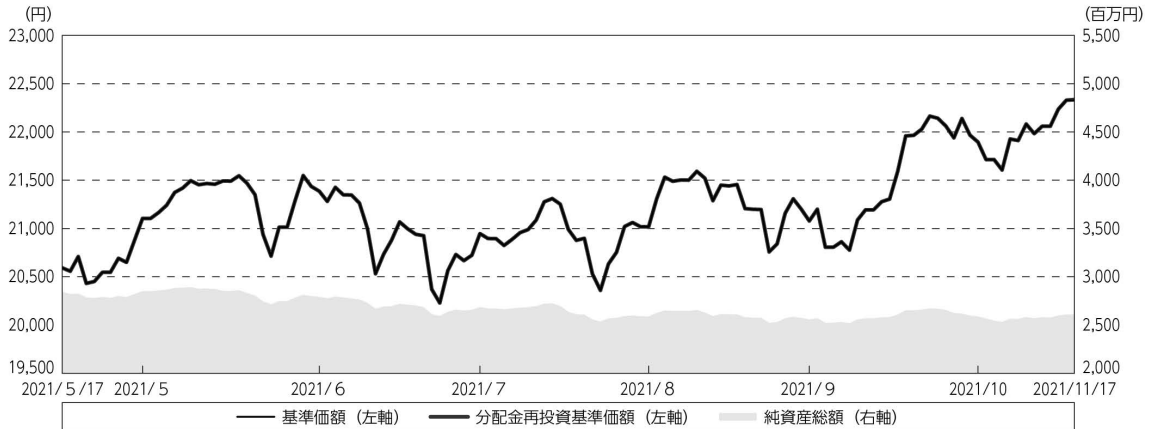
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：20,592円

期 末：22,325円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 8.5%（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（2021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20,592円から当作成期末には22,325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、当作成期初には米長期金利の上昇などを背景に一時下落しましたが、欧州主要企業の1-3月期決算や欧州の経済指標が市場予想を上回ったことなどから持ち直しました。その後は、グローバルな経済正常化への期待が高まる中、堅調に推移しましたが、6月のFOMC（米連邦公開市場委員会）の結果を受けて米金融政策の正常化が早まるとの見方が強まり下落しました。BOE（英中央銀行）が早期の金融緩和縮小に慎重な姿勢を示したことや、6月の独IFO景況感指数が市場予想を上回る改善を見せたことなどを受けて底堅く推移しましたが、7月中旬には新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒感などから下落しました。

その後は米国企業や欧州企業の市場予想を上回る4-6月期の企業決算などを背景に上昇しましたが、8月中旬に、7月開催のFOMC議事要旨で大半の参加者が年内のテーパリング（量的金融緩和の縮小）開始が適切と見ていたことが警戒され、下落しました。パウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が金融政策の正常化を慎重に進める姿勢を示したことを受け、底堅く推移するものの、9月には、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和の縮小観測が台頭したこと、市場予想を下回った8月の米雇用統計を受けて景気の先行き不透明感が意識されたこと、中国の大手不動産会社の債務問題を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどをを受けて下落しました。10月には、米国企業や欧州企業の7-9月期決算が堅調であったことなどを背景に上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

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

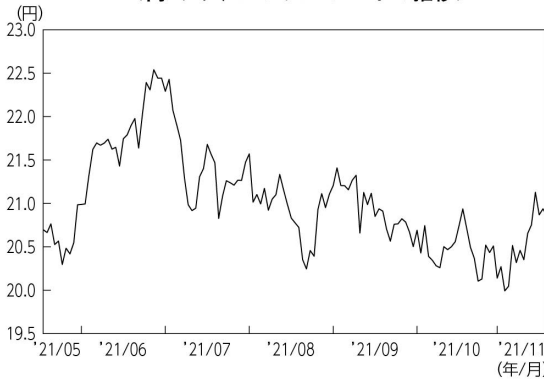
＜為替レート＞

発表された経済指標から中国経済の減速が確認され、その影響が新興国全体に広がる懸念が高まったことや、国際的なエネルギー価格上昇が資源国通貨にとっては心強い反面、景気回復途上にある新興国にとっては想定以上のインフレ率上昇などに繋がるのが警戒され、新興国通貨は対円でまちまちの動きとなりました。

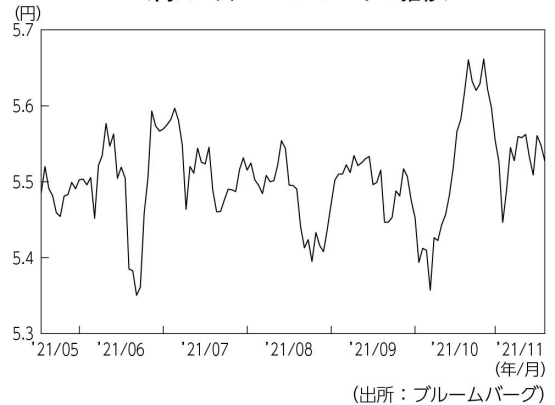
インドネシアはアジア有数の資源国として石炭などの価格上昇の恩恵を受けました。また、インドネシア国会において付加価値税の増税などを盛り込んだ税制改革法案が可決され、2023年には財政赤字をGDP比で3%以内とする財政規律ルールへの遵守に向けて政府が政策を策定していることが好感され、通貨は対円で堅調に推移しました。

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

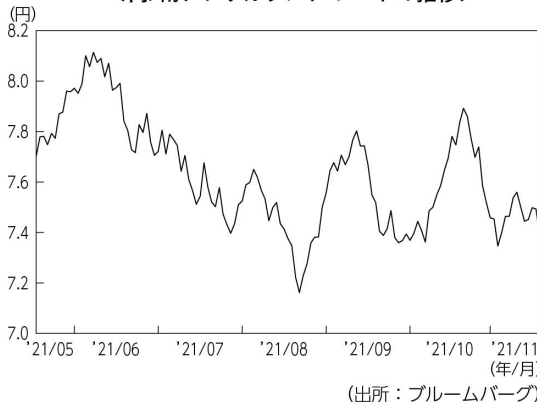
＜円/ブラジルレアル レートの推移＞



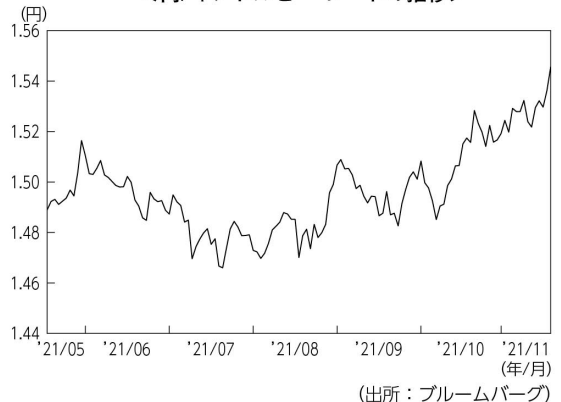
＜円/メキシコペソ レートの推移＞



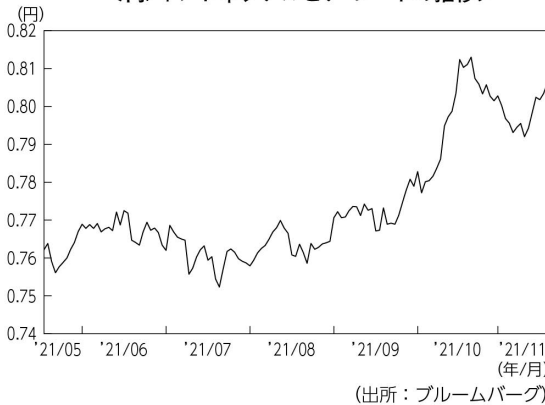
＜円/南アフリカランド レートの推移＞



＜円/インドルピー レートの推移＞



<円/インドネシアルピア レートの推移>



※インドネシアルピアは100ルピアあたりの円価格を表示しています。

○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）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	92.9%
カバー率	36.0%
平均行使価格	103.1%
平均行使期間	30.9日
配当利回り(年率、米ドル為替取引後ベース)※	3.0%
プレミアム(年率)	3.2%

・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28.3%、欧州34.7%、アジア・太平洋30.0%となりました。同ポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、金融26.8%、生活必需品16.2%、通信10.7%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。

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

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

【野村マネー マザーファンド】

残存1年以内の公社債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20期
	2021年5月18日～ 2021年11月17日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.045%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	35,618

(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）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、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なうことで、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。

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

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、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

(2021年5月18日～2021年11月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	104	0.488	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(41)	(0.194)	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 ）	(59)	(0.277)	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 ）	(4)	(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	104	0.490	
期中の平均基準価額は、21,238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。

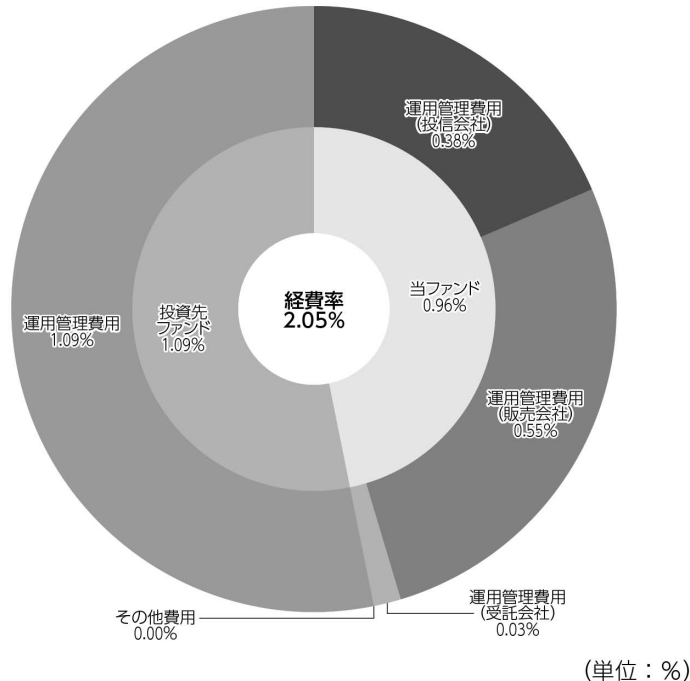
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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）

○経费率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経费率（年率）は2.05%です。



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

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

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

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

○売買及び取引の状況

(2021年5月18日～2021年11月17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	—	—	115,612	345,178

*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

(2021年5月18日～2021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）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 9,111	百万円 30	% 0.3	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

(2021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	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- 通貨セレクトクラス	951,707	836,095	2,576,008 98.7
合 計	951,707	836,095	2,576,008 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	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	1,002

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年11月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,576,008	98.1
野村マネー マザーファンド	1,002	0.0
コール・ローン等、その他	49,018	1.9
投資信託財産総額	2,626,028	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（2021年11月17日現在）

○損益の状況（2021年5月18日～2021年11月17日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,626,028,057
コール・ローン等	49,016,610
投資信託受益証券(評価額)	2,576,008,695
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,002,752
(B) 負債	16,834,183
未払収益分配金	1,168,726
未払解約金	2,579,501
未払信託報酬	13,041,514
未払利息	41
その他未払費用	44,401
(C) 純資産総額(A-B)	2,609,193,874
元本	1,168,726,169
次期繰越損益金	1,440,467,705
(D) 受益権総口数	1,168,726.169口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,325円

(注) 期首元本額は1,382,171,477円、期中追加設定元本額は3,545,495円、期中一部解約元本額は216,990,803円、1口当たり純資産額は2,2325円です。

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	99,498,508
受取配当金	99,504,383
支払利息	△ 5,875
(B) 有価証券売買損益	115,971,970
売買益	124,321,780
売買損	△ 8,349,810
(C) 信託報酬等	△ 13,085,915
(D) 当期損益金(A+B+C)	202,384,563
(E) 前期繰越損益金	268,128,766
(F) 追加信託差損益金	971,123,102
(配当等相当額)	(1,892,220,137)
(売買損益相当額)	(△ 921,097,035)
(G) 計(D+E+F)	1,441,636,431
(H) 収益分配金	△ 1,168,726
次期繰越損益金(G+H)	1,440,467,705
追加信託差損益金	971,123,102
(配当等相当額)	(1,892,220,137)
(売買損益相当額)	(△ 921,097,035)
分配準備積立金	2,270,588,852
繰越損益金	△1,801,244,249

*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（2021年5月18日～2021年11月17日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年5月18日～ 2021年11月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	93,456,646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	1,892,220,137円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,178,300,932円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	4,163,977,715円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	35,628円
g. 分配金	1,168,726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

該当事項はございません。

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

2020年9月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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

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

純資産計算書
2020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 : 450,387,545米ドル)	397,152,218
投資オプション契約時価(買い) (取得原価 : 312,895米ドル)	422,344
現金預金等	35,607,719
ブローカーからの未収金	658,014
未収収益	939,200
	434,779,495
資産合計	
負債	
投資オプション契約時価(売り) (取得原価 : 4,295,191米ドル)	2,957,174
銀行借越金	1,060,000
外国為替先渡し契約に係る評価差損	2,478,644
受益証券買戻支払金	2,395,729
ブローカーへの未払金	2,607,639
未払費用	1,281,927
未払利息	11
	12,781,124
負債合計	
純資産総額	421,998,371

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)	7,398	388,797	2,876,286,672
通貨セレクトクラス(円)	2,132	15,758,769	33,598,024,377

運用計算書
2020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	396,429
債券利息(源泉徴収税控除後)	14,276
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	12,404,184
雑収益	89,736
	12,904,625
収益合計	12,904,625
費用	
投資顧問報酬	4,986,072
事務管理代行報酬	544,922
保管費用	163,924
当座借越利息	2,548
取引銀行報酬	106,434
銀行手数料	104,688
受託報酬	109,094
法務報酬	7,856
立替費用	108,961
専門家報酬	52,247
雑費用	60,301
	6,247,047
費用合計	6,247,047
純投資損益	6,657,578
投資有価証券売買に係る損益	(5,120,198)
オプション契約に係る損益	131,959
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	(39,970,096)
	(44,958,335)
当期実現純損益	(44,958,335)
投資有価証券評価損益の増減	(57,297,016)
オプション契約に係る評価損益の増減	2,664,356
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(5,582,946)
	(60,215,606)
当期評価差損益	(60,215,606)
運用の結果による純資産の増減額	(98,516,363)

純資産変動計算書
2020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	697, 119, 768
純投資損益	6, 657, 578
当期実現純損益	(44, 958, 335)
当期評価差損益	(60, 215, 606)
運用の結果による純資産の増減額	(98, 516, 363)
受益証券の発行手取金	39, 645, 288
受益証券の買戻支払金	(138, 113, 963)
	(98, 468, 675)
受益者への支払分配金	(78, 136, 359)
期末純資産総額	421, 998, 371

発行済受益証券数の変動表
2020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	375,596
発行受益証券数	83,354
買戻受益証券数	(70,153)
期末発行済受益証券数	388,797

通貨セレクトクラス

期首受益証券数	19,117,107
発行受益証券数	689,171
買戻受益証券数	(4,047,509)
期末発行済受益証券数	15,758,769

統計情報
2020年9月30日現在
(未監査)

	2020	2019	2018
期末純資産総額(米ドル)	421,998,371	697,119,768	985,326,827
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	2,876,286,672	3,361,982,245	3,897,801,215
期末1口当たり純資産価格	7,398	8,951	9,992
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	33,598,024,377	61,333,117,571	93,578,949,254
期末1口当たり純資産価格	2,132	3,208	3,915

組入資産明細
2020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				
投資信託				
65,280	CHARTER HALL GRO REIT	432,817	577,536	0.14
		432,817	577,536	0.14
普通株式				
28,087	CSL LTD	4,589,809	5,737,399	1.36
3,896,894	SOUTH32 LTD	7,612,544	5,704,442	1.35
199,886	BHP BILLITON (AUD)*	4,753,040	5,064,774	1.20
85,217	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA*	4,357,694	3,858,152	0.91
216,973	NTL AUSTRALIA BANK LTD*	3,302,935	2,741,144	0.65
101,033	WOOLWORTHS GROUP	2,670,570	2,619,692	0.62
24,822	MACQUARIE GROUP LTD	2,208,905	2,112,451	0.50
87,101	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,546,825	1,857,965	0.44
128,345	GOODMAN GROUP STAPLED	1,499,517	1,638,812	0.39
23,595	RIO TINTO LTD	1,616,135	1,583,987	0.38
153,865	BLUESCOPE STEEL LTD	1,483,072	1,390,821	0.33
489,167	WEBJET LTD	1,846,956	1,354,361	0.32
318,590	SYDNEY AIRPORT	1,382,270	1,328,793	0.31
171,214	BRAMBLES LTD	1,447,540	1,278,329	0.30
106,035	FORTESCUE METALS	1,095,226	1,230,168	0.29
101,527	WESTPAC BANKING CORP	1,693,040	1,216,890	0.29
108,344	TRANSURBAN GROUP	1,040,611	1,088,077	0.26
48,637	NEWCREST MINING LTD	1,146,591	1,081,448	0.26
11,928	REA GROUP LTD	794,562	933,619	0.22
87,596	OZ MINERALS LTD	663,552	873,474	0.21
87,985	NORTHERN STAR RE	566,379	854,183	0.20
196,186	SARACEN MIN HLDG	554,930	721,915	0.17
148,996	BAPCOR LTD	484,027	720,066	0.17
17,616	MAGELLAN FIN GRP	615,191	710,163	0.17
413,658	MIRVAC GROUP	801,445	641,838	0.15
50,121	CORPORATE TRAVEL	452,336	614,657	0.15
385,501	SCENTRE GROUP	647,006	603,637	0.14
207,079	QANTAS AIRWAYS LTD	597,003	596,924	0.14
620,675	BEACH ENERGY LTD	658,962	583,131	0.14
167,594	SANTOS LTD	694,494	582,111	0.14
6,147	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	218,507	346,598	0.08
		53,041,674	51,670,021	12.24
	合計：オーストラリア	53,474,491	52,247,557	12.38

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
		ベルギー			
普通株式	52,434	AGEAS NV	1,899,555	2,153,662	0.51
		合計：ベルギー	1,899,555	2,153,662	0.51
		バミューダ諸島			
普通株式	30,990	AXALTA COATING S	705,474	694,176	0.16
	72,000	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	614,736	335,839	0.08
	400,000	K WAH INTL HLDGS	237,172	191,996	0.05
	300,000	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE	201,992	174,190	0.04
		合計：バミューダ諸島	1,759,374	1,396,201	0.33
		ブラジル			
普通株式	151,586	ITAU UNIBANCO HOLDING SA SP ADR	900,980	601,039	0.14
	77,152	PETROLEO BRASILEIRO S.A ADR	694,399	548,551	0.13
	146,528	BANCO BRADESCO SPONSORED ADR	650,901	501,858	0.12
		合計：ブラジル	2,246,280	1,651,448	0.39
		カナダ			
普通株式	79,483	GILDAN ACTIVEWEA	1,336,359	1,617,479	0.39
	16,210	OPEN TEXT CORP	712,390	690,384	0.16
		合計：カナダ	2,048,749	2,307,863	0.55
		ケイマン諸島			
普通株式	480,000	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	541,621	964,937	0.23
	142,000	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,588,889	853,816	0.20
	205,000	SHIMAO GROUP HOL	496,290	846,435	0.20
	180,000	CHINA RES LAND	823,796	810,565	0.19
	750,000	CIFI HOLDINGS GR	584,427	551,602	0.13
	70,000	HENGAN INTL	477,472	508,055	0.12
	114,000	MINTH GROUP LTD	320,348	494,971	0.12
	120,000	SANDS CHINA LTD	473,321	462,185	0.11
	300,000	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	228,785	414,186	0.10
	82,000	CK ASSET HOLDINGS LTD	509,155	399,412	0.09
	450,000	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS LTD	564,347	209,028	0.05
		合計：ケイマン諸島	6,608,451	6,515,192	1.54

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
		中国			
普通株式					
	3,650,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	2,833,117	2,364,213	0.56
	2,050,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	1,329,673	1,063,335	0.25
	101,000	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD H	709,408	694,606	0.16
	220,000	CHINA PACIFIC INSURANCE CO LTD H	670,182	621,666	0.15
	364,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	421,905	366,341	0.09
	900,000	CHINA PETROL & CHEM CORP SINOPEC H	594,602	361,154	0.09
	1,100,000	BANK OF CHINA LTD H	510,500	340,639	0.08
	650,000	PETROCHINA-H	380,287	190,383	0.05
	70,000	WEICHAI POWER-H	132,844	140,178	0.03
			<u>7,582,518</u>	<u>6,142,515</u>	<u>1.46</u>
		合計：中国	<u>7,582,518</u>	<u>6,142,515</u>	<u>1.46</u>
		デンマーク			
普通株式					
	6,914	SCANDINAVIAN TOB	79,509	102,888	0.02
			<u>79,509</u>	<u>102,888</u>	<u>0.02</u>
		合計：デンマーク	<u>79,509</u>	<u>102,888</u>	<u>0.02</u>
		フランス			
普通株式					
	70,295	SANOFI	6,080,975	7,146,038	1.70
	30,048	ARKEMA	2,468,947	3,217,128	0.76
	86,851	BNP PARIBAS	4,539,781	3,195,895	0.76
	84,592	PUBLICIS GROUPE	4,225,627	2,754,997	0.65
	53,550	SANOFI- ADR	2,542,324	2,711,237	0.64
	93,370	DANONE- ADR	1,341,312	1,212,886	0.29
			<u>21,198,966</u>	<u>20,238,181</u>	<u>4.80</u>
		合計：フランス	<u>21,198,966</u>	<u>20,238,181</u>	<u>4.80</u>
		ドイツ			
普通株式					
	46,166	CONTINENTAL A. G.	5,584,909	5,013,233	1.20
	22,926	ALLIANZ AG HOLDING REG	5,122,409	4,442,276	1.05
	180,150	BAYER AG- ADR	3,508,612	2,831,958	0.67
	1,091,426	TELEFONICA DEUTS	3,016,492	2,799,090	0.66
	21,976	SIEMENS AG- ADR	1,264,719	1,536,782	0.36
			<u>18,497,141</u>	<u>16,623,339</u>	<u>3.94</u>
		合計：ドイツ	<u>18,497,141</u>	<u>16,623,339</u>	<u>3.94</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
		香港			
普通株式					
	119,000	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	1,637,492	1,517,029	0.35
	160,000	CHINA MOBILE LTD	1,368,983	1,020,884	0.24
	1,000,000	CNOOC LTD	1,456,432	961,272	0.23
	67,000	AIA GROUP LTD	378,007	656,155	0.16
	12,500	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	406,025	583,537	0.14
	225,000	CHINA OVERSEAS LAND&INVEST LTD	710,949	563,215	0.13
	200,000	HANG LUNG PROPERTIES LTD	476,730	505,281	0.12
	280,000	GUANGDONG INVESTMENT LTD	438,655	442,933	0.10
	110,000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	359,917	289,543	0.07
	230,000	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING CO LTD	379,045	233,854	0.06
	170,000	SINO LAND	312,388	197,416	0.05
			7,924,623	6,971,119	1.65
		合計：香港	7,924,623	6,971,119	1.65
		アイルランド			
普通株式					
	100,510	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	1,918,908	2,370,771	0.56
	3,610	MEDTRONIC PLC	353,699	371,902	0.09
			2,272,607	2,742,673	0.65
		合計：アイルランド	2,272,607	2,742,673	0.65
		イタリア			
普通株式					
	622,256	ENI SPA	9,227,072	4,929,901	1.17
	373,539	UNICREDIT SPA	2,745,732	3,093,072	0.73
	1,485,720	BANCA INTESA SPA	3,427,105	2,816,068	0.67
			15,399,909	10,839,041	2.57
		合計：イタリア	15,399,909	10,839,041	2.57
		日本			
普通株式					
	58,000	mitsui & co ltd	907,609	990,050	0.24
	35,000	itochu corp	498,760	889,705	0.21
	13,000	toyota motor corp	821,443	853,170	0.20
	60,500	mitsubishi electric corp	793,206	814,209	0.19
	40,000	nippon telg & tel corp	757,362	814,202	0.19
	62,000	orix corp	991,482	766,012	0.18
	27,500	kddi corp	777,761	691,503	0.16
	25,500	sumitomo mitsui trust holdings inc	911,820	674,166	0.16
	18,000	ntt docomo	419,548	662,060	0.16

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
185,000	ENEOS HOLDINGS INC	835,459	656,805	0.16
27,000	MITSUBISHI CORP	662,191	642,249	0.15
14,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	519,407	609,704	0.14
24,000	HONDA MOTOR CO LTD	646,378	562,026	0.13
46,500	SOFTBANK CORP	605,987	518,379	0.12
22,000	KOMATSU LTD	510,765	481,136	0.11
120,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	685,487	472,729	0.11
7,500	NIPPON EXPRESS	438,759	435,977	0.10
15,000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	515,388	414,320	0.10
2,600	FUJITSU LTD	167,067	352,985	0.08
11,000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	439,320	338,462	0.08
2,600	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	209,099	336,862	0.08
13,500	MITSUMI MINING & SMELTING CO LTD	302,944	325,278	0.08
5,000	NITTO DENKO CORP	341,963	323,787	0.08
10,500	DAIICHI SANKYO CO LTD	98,812	320,990	0.08
18,000	KUBOTA CORP	249,400	319,953	0.08
30,000	SANWA HOLDINGS CORP	297,700	315,550	0.07
1,200	TOKYO ELECTRON LTD	151,577	310,495	0.07
13,000	JSR CORPORATION	249,764	306,339	0.07
6,000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	258,175	294,533	0.07
11,500	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	310,082	293,692	0.07
4,500	MURATA MANUFACTURING CO LTD	200,440	288,554	0.07
12,000	MITSUMI CHEMICALS INC	337,586	288,114	0.07
5,800	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	372,583	285,044	0.07
1,200	HIKARI TSUSHIN INC	125,176	283,797	0.07
29,000	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	322,934	280,047	0.07
16,000	NGK SPARK PLUG CO LTD	325,978	277,207	0.07
36,000	SHIKOKU ELEC PWR	347,282	274,026	0.06
42,000	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	226,498	273,174	0.06
7,000	MABUCHI MOTOR CO LTD	231,745	270,059	0.06
49,000	CHIBA BANK LTD	318,814	268,601	0.06
13,500	SUBARU CORP	403,833	259,711	0.06
5,000	MEITEC CORPORATION	224,482	253,255	0.06
7,500	TAISEI CORP	228,936	252,071	0.06
7,000	HITACHI CONST MACH CO LTD	163,554	251,834	0.06
4,500	SCSK CORP	218,703	250,083	0.06
27,000	OBAYASHI CORP	284,857	244,118	0.06
17,000	NGK INSULATORS LTD	344,721	240,616	0.06
12,000	CANON MARKETING	267,183	238,807	0.06
17,000	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	330,396	237,718	0.06
17,000	SUMCO CORP	233,322	237,397	0.06
35,500	RICOH CO LTD	268,691	237,283	0.06
18,000	STAR MICRONICS CO LTD	247,828	237,217	0.06
68,000	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	268,041	234,982	0.06

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
43,000	INPEX CORP	278,017	229,401	0.05
3,000	MEIJI HOLDINGS CO LTD	234,831	228,355	0.05
12,500	JAPAN TOBACCO INC	410,371	227,219	0.05
24,000	AMADA CO LTD	260,940	223,129	0.05
4,300	ABC-MART INC	265,732	222,684	0.05
7,000	FUJI ELECTRIC CO LTD	225,748	219,361	0.05
26,000	PANASONIC CORP	247,105	218,782	0.05
3,000	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	161,475	218,386	0.05
12,000	USS CO LTD	212,011	213,472	0.05
4,700	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	84,450	209,804	0.05
14,000	ASTELLAS PHARMA INC	193,577	207,697	0.05
6,500	AISIN SEIKI CO LTD	275,338	206,154	0.05
9,000	KANAMOTO CO LTD	213,413	203,901	0.05
9,500	SATO HOLDINGS CORP	208,657	201,198	0.05
11,500	mitsui FUDOSAN CO LTD	209,742	198,862	0.05
7,000	COMSYS HOLDINGS CORP	166,744	193,581	0.05
4,000	ADVANTEST CORP	203,196	192,758	0.05
18,000	OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD	245,951	192,568	0.05
12,000	TOYO TIRE CORP	161,300	192,227	0.05
2,500	KAO CORP	136,568	186,675	0.04
8,000	HITACHI CAPITAL	168,414	186,547	0.04
11,500	CASIO COMPUTER CO LTD	190,784	184,436	0.04
11,500	BROTHER INDS LTD	207,424	181,387	0.04
9,500	MARUI GROUP CO LTD	176,122	180,871	0.04
25,000	DAICEL CORP	236,213	179,172	0.04
19,000	SENKO GROUP HOLDINGS	137,591	176,284	0.04
11,000	SEKISUI CHEM CO	160,715	174,646	0.04
2,800	EAST JAPAN RAILWAY CO	185,098	171,778	0.04
3,000	KYOCERA CORP	193,596	170,329	0.04
6,500	KYOWA EXEO CORP	132,334	168,739	0.04
10,000	BELLSYSTEM24 HOLDINGS INC	137,281	167,290	0.04
6,000	NIFCO INC	144,458	162,575	0.04
4,500	AICA KOGYO CO	141,288	158,911	0.04
13,000	SUMITOMO CORP	194,681	154,892	0.04
10,000	HITACHI METALS LTD	123,091	152,899	0.04
3,400	PIGEON CORP	125,528	151,290	0.04
4,800	NIHON UNISYS LTD	88,141	149,965	0.04
4,000	AZBIL CORP	66,013	148,450	0.04
5,000	AGC INC	198,564	145,326	0.03
4,000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	171,137	141,785	0.03
3,000	NOEVIR HOLDING CO LTD	161,236	139,740	0.03
4,500	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	135,574	138,249	0.03
30,000	OJI HOLDINGS CORPORATION	149,016	136,899	0.03
5,500	TSUBAKIMOTO CHAIN CO	240,131	128,563	0.03

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
5,000	DIC CORP	177,756	123,929	0.03
4,000	DENKA CO LTD	109,966	120,994	0.03
6,000	EIKEN CHEMICAL CO LTD	110,306	120,199	0.03
5,500	STARTS CORP INC	121,734	120,076	0.03
27,000	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	137,888	115,285	0.03
4,000	NIPPON STEEL TRA	168,877	113,420	0.03
4,000	KYOWA KIRIN CO LTD	78,049	113,079	0.03
6,000	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	153,566	111,224	0.03
7,500	YAMAHA MOTOR CO LTD	188,711	108,071	0.03
2,000	TAIYO HOLDINGS CO LTD	88,008	104,142	0.02
15,000	NISSHINBO HOLDINGS INC	105,446	101,539	0.02
8,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	105,358	99,901	0.02
5,000	LIXIL GROUP CORPORATION	91,669	99,882	0.02
2,500	ITOCHEU TECHNO-SOLUTIONS CORP	40,468	94,320	0.02
4,500	KYORIN HLDGS	86,020	90,831	0.02
9,000	SAKATA INX CORP	116,615	89,553	0.02
5,500	TOSOH CORP	80,543	88,781	0.02
5,000	SEKISUI HOUSE LTD	78,325	87,929	0.02
3,000	DENTSU GROUP INC	129,467	87,905	0.02
8,000	KONOIKE TRANSPORT CO LTD	120,503	87,555	0.02
2,500	HITACHI LTD	81,227	83,858	0.02
5,000	CANON INC	157,426	82,675	0.02
14,000	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	89,275	80,282	0.02
9,000	ISUZU MOTORS LTD	109,543	78,169	0.02
1,500	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	53,351	77,112	0.02
3,000	MIZUHO LEASING CO LTD	65,579	76,743	0.02
1,500	SAWAI PHARMA	80,185	75,408	0.02
3,000	INABA DENKISANGYO CO LTD	60,498	74,670	0.02
1,200	TREND MICRO INC	56,041	72,824	0.02
2,000	FUJIMI INC	60,778	69,207	0.02
6,000	SANKI ENGINEERING CO LTD	61,676	65,439	0.02
1,000	TOYOTA INDUSTRIES CORP	56,937	62,864	0.01
45,000	JVCKENWOOD CORP	81,204	62,201	0.01
2,000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	64,760	53,472	0.01
1,000	OTSUKA CORP	33,324	50,935	0.01
1,300	SOMPO HOLDINGS INC	40,931	44,665	0.01
500	DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD	68,364	44,118	0.01
1,000	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	36,905	42,111	0.01
1,500	MITSUBISHI HEAVY IND LTD	71,106	33,096	0.01
		33,546,279	33,096,744	7.84
	合計：日本	33,546,279	33,096,744	7.84

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
		ジャージー			
普通株式	338,394	WPP PLC ORD GBP 0.1	3,965,892	2,656,758	0.63
	117,068	AMCOR PLC-CDI	1,166,389	1,277,345	0.30
		合計：ジャージー	5,132,281	3,934,103	0.93
		ルクセンブルグ			
普通株式	122,192	RTL GROUP	7,596,852	4,785,215	1.13
		合計：ルクセンブルグ	7,596,852	4,785,215	1.13
		オランダ			
普通株式	519,614	ING GROEP NV - CVA	6,543,537	3,725,336	0.89
	58,689	UNILEVER NV NY SHS	3,255,801	3,564,770	0.84
	54,626	KONINKLIJKE P-NY	2,127,643	2,578,347	0.61
	13,390	NXP SEMICONDUCTO	1,374,529	1,693,032	0.40
	68,380	AIRBUS - ADR	964,842	1,249,986	0.30
	20,560	MYLAN NV	348,574	304,288	0.07
		合計：オランダ	14,614,926	13,115,759	3.11
		ニュージーランド			
普通株式	208,879	A2 MILK CO LTD	2,372,374	2,088,809	0.50
	12,981	XERO LTD	579,209	930,853	0.22
		合計：ニュージーランド	2,951,583	3,019,662	0.72
		ノルウェー			
普通株式	324,529	DNB ASA	4,180,170	4,437,438	1.05
	35,880	EQUINOR ASA- ADR	580,165	502,679	0.12
		合計：ノルウェー	4,760,335	4,940,117	1.17
		ポーランド			
普通株式	1,297,924	PGE POLSKA GRUPA ENERGA SA	5,431,298	2,155,663	0.51
	723,031	ORANGE POLSKA SA	1,753,403	1,282,878	0.30
		合計：ポーランド	7,184,701	3,438,541	0.81

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
		韓国			
普通株式					
	85,000	SAMSUNG ELECT CO LTD N/VOTING SHS	2,722,853	3,670,312	0.87
	9,000	HYUNDAI MOTOR CO LTD PREFERENCE	691,729	649,498	0.15
	66,000	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	469,430	620,768	0.15
	11,000	DB INSURANCE CO LTD	482,193	425,132	0.10
	1,200	KOREA ZINC CO LTD	360,213	386,313	0.09
	5,300	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	490,259	373,418	0.09
	1,000	SK TELECOM CO LTD	253,137	203,502	0.05
			<u>5,469,814</u>	<u>6,328,943</u>	<u>1.50</u>
		合計：韓国	<u>5,469,814</u>	<u>6,328,943</u>	<u>1.50</u>
		ロシア			
普通株式					
	55,858	LUKOIL PJSC-SPON ADR	3,255,983	3,211,835	0.76
	569,750	GAZPROM- ADR	2,745,197	2,474,424	0.59
			<u>6,001,180</u>	<u>5,686,259</u>	<u>1.35</u>
		合計：ロシア	<u>6,001,180</u>	<u>5,686,259</u>	<u>1.35</u>
		シンガポール			
投資信託					
	300,000	LENDLEASE GLOBAL REIT	211,283	148,981	0.04
			<u>211,283</u>	<u>148,981</u>	<u>0.04</u>
普通株式					
	90,051	DBS GROUP HOLDING LTD	1,302,677	1,309,367	0.31
	108,720	FLEX LTD	1,021,576	1,192,658	0.28
	415,000	SINGAPORE TELECOM 1000	1,168,406	642,518	0.15
	43,008	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	741,073	597,708	0.14
	240,000	KEPPEL DC REIT REIT	391,240	510,041	0.12
	180,000	SINGAPORE TECH ENGINEERING	478,982	454,831	0.11
	70,088	OVERSEAS CHINESE BANKING CORP LTD	503,499	430,980	0.10
	100,000	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST REIT	185,489	234,426	0.06
	120,000	YANLORD LAND GRO	114,806	99,029	0.02
			<u>5,907,748</u>	<u>5,471,558</u>	<u>1.29</u>
		合計：シンガポール	<u>6,119,031</u>	<u>5,620,539</u>	<u>1.33</u>
		スペイン			
普通株式					
	385,074	REPSOL SA	6,677,869	2,608,515	0.62
			<u>6,677,869</u>	<u>2,608,515</u>	<u>0.62</u>
		合計：スペイン	<u>6,677,869</u>	<u>2,608,515</u>	<u>0.62</u>

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
		スイス			
普通株式					
	53,573	SWISS RE AG	4,523,014	3,987,314	0.95
	10,176	SWATCH GROUP-BR	1,910,906	2,378,116	0.56
			<u>6,433,920</u>	<u>6,365,430</u>	<u>1.51</u>
		合計：スイス	<u>6,433,920</u>	<u>6,365,430</u>	<u>1.51</u>
		台湾			
普通株式					
	375,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	1,999,199	5,601,797	1.32
	31,229	TAIWAN SEMIC- ADR	1,829,589	2,538,604	0.60
	600,000	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	1,913,594	1,602,140	0.38
	265,000	FORMOSA PLASTICS CORP	890,214	718,583	0.17
	500,000	E INK HOLDINGS	655,659	657,209	0.16
	200,000	TAIWAN SECOM	571,990	580,966	0.14
	820,000	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	585,369	520,523	0.12
	22,000	WIWYNN CORP	289,099	495,615	0.12
	105,000	TONG HSING ELECTRONIC INDUSTRIES LT	296,574	481,781	0.11
	460,000	TECO ELECTRIC & MACHINERY CO LTD	313,719	473,708	0.11
	240,000	CTCI CORP	358,800	323,326	0.08
	240,000	CATHAY FINANCIAL HOLDINGS	374,806	319,600	0.08
	245,000	TONG YANG IND	324,072	302,592	0.07
	19,000	GLOBAL WAFERS	244,404	251,706	0.06
	110,000	UNI-PRESIDENT EN	262,240	237,182	0.06
	110,000	NANYA TECHNOLOGY	229,536	218,207	0.05
	20,000	KING SLIDE WORKS CO LTD	233,656	193,195	0.05
	125,000	PRIMAX ELECTRONICS LTD	198,433	184,355	0.04
			<u>11,570,953</u>	<u>15,701,089</u>	<u>3.72</u>
		合計：台湾	<u>11,570,953</u>	<u>15,701,089</u>	<u>3.72</u>
		タイ			
普通株式					
	850,000	PTT PCL/FOREIGN	1,019,763	859,238	0.20
	1,650,000	DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F	577,312	714,083	0.17
	200,000	TISCO FINANCIAL GROUP PUB CO NVDR	395,412	402,767	0.10
	1,500,000	WHA CORP PCL-F	155,398	133,624	0.03
			<u>2,147,885</u>	<u>2,109,712</u>	<u>0.50</u>
		合計：タイ	<u>2,147,885</u>	<u>2,109,712</u>	<u>0.50</u>
		トルコ			
普通株式					
	1,555,240	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	3,509,019	1,420,109	0.34
			<u>3,509,019</u>	<u>1,420,109</u>	<u>0.34</u>
		合計：トルコ	<u>3,509,019</u>	<u>1,420,109</u>	<u>0.34</u>

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
イギリス				
普通株式				
2,419,821	TESCO PLC	7,260,437	6,636,659	1.56
248,954	ANGLO AMER PLC	5,176,439	6,034,052	1.42
2,545,868	WM MORRISON SUPERMARKETS PLC	7,034,951	5,592,412	1.33
785,197	PEARSON PLC	7,425,699	5,554,822	1.32
9,061,744	CENTRICA PLC	21,918,344	4,679,091	1.11
2,511,057	NATWEST GROUP PL	7,798,267	3,408,042	0.81
184,010	IMPERIAL BRANDS PLC	3,281,039	3,253,236	0.77
810,336	HSBC HOLDINGS PL	5,414,169	3,162,833	0.75
544,360	STANDARD CHARTERED PLC	5,470,142	2,495,500	0.59
1,851,282	BARCLAYS PLC	3,317,688	2,355,520	0.56
6,165,653	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,349,833	2,100,720	0.50
61,252	BAE SYSTEMS - ADR	1,648,346	1,542,944	0.37
63,907	BP PLC- ADR	2,687,926	1,132,432	0.27
383,354	BP PLC	2,305,183	1,127,548	0.27
28,950	BRIT AMER TO- ADR	1,157,449	1,043,358	0.25
		86,245,912	50,119,169	11.88
	合計：イギリス	86,245,912	50,119,169	11.88
アメリカ				
普通株式				
43,760	MICROSOFT CORP*	6,912,939	9,118,270	2.15
52,004	APPLE INC*	1,476,953	6,019,982	1.42
13,020	FACEBOOK INC A*	2,729,343	3,431,811	0.80
71,828	COMCAST CORP A*	2,338,507	3,346,467	0.79
52,742	VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,609,824	3,122,326	0.74
130,647	WELLS FARGO & CO	5,611,746	3,072,817	0.73
2,040	ALPHABET INC A	2,938,599	3,009,000	0.71
42,622	COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP A*	2,669,252	2,969,475	0.70
94,698	GENERAL MOTORS CO	3,088,253	2,769,917	0.66
30,395	DOLLAR TREE INC	2,697,592	2,760,778	0.65
52,710	COCA-COLA	2,548,837	2,601,766	0.62
60,015	CITIGROUP INC	3,144,469	2,582,445	0.61
85,756	CORTEVA INC	2,387,989	2,487,782	0.59
87,373	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,410,144	2,421,980	0.57
58,170	ALTRIA GROUP INC	2,557,937	2,249,434	0.53
53,137	CISCO SYSTEMS INC	1,409,088	2,093,066	0.50
102,786	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC	2,599,400	1,926,210	0.46
11,529	CIGNA CORP	1,997,887	1,924,651	0.46
7,737	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,833,509	1,870,342	0.44

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
6,890	ANTHEM INC	1,609,763	1,837,425	0.44
37,750	CDK GLOBAL INC	1,822,068	1,667,418	0.40
1,090	ALPHABET INC C	1,572,006	1,613,331	0.38
32,109	E*TRADE FINANCIAL CORP	1,451,264	1,594,854	0.38
17,740	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,466,298	1,535,752	0.36
33,070	DENTSPLY SIRONA INC	1,359,101	1,428,293	0.34
26,842	QUANTA SERVICES	1,001,770	1,420,479	0.34
42,906	CONOCOPHILLIPS	1,984,447	1,414,611	0.34
15,120	ROSS STORES INC	1,454,061	1,409,486	0.33
7,500	LABORATORY CP	942,599	1,404,900	0.33
44,621	MARATHON PETROLEUM CORP	1,595,474	1,339,522	0.32
48,330	PPL CORPORATION	1,291,316	1,309,260	0.31
41,880	FIDELITY NATIONA	1,415,404	1,305,818	0.31
70,055	EQUITABLE HOLDIN	1,270,307	1,296,018	0.31
62,665	WILLIAMS COS INC	1,749,190	1,276,486	0.30
44,540	FOX CORP - A	1,084,340	1,264,045	0.30
43,622	ELANCO ANIMAL HE	1,067,092	1,242,355	0.29
5,720	BERKSHIRE HATH-B	1,018,750	1,210,409	0.29
69,610	NEWELL BRANDS IN	1,393,547	1,204,949	0.29
11,380	ARTHUR J GALLAGHER & CO	975,538	1,190,917	0.28
47,080	ALLY FINANCIAL INC	1,040,046	1,190,182	0.28
4,140	BIOGEN INC	1,250,277	1,172,552	0.28
32,329	EXELON CORP	1,084,370	1,155,762	0.27
15,408	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,213,171	1,119,083	0.27
29,273	METLIFE INC	1,325,982	1,078,125	0.26
17,880	APPLIED MATERIALS INC	1,046,322	1,062,608	0.25
6,035	LOWE'S COMPANIES INC	471,492	993,542	0.24
6,630	MCKESSON CORP	1,035,904	975,339	0.23
17,240	ROBERT HALF INTL INC	738,598	923,202	0.22
12,720	RALPH LAUREN COR	848,228	868,776	0.21
32,220	BANK OF AMERICA CORP	725,836	773,280	0.18
119,660	GENERAL ELECTRIC	931,608	747,875	0.18
5,366	HUBBELL INC	597,270	738,952	0.18
15,400	MICRON TECHNOLOGY INC	626,935	734,734	0.17
12,590	TJX COMPANIES INC	713,502	697,738	0.17
40,305	RESMED INC CDI	711,672	685,335	0.16
10,950	PUBLIC SERV ENTERPRISE GROUP	566,427	602,469	0.14
11,500	EDISON INTERNATIONAL	646,726	589,605	0.14
10,070	CVS HEALTH CORPORATION	641,566	586,426	0.14
8,430	HOWARD HUGHES CORP	730,222	490,120	0.12
7	REGIONS FINANCIAL CORP	75	81	0.00
		99,432,832	104,930,633	24.86
	合計：アメリカ	99,432,832	104,930,633	24.86
	組入資産合計	450,387,545	397,152,218	94.11

* 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

2020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

2020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	39,807	JPY	4,185,000	2020年10月13日	181
USD	36,050	JPY	3,800,000	2020年10月13日	69
USD	36,055	JPY	3,800,000	2020年10月26日	68
USD	28,602	JPY	3,015,000	2020年10月13日	54
USD	28,606	JPY	3,015,000	2020年10月26日	54
USD	39,350	JPY	4,160,000	2020年10月13日	(40)
USD	14,772	JPY	1,570,260	2020年10月13日	(96)
USD	28,307	JPY	3,008,940	2020年10月13日	(183)
USD	67,219	JPY	7,144,950	2020年10月13日	(435)
INR	1,565,000,000	USD	20,784,912	2020年10月23日	397,074
ZAR	201,000,000	USD	11,435,623	2020年10月23日	383,715
INR	1,211,500,000	USD	16,077,127	2020年10月9日	342,406
ZAR	188,000,000	USD	10,804,555	2020年10月9日	269,983
IDR	284,400,000,000	USD	18,962,528	2020年10月23日	108,723
USD	4,413,490	ZAR	74,000,000	2020年10月9日	54,364
ZAR	31,000,000	USD	1,776,836	2020年10月9日	49,284
IDR	285,000,000,000	USD	18,989,112	2020年12月4日	43,255
MXN	400,000,000	USD	17,779,595	2020年10月16日	39,431
USD	5,035,383	INR	370,000,000	2020年10月23日	27,502
INR	80,000,000	USD	1,061,852	2020年10月9日	22,392
INR	1,291,500,000	USD	17,386,914	2020年12月4日	14,157
USD	2,957,215	ZAR	50,000,000	2020年10月9日	11,859
INR	1,388,250,000	USD	18,723,447	2020年11月20日	10,402
USD	5,602,141	ZAR	95,000,000	2020年10月9日	5,965
INR	150,000,000	USD	2,031,006	2020年11月6日	(3,708)
ZAR	16,000,000	USD	945,303	2020年11月6日	(6,081)
ZAR	95,000,000	USD	5,564,938	2020年12月4日	(7,023)
USD	17,490,520	INR	1,291,500,000	2020年10月9日	(13,258)
IDR	36,000,000,000	USD	2,424,405	2020年11月6日	(13,839)
IDR	242,400,000,000	USD	16,229,788	2020年11月20日	(19,550)
USD	19,112,765	IDR	285,000,000,000	2020年10月9日	(23,101)
MXN	300,000,000	USD	13,346,145	2020年11月13日	(26,152)
IDR	292,400,000,000	USD	19,657,671	2020年11月6日	(78,510)

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	1,398,250,000	USD	19,004,804	2020年11月6日	(107,005)
BRL	62,500,000	USD	11,213,477	2020年11月16日	(129,821)
ZAR	233,500,000	USD	13,888,817	2020年11月6日	(182,035)
IDR	285,000,000,000	USD	19,381,294	2020年10月9日	(245,428)
BRL	76,200,000	USD	13,852,278	2020年10月30日	(329,709)
ZAR	193,500,000	USD	11,709,843	2020年11月20日	(369,868)
MXN	490,000,000	USD	22,198,463	2020年10月30日	(407,941)
BRL	74,200,000	USD	13,730,061	2020年10月16日	(559,287)
BRL	76,500,000	USD	14,480,682	2020年11月20日	(916,480)
MXN	450,000,000	USD	20,966,216	2020年11月20日	(1,002,344)
JPY	1,440,227,899	USD	13,563,415	2020年10月13日	73,870
JPY	1,695,000	USD	15,946	2020年10月13日	103
JPY	2,755,000	USD	25,994	2020年10月13日	92
JPY	1,490,000	USD	14,058	2020年10月13日	50
JPY	530,000	USD	4,998	2020年10月13日	20
JPY	460,000	USD	4,340	2020年10月13日	15
JPY	445,000	USD	4,209	2020年10月13日	4
JPY	470,000	USD	4,488	2020年10月13日	(38)
JPY	470,000	USD	4,489	2020年10月26日	(39)
JPY	1,458,362,817	USD	13,931,386	2020年10月26日	(120,356)
USD	53,895,451	EUR	45,407,160	2020年10月21日	599,913
USD	53,402,630	GBP	41,222,467	2020年10月21日	566,102
USD	1,910,307	TRY	13,678,744	2020年10月21日	166,821
USD	4,978,723	NOK	46,173,703	2020年10月21日	95,732
USD	2,274,556	THB	71,500,000	2020年10月16日	17,646
USD	238,948	NOK	2,127,033	2020年10月21日	14,009
USD	319,875	CHF	290,491	2020年10月21日	4,517
USD	159,006	TRY	1,213,696	2020年10月21日	4,310
PLN	1,209,175	USD	309,717	2020年10月21日	3,499
TWD	13,000,000	USD	445,663	2020年10月23日	2,832
CHF	277,766	USD	299,948	2020年10月21日	1,595
KRW	200,000,000	USD	170,502	2020年10月23日	507
SGD	150,000	USD	109,063	2020年10月16日	483
USD	388,595	CHF	357,902	2020年10月21日	55
HKD	5,000,000	USD	645,084	2020年10月16日	9
THB	2,500,000	USD	78,904	2020年10月16日	9
USD	504,945	PLN	1,951,887	2020年10月21日	(657)
JPY	80,000,000	USD	759,708	2020年10月16日	(2,175)
USD	754,873	JPY	80,000,000	2020年10月16日	(2,660)
USD	21,543,458	HKD	167,000,000	2020年10月16日	(2,665)
USD	2,697,501	EUR	2,300,545	2020年10月21日	(2,707)

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)
NOK	2,026,140	USD	217,147	2020年10月21日	(2,877)
USD	253,442	KRW	300,000,000	2020年10月23日	(3,072)
USD	553,462	PLN	2,148,717	2020年10月21日	(3,126)
USD	4,670,718	SGD	6,400,000	2020年10月16日	(3,265)
EUR	3,018,039	USD	3,545,631	2020年10月21日	(3,282)
PLN	1,401,197	USD	367,683	2020年10月21日	(4,727)
DKK	1,747,614	USD	280,843	2020年10月21日	(5,402)
TRY	1,389,363	USD	182,509	2020年10月21日	(5,422)
TRY	1,361,837	USD	179,543	2020年10月21日	(5,964)
PLN	974,880	USD	260,490	2020年10月21日	(7,964)
PLN	1,074,951	USD	286,592	2020年10月21日	(8,145)
USD	371,648	DKK	2,416,398	2020年10月21日	(9,200)
CHF	647,411	USD	714,583	2020年10月21日	(11,752)
PLN	1,895,155	USD	503,004	2020年10月21日	(12,097)
TRY	1,345,730	USD	183,848	2020年10月21日	(12,323)
PLN	1,722,079	USD	463,385	2020年10月21日	(17,311)
NOK	2,179,756	USD	249,294	2020年10月21日	(18,779)
NOK	4,156,637	USD	458,930	2020年10月21日	(19,355)
USD	17,189,970	JPY	1,820,000,000	2020年10月23日	(45,267)
USD	4,505,548	PLN	17,634,694	2020年10月21日	(62,419)
USD	17,136,729	JPY	1,820,000,000	2020年10月16日	(97,157)
USD	6,139,458	KRW	7,300,000,000	2020年10月23日	(102,401)
USD	6,546,697	CHF	6,133,979	2020年10月21日	(112,370)
USD	13,609,163	TWD	398,000,000	2020年10月23日	(121,691)
USD	13,798,652	AUD	19,575,000	2020年10月30日	(134,733)
USD	13,798,104	AUD	19,575,000	2020年10月30日	(135,281)
USD	13,797,012	AUD	19,575,000	2020年10月30日	(136,374)
USD	13,796,557	AUD	19,575,000	2020年10月30日	(136,828)
					(2,478,644)

注記2-オプション契約

2020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>買い持ちポジション</i>						
AUD	318	P AS51 5750 19/11/20	2020年11月19日	312,895	422,344	109,449
				312,895	422,344	109,449
<i>売り持ちポジション</i>						
AUD	(32,493)	C AMC AT 16.2963 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(3,923)	0	3,923
AUD	(21,290)	C A2M AT 21.0243 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(10,663)	0	10,663
AUD	(21,197)	C A2M AT 21.2738 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(9,941)	0	9,941
AUD	(19,428)	C BHP AT 38.4854 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(9,759)	0	9,759
AUD	(277,684)	C BPT AT 1.6254 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(9,829)	0	9,829
AUD	(34,361)	C BSL AT 12.8882 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(7,358)	0	7,358
AUD	(39,167)	C BXB AT 11.2701 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(5,154)	0	5,154
USD	(22,000)	C DANOU UV 13.483 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(5,795)	0	5,795
AUD	(6,423)	C MFG AT 63.7249 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(9,805)	0	9,805
AUD	(143,631)	C MGR AT 2.3342 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(5,126)	0	5,126
AUD	(27,117)	C NAB AT 19.3862 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(6,025)	0	6,025
AUD	(27,167)	C NST AT 18.3653 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(7,821)	0	7,821
AUD	(30,328)	C OZL AT 14.8307 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(8,098)	0	8,098
AUD	(5,732)	C RIO AT 109.174 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(6,951)	0	6,951
AUD	(11,581)	C RMD AT 30.8026 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(3,897)	0	3,897
AUD	(65,623)	C SAR AT 7.1134 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(8,757)	0	8,757
JPY	(11,000)	C 1925 JT 2973.075 01/10/20 OTC	2020年10月1日	(119)	0	119
JPY	(13,500)	C 5706 JT 2774.6136 01/10/20 OTC	2020年10月1日	(67)	0	67
GBP	(57,212)	C AAL LN 20.43801 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(9,711)	(9,731)	(20)
GBP	(45,666)	C AAL LN 21.01671 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(19,327)	(17,012)	2,315
GBP	(70,736)	C AAL LN 21.28054 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(33,079)	(38,993)	(5,914)
GBP	(57,619)	C AAL LN 21.75739 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(23,676)	(3,412)	20,264
USD	(35)	C AAPL UW 120 30/10/20	2020年10月30日	(11,279)	(14,770)	(3,491)
USD	(92)	C AAPL UW 121 23/10/20	2020年10月23日	(34,728)	(26,036)	8,692
USD	(46)	C AAPL UW 132.5 09/10/20	2020年10月9日	(37,975)	(368)	37,607
EUR	(8,284)	C AGS BB 35.6554 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,594)	(9,723)	(3,129)
EUR	(5,935)	C AGS BB 36.7186 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(4,095)	(3,637)	458
EUR	(7,531)	C AGS BB 39.831 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2,266)	(1,133)	1,133
EUR	(8,099)	C AGS BB 40.5179 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(6,748)	(1,933)	4,815
USD	(132)	C AIG UN 30 20/11/20	2020年11月20日	(20,956)	(13,464)	7,492
USD	(39)	C AIG UN 31 09/10/20	2020年10月9日	(2,799)	(117)	2,682
USD	(132)	C AIG UN 31 23/10/20	2020年10月23日	(9,407)	(2,904)	6,503

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	(76)	C AIG UN 32 02/10/20	2020年10月2日	(6,290)	(304)	5,986
USD	(30)	C AIG UN 32 16/10/20	2020年10月16日	(2,453)	(180)	2,273
USD	(3)	C AIG UN 34 16/10/20	2020年10月16日	(319)	(6)	313
USD	(33)	C AJG UN 105 16/10/20	2020年10月16日	(7,912)	(8,250)	(338)
USD	(20)	C AJG UN 110 20/11/20	2020年11月20日	(5,555)	(3,880)	1,675
EUR	(7,876)	C AKE FP 100.1528 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(15,779)	(9,964)	5,815
EUR	(9,283)	C AKE FP 104.7744 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(20,439)	(8,946)	11,493
EUR	(2,119)	C AKE FP 98.5505 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(4,440)	(5,689)	(1,249)
EUR	(8,631)	C AKE FP 98.7326 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(6,691)	(3,454)	3,237
AUD	(16,451)	C ALL AT 28.1736 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(9,176)	(24,726)	(15,550)
AUD	(17,020)	C ALL AT 30.6007 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(10,537)	(14,373)	(3,836)
AUD	(14,303)	C ALL AT 30.7238 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(7,544)	(8,787)	(1,243)
AUD	(10,658)	C ALL AT 31.3604 17/11/20 OTC	2020年11月17日	(5,367)	(7,263)	(1,896)
USD	(222)	C ALLY UN 27 16/10/20	2020年10月16日	(13,489)	(10,878)	2,611
EUR	(4,228)	C ALV GY 181.988 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(5,929)	(2,071)	3,858
EUR	(6,246)	C ALV GY 182.7134 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(20,062)	(21,206)	(1,144)
EUR	(4,837)	C ALV GY 197.288 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(19,001)	(2,547)	16,454
EUR	(5,982)	C ALV GY 197.5048 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(21,024)	(722)	20,302
USD	(80)	C AMAT UW 60 06/11/20	2020年11月6日	(17,926)	(24,400)	(6,474)
AUD	(27,816)	C AMC AT 15.6958 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(4,874)	(2,640)	2,234
AUD	(16,651)	C AMC AT 15.9989 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(2,331)	(1,216)	1,115
AUD	(25,183)	C AMC AT 16.4085 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(3,849)	(2,576)	1,273
AUD	(25,548)	C AMC AT 16.4141 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(4,556)	(2,114)	2,442
USD	(4)	C ANTM UN 267.5 30/10/20	2020年10月30日	(2,416)	(2,840)	(424)
USD	(4)	C ANTM UN 280 23/10/20	2020年10月23日	(2,519)	(740)	1,779
USD	(17)	C ANTM UN 282.5 09/10/20	2020年10月9日	(12,328)	(425)	11,903
USD	(7)	C ANTM UN 287.5 02/10/20	2020年10月2日	(3,535)	(1,750)	1,785
USD	(146)	C AXTA UN 26 20/11/20	2020年11月20日	(13,689)	(5,840)	7,849
AUD	(38,600)	C A2M AT 15.5049 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,966)	(7,095)	(129)
AUD	(27,799)	C A2M AT 17.9432 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(7,641)	(378)	7,263
AUD	(26,048)	C A2M AT 19.8661 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(9,874)	(72)	9,802
AUD	(21,898)	C A2M AT 20.0924 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(7,476)	(28)	7,448
AUD	(22,171)	C A2M AT 20.4671 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(3,971)	(9)	3,962
AUD	(21,410)	C A2M AT 20.9437 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(11,870)	(2)	11,868
USD	(63)	C BAC UN 26.5 09/10/20	2020年10月9日	(6,411)	(189)	6,222
USD	(38)	C BAC UN 26.5 23/10/20	2020年10月23日	(2,765)	(722)	2,043
USD	(51)	C BAC UN 27 16/10/20	2020年10月16日	(5,918)	(408)	5,510
USD	(5,600)	C BAESY UV 27.5 20/10/20 OTC	2020年10月20日	(4,473)	(415)	4,058
USD	(4,900)	C BAESY UV 27.6658 27/10/20 OTC	2020年10月27日	(2,354)	(569)	1,785
AUD	(54,017)	C BAP AT 6.3553 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(7,685)	(20,686)	(13,001)
AUD	(70,475)	C BAP AT 6.401 30/09/20 OTC	2020年9月30日	(7,056)	(19,512)	(12,456)

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	(265,906)	C BARC LN 1.11379 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(1,413)	(4,192)	(2,779)
GBP	(292,496)	C BARC LN 1.1452 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,304)	(12,610)	(6,306)
GBP	(285,983)	C BARC LN 1.23883 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(6,603)	(5,340)	1,263
GBP	(242,652)	C BARC LN 1.23903 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(5,857)	(3,097)	2,760
GBP	(255,535)	C BARC LN 1.33821 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(6,636)	(1,117)	5,519
USD	(42,500)	C BAYRY UV 16.435 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(19,754)	(8,625)	11,129
USD	(31,400)	C BBD UN 3.454 16/10/20 OTC	2020年10月16日	(4,189)	(4,068)	121
USD	(34,500)	C BBD UN 3.811 16/10/20 OTC	2020年10月16日	(5,727)	(1,177)	4,550
AUD	(16,513)	C BHP AT 38.7027 16/12/20 OTC	2020年12月16日	(7,577)	(7,320)	257
AUD	(17,935)	C BHP AT 39.1165 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(11,182)	(310)	10,872
AUD	(13,083)	C BHP AT 39.5024 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(7,485)	(838)	6,647
AUD	(13,941)	C BHP AT 39.8395 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,958)	(4,322)	2,636
AUD	(16,726)	C BHP AT 39.9547 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(8,160)	(2,316)	5,844
AUD	(14,536)	C BHP AT 40.04 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,922)	(2,412)	4,510
AUD	(16,682)	C BHP AT 40.2328 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(9,093)	(3,533)	5,560
AUD	(12,498)	C BHP AT 40.2969 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(6,455)	(1,073)	5,382
AUD	(6,565)	C BHP AT 40.8065 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(2,669)	(64)	2,605
AUD	(16,123)	C BHP AT 40.8237 16/12/20 OTC	2020年12月16日	(8,567)	(3,079)	5,488
AUD	(15,556)	C BHP AT 40.9225 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(6,845)	(1,279)	5,566
USD	(7)	C BIIB UW 285 16/10/20	2020年10月16日	(5,042)	(4,550)	492
USD	(12)	C BIIB UW 287.5 02/10/20	2020年10月2日	(8,239)	(1,548)	6,691
EUR	(12,474)	C BNP FP 36.957 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(3,356)	(1,389)	1,967
EUR	(13,722)	C BNP FP 37.0865 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(8,957)	(11,505)	(2,548)
EUR	(11,383)	C BNP FP 41.7989 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(8,865)	(1,284)	7,581
EUR	(11,987)	C BNP FP 42.9338 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(9,811)	(173)	9,638
GBP	(55,062)	C BP/ LN 2.71363 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(756)	(320)	436
GBP	(60,568)	C BP/ LN 2.80189 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(2,796)	(2,193)	603
GBP	(59,219)	C BP/ LN 3.02406 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(2,985)	(809)	2,176
GBP	(50,246)	C BP/ LN 3.02954 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(2,453)	(368)	2,085
GBP	(52,914)	C BP/ LN 3.38105 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(3,314)	(21)	3,293
USD	(43)	C BP UN 21 20/11/20	2020年11月20日	(3,405)	(860)	2,545
USD	(97)	C BP UN 21 23/10/20	2020年10月23日	(6,670)	(388)	6,282
USD	(65)	C BP UN 21 30/10/20	2020年10月30日	(3,704)	(520)	3,184
USD	(48)	C BP UN 22.04 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(3,733)	(5)	3,728
USD	(32)	C BP UN 23.5 02/10/20	2020年10月2日	(1,880)	(64)	1,816
USD	(16)	C BP UN 25 16/10/20	2020年10月16日	(926)	(32)	894
AUD	(284,425)	C BPT AT 1.4924 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(8,035)	(6,298)	1,737
USD	(27)	C BRKB UN 220 23/10/20	2020年10月23日	(14,715)	(4,914)	9,801
AUD	(20,924)	C BSL AT 12.8487 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(5,504)	(4,745)	759
AUD	(32,761)	C BSL AT 13.3726 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(8,466)	(6,158)	2,308
AUD	(29,266)	C BSL AT 14.3463 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(7,506)	(3,433)	4,073

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	(136)	C BTI UN 35 16/10/20	2020年10月16日	(10,257)	(13,736)	(3,479)
AUD	(36,306)	C BXB AT 11.5383 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(3,527)	(746)	2,781
AUD	(38,671)	C BXB AT 11.6198 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(4,479)	(124)	4,355
AUD	(36,715)	C BXB AT 11.7447 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(5,103)	(1,357)	3,746
AUD	(35,534)	C BXB AT 11.8244 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(3,894)	(731)	3,163
USD	(9)	C C UN 44 06/11/20	2020年11月6日	(1,348)	(1,467)	(119)
USD	(35)	C C UN 45 20/11/20	2020年11月20日	(5,697)	(6,580)	(883)
USD	(20)	C C UN 47.5 20/11/20	2020年11月20日	(3,075)	(2,400)	675
USD	(73)	C C UN 50 30/10/20	2020年10月30日	(7,872)	(2,117)	5,755
USD	(79)	C C UN 54 09/10/20	2020年10月9日	(13,253)	(395)	12,858
USD	(21)	C C UN 54 23/10/20	2020年10月23日	(3,779)	(273)	3,506
USD	(33)	C C UN 55 16/10/20	2020年10月16日	(3,985)	(33)	3,952
AUD	(8,270)	C CBA AT 69.0195 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,209)	(3,902)	2,307
AUD	(8,108)	C CBA AT 71.281 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(7,031)	(2,695)	4,336
AUD	(8,976)	C CBA AT 73.0445 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(6,473)	(1,114)	5,359
AUD	(9,246)	C CBA AT 73.9001 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(4,281)	(96)	4,185
AUD	(9,338)	C CBA AT 74.5189 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(4,665)	(199)	4,466
AUD	(7,974)	C CBA AT 74.7047 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(7,773)	(846)	6,927
AUD	(92)	C CBA AT 76.19/11/20	2020年11月19日	(8,525)	(360)	8,165
AUD	(8,850)	C CBA AT 76.7912 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(8,363)	(285)	8,078
AUD	(5,603)	C CBA AT 77.66 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(4,858)	(2)	4,856
AUD	(8,896)	C CBA AT 78.7568 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(10,477)	(52)	10,425
USD	(88)	C CDK UW 45 20/11/20	2020年11月20日	(17,417)	(17,600)	(183)
USD	(89)	C CDK UW 50 16/10/20	2020年10月16日	(7,010)	(890)	6,120
AUD	(31,907)	C CHC AT 13.218 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(4,867)	(7,392)	(2,525)
AUD	(32,868)	C CHC AT 13.3525 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(5,000)	(3,114)	1,886
USD	(19)	C CI UN 167.5 30/10/20	2020年10月30日	(8,020)	(9,690)	(1,670)
USD	(10)	C CI UN 172.5 23/10/20	2020年10月23日	(5,223)	(4,750)	473
USD	(24)	C CI UN 195 16/10/20	2020年10月16日	(11,509)	(288)	11,221
USD	(86)	C CMCSA UW 44.5 02/10/20	2020年10月2日	(8,236)	(18,060)	(9,824)
USD	(86)	C CMCSA UW 45 16/10/20	2020年10月16日	(7,720)	(14,620)	(6,900)
USD	(51)	C CMCSA UW 46 23/10/20	2020年10月23日	(5,185)	(7,752)	(2,567)
USD	(115)	C CMCSA UW 47.5 30/10/20	2020年10月30日	(13,198)	(12,075)	1,123
GBP	(1,301,569)	C CNA LN 0.44172 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(4,553)	(8,441)	(3,888)
GBP	(1,431,726)	C CNA LN 0.51144 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(13,512)	(19,487)	(5,975)
GBP	(1,187,750)	C CNA LN 0.56339 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(13,061)	(4,947)	8,114
GBP	(1,250,812)	C CNA LN 0.57134 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(12,419)	(1,298)	11,121
USD	(72)	C COF UN 72.5 16/10/20	2020年10月16日	(21,498)	(21,600)	(102)
EUR	(6,372)	C CON GY 101.8435 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(12,053)	(6,162)	5,891
EUR	(6,051)	C CON GY 103.5768 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(10,985)	(12,378)	(1,393)
EUR	(7,293)	C CON GY 105.1555 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(15,122)	(22,708)	(7,586)

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	(6, 630)	C CON GY 95.4908 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(4, 659)	(16, 819)	(12, 160)
USD	(14)	C COP UN 36 20/11/20	2020年11月20日	(1, 999)	(1, 610)	389
USD	(83)	C COP UN 36.5 23/10/20	2020年10月23日	(9, 736)	(2, 241)	7, 495
USD	(21)	C COP UN 39 09/10/20	2020年10月9日	(2, 144)	(210)	1, 934
USD	(42)	C COP UN 41 16/10/20	2020年10月16日	(4, 778)	(210)	4, 568
USD	(42)	C COP UN 43 02/10/20	2020年10月2日	(4, 946)	(42)	4, 904
USD	(25)	C CSCO UW 40.5 30/10/20	2020年10月30日	(1, 719)	(1, 275)	444
USD	(8)	C CSCO UW 41.5 23/10/20	2020年10月23日	(846)	(136)	710
USD	(7)	C CSCO UW 42 20/11/20	2020年11月20日	(962)	(567)	395
USD	(100)	C CSCO UW 43 09/10/20	2020年10月9日	(7, 128)	(200)	6, 928
USD	(55)	C CSCO UW 44 16/10/20	2020年10月16日	(3, 397)	(165)	3, 232
AUD	(2, 111)	C CSL AT 297.8151 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(9, 347)	(4, 402)	4, 945
AUD	(2, 368)	C CSL AT 301.9091 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(11, 230)	(1, 910)	9, 320
AUD	(2, 270)	C CSL AT 302.1127 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(9, 287)	(4, 365)	4, 922
AUD	(2, 151)	C CSL AT 305.9586 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(9, 439)	(8, 397)	1, 042
AUD	(2, 135)	C CSL AT 305.9614 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(5, 371)	(4, 871)	500
AUD	(2, 194)	C CSL AT 306.2908 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(8, 032)	(5, 838)	2, 194
AUD	(2, 121)	C CSL AT 307.4281 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(8, 290)	(6, 089)	2, 201
AUD	(1, 852)	C CSL AT 314.4544 16/12/20 OTC	2020年12月16日	(8, 288)	(5, 152)	3, 136
AUD	(2, 150)	C CSL AT 316.8866 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(8, 037)	(2, 200)	5, 837
USD	(60)	C CTSH UW 67.5 09/10/20	2020年10月9日	(9, 904)	(9, 300)	604
USD	(52)	C CTSH UW 69 02/10/20	2020年10月2日	(8, 724)	(4, 420)	4, 304
USD	(23)	C CTSH UW 70 16/10/20	2020年10月16日	(4, 134)	(3, 450)	684
USD	(36)	C CTSH UW 70 20/11/20	2020年11月20日	(8, 199)	(13, 140)	(4, 941)
USD	(30)	C CTSH UW 72 23/10/20	2020年10月23日	(3, 858)	(3, 000)	858
USD	(129)	C CTVA UN 30 16/10/20	2020年10月16日	(12, 095)	(4, 515)	7, 580
USD	(25)	C CTVA UN 30.5 28/10/20 FLEX	2020年10月28日	(2, 044)	(1, 621)	423
USD	(25)	C CTVA UN 32 20/11/20	2020年11月20日	(2, 344)	(1, 500)	844
USD	(22)	C CVS UN 59 06/11/20	2020年11月6日	(3, 758)	(3, 806)	(48)
USD	(23)	C CVS UN 60 30/10/20	2020年10月30日	(2, 780)	(2, 116)	664
USD	(65)	C DLTR UW 105 02/10/20	2020年10月2日	(20, 803)	(260)	20, 543
USD	(32)	C DLTR UW 95 23/10/20	2020年10月23日	(10, 871)	(3, 744)	7, 127
USD	(46)	C DLTR UW 98.5 02/10/20	2020年10月2日	(10, 759)	(782)	9, 977
AUD	(4, 682)	C DMP AT 90.6697 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(6, 767)	(504)	6, 263
NOK	(90, 632)	C DNB NO 133.9979 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(22, 380)	(42, 421)	(20, 041)
NOK	(82, 602)	C DNB NO 135.83 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(8, 206)	(8, 089)	117
NOK	(40, 119)	C DNB NO 150.2001 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(11, 063)	(1, 740)	9, 323
NOK	(88, 078)	C DNB NO 156.4935 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(24, 817)	(481)	24, 336
USD	(32, 200)	C EADS UN 20.884 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(25, 464)	(6, 338)	19, 126
USD	(36)	C EIX UN 55 16/10/20	2020年10月16日	(4, 030)	(1, 152)	2, 878
USD	(18)	C EIX UN 55.5 20/11/20 FLEX	2020年11月20日	(2, 858)	(2, 423)	435

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	(194)	C ELAN UN 29 16/10/20	2020年10月16日	(15,280)	(15,520)	(240)
EUR	(89,376)	C ENI IM 7.6453 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(4,052)	(2,097)	1,955
EUR	(98,314)	C ENI IM 7.9243 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(11,892)	(12,947)	(1,055)
EUR	(96,125)	C ENI IM 8.4729 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(12,969)	(4,935)	8,034
EUR	(81,560)	C ENI IM 8.5824 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(11,785)	(1,954)	9,831
EUR	(85,890)	C ENI IM 9.3038 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(14,007)	(130)	13,877
USD	(264)	C EQH UN 20 20/11/20	2020年11月20日	(27,874)	(21,120)	6,754
USD	(66)	C EQH UN 22.5 16/10/20	2020年10月16日	(4,142)	(990)	3,152
USD	(169)	C EQNR UN 16.37 16/10/20 FLEX	2020年10月16日	(7,396)	(676)	6,720
USD	(107)	C ETFC UW 54.5 02/10/20	2020年10月2日	(16,957)	(17,120)	(163)
USD	(107)	C ETFC UW 55.5 09/10/20	2020年10月9日	(15,319)	(3,210)	12,109
USD	(4,100)	C EXC UW 38 06/11/20 OTC	2020年11月6日	(3,609)	(2,177)	1,432
USD	(165)	C EXC UW 38 16/10/20	2020年10月16日	(15,512)	(2,475)	13,037
USD	(10)	C FB UW 260 16/10/20	2020年10月16日	(12,105)	(10,250)	1,855
USD	(16)	C FB UW 267.5 30/10/20	2020年10月30日	(13,128)	(18,384)	(5,256)
USD	(32)	C FB UW 270 06/11/20	2020年11月6日	(31,272)	(41,439)	(10,167)
USD	(513)	C FLEX UW 11.5 02/10/20 FLEX	2020年10月2日	(12,959)	(571)	12,388
USD	(8)	C FLT UN 260 16/10/20	2020年10月16日	(3,596)	(1,216)	2,380
AUD	(22,426)	C FMG AT 17.8338 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(5,106)	(5,425)	(319)
AUD	(26,110)	C FMG AT 19.5121 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(10,862)	(2,717)	8,145
AUD	(26,249)	C FMG AT 19.5258 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(8,258)	(1,794)	6,464
AUD	(20,682)	C FMG AT 19.6577 10/11/20 OTC	2020年11月10日	(5,878)	(613)	5,265
USD	(96)	C FNF UN 35 16/10/20	2020年10月16日	(5,989)	(960)	5,029
USD	(101)	C FNF UN 35 20/11/20	2020年11月20日	(11,894)	(6,060)	5,834
USD	(61)	C FOXA UW 27.5 30/10/20	2020年10月30日	(4,820)	(10,004)	(5,184)
USD	(70)	C FOXA UW 29 02/10/20	2020年10月2日	(4,393)	(350)	4,043
USD	(70)	C FOXA UW 30 23/10/20	2020年10月23日	(5,653)	(2,100)	3,553
USD	(114)	C GE UN 6.5 06/11/20	2020年11月6日	(3,511)	(3,990)	(479)
USD	(192)	C GE UN 6.5 23/10/20	2020年10月23日	(4,179)	(4,032)	147
USD	(117)	C GE UN 7 16/10/20	2020年10月16日	(2,897)	(585)	2,312
USD	(116)	C GE UN 7.5 30/10/20	2020年10月30日	(4,265)	(928)	3,337
USD	(88)	C GIL UN 20 16/10/20	2020年10月16日	(6,513)	(7,480)	(967)
USD	(188)	C GIL UN 20.1 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(23,269)	(14,602)	8,667
USD	(99)	C GIL UN 21.41 16/10/20 FLEX	2020年10月16日	(4,828)	(4,002)	826
USD	(33)	C GM UN 30.5 02/10/20	2020年10月2日	(5,403)	(297)	5,106
USD	(74)	C GM UN 31.29 06/11/20 FLEX	2020年11月6日	(8,714)	(7,016)	1,698
USD	(111)	C GM UN 31.5 02/10/20	2020年10月2日	(14,792)	(444)	14,348
USD	(61)	C GM UN 31.59 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(6,085)	(722)	5,363
USD	(78)	C GM UN 33 16/10/20	2020年10月16日	(6,377)	(1,170)	5,207
USD	(73)	C GM UN 33 23/10/20	2020年10月23日	(13,852)	(1,314)	12,538
USD	(16)	C GM UN 33.5 30/10/20	2020年10月30日	(1,948)	(544)	1,404

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	(17, 430)	C GMG AT 19. 3401 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(3, 852)	(583)	3, 269
AUD	(25, 188)	C GMG AT 19. 5273 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(3, 667)	(2, 430)	1, 237
AUD	(25, 373)	C GMG AT 19. 5373 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(6, 220)	(3, 784)	2, 436
AUD	(21, 680)	C GMG AT 19. 6402 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(5, 306)	(2, 196)	3, 110
AUD	(26, 003)	C GMG AT 19. 6409 30/12/20 OTC	2020年12月30日	(5, 058)	(4, 625)	433
USD	(4)	C GOOGL UW 1510 23/10/20	2020年10月23日	(10, 932)	(10, 876)	56
USD	(2)	C GOOGL UW 1525 20/11/20	2020年11月20日	(9, 355)	(12, 080)	(2, 725)
USD	(3)	C GOOGL UW 1535 23/10/20	2020年10月23日	(12, 787)	(8, 025)	4, 762
USD	(7)	C GOOGL UW 1575 16/10/20	2020年10月16日	(25, 578)	(4, 060)	21, 518
USD	(39)	C HHC UN 65 16/10/20	2020年10月16日	(6, 858)	(1, 950)	4, 908
GBP	(116, 390)	C HSBA LN 3. 22848 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2, 383)	(5, 197)	(2, 814)
GBP	(128, 029)	C HSBA LN 3. 35222 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(7, 168)	(14, 459)	(7, 291)
GBP	(106, 212)	C HSBA LN 3. 59098 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(6, 324)	(3, 248)	3, 076
GBP	(111, 851)	C HSBA LN 4. 02065 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(9, 354)	(132)	9, 222
USD	(21)	C HUBB UN 145 16/10/20	2020年10月16日	(4, 510)	(525)	3, 985
USD	(4)	C HUBB UN 145 20/11/20	2020年11月20日	(920)	(900)	20
GBP	(24, 118)	C IMB LN 13. 84057 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(5, 641)	(20, 101)	(14, 460)
GBP	(26, 429)	C IMB LN 14. 89449 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2, 527)	(3, 499)	(972)
GBP	(28, 425)	C IMB LN 15. 06406 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(7, 916)	(10, 044)	(2, 128)
GBP	(29, 072)	C IMB LN 15. 41044 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(8, 798)	(9, 716)	(918)
EUR	(74, 633)	C INGA NA 7. 0011 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(3, 711)	(4, 019)	(308)
EUR	(82, 097)	C INGA NA 7. 5246 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(9, 595)	(12, 740)	(3, 145)
EUR	(71, 722)	C INGA NA 7. 5542 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(9, 566)	(1, 812)	7, 754
EUR	(68, 107)	C INGA NA 8. 1071 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(10, 004)	(3, 155)	6, 849
EUR	(285, 954)	C ISP IM 1. 7844 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(3, 869)	(1, 885)	1, 984
EUR	(314, 549)	C ISP IM 1. 808 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(8, 989)	(12, 307)	(3, 318)
EUR	(266, 599)	C ISP IM 1. 9624 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(10, 111)	(297)	9, 814
EUR	(260, 948)	C ISP IM 2. 0292 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(8, 730)	(1, 047)	7, 683
USD	(680)	C ITUB UN 4. 5 20/11/20	2020年11月20日	(5, 450)	(6, 800)	(1, 350)
AUD	(11, 520)	C JHX AT 32. 0761 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(6, 435)	(12, 283)	(5, 848)
AUD	(16, 346)	C JHX AT 33. 0945 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(9, 856)	(14, 147)	(4, 291)
AUD	(12, 464)	C JHX AT 34. 0776 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6, 941)	(14, 606)	(7, 665)
AUD	(12, 590)	C JHX AT 34. 2332 30/12/20 OTC	2020年12月30日	(8, 261)	(14, 922)	(6, 661)
AUD	(15, 227)	C JHX AT 34. 5637 04/11/20 OTC	2020年11月4日	(6, 755)	(7, 980)	(1, 225)
USD	(237)	C KO UN 50 30/10/20	2020年10月30日	(24, 591)	(27, 255)	(2, 664)
USD	(18)	C LH UN 190 16/10/20	2020年10月16日	(10, 310)	(5, 490)	4, 820
USD	(17)	C LH UN 195 20/11/20	2020年11月20日	(9, 595)	(10, 880)	(1, 285)
USD	(16, 046)	C LKOD LI 64. 14 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(4, 207)	(3, 851)	356
USD	(6, 619)	C LKOD LI 67. 37 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(5, 999)	(6, 906)	(907)
USD	(13, 798)	C LKOD LI 76. 18 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(15, 730)	(2, 236)	13, 494
USD	(15, 420)	C LKOD LI 78. 38 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(15, 960)	(111)	15, 849

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	(885, 594)	C LLOY LN 0.28081 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(1,262)	(5,051)	(3,789)
GBP	(974, 153)	C LLOY LN 0.30062 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(4,721)	(12,872)	(8,151)
GBP	(808, 150)	C LLOY LN 0.31762 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(4,118)	(4,744)	(626)
GBP	(851, 059)	C LLOY LN 0.35109 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(5,742)	(1,451)	4,291
USD	(2)	C LOW UN 165 06/11/20	2020年11月6日	(786)	(1,200)	(414)
USD	(13)	C LOW UN 170 23/10/20	2020年10月23日	(6,536)	(3,250)	3,286
USD	(13)	C LOW UN 170 30/10/20	2020年10月30日	(7,316)	(3,874)	3,442
USD	(31)	C MCK UN 155 02/10/20	2020年10月2日	(12,330)	(1,085)	11,245
USD	(17)	C MDT UN 110 16/10/20	2020年10月16日	(5,374)	(697)	4,677
USD	(41)	C MET UN 38.5 30/10/20	2020年10月30日	(6,783)	(3,895)	2,888
USD	(16)	C MET UN 40 23/10/20	2020年10月23日	(1,600)	(544)	1,056
USD	(15)	C MET UN 41 02/10/20	2020年10月2日	(1,436)	(45)	1,391
USD	(79)	C MET UN 41 09/10/20	2020年10月9日	(7,486)	(711)	6,775
AUD	(6,439)	C MFG AT 67.3092 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(7,682)	(1,982)	5,700
AUD	(6,479)	C MFG AT 68.4681 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(6,904)	(629)	6,275
AUD	(166,027)	C MGR AT 2.2804 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(6,830)	(4,047)	2,783
AUD	(177,489)	C MGR AT 2.353 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(5,970)	(767)	5,203
USD	(52)	C MO UN 40.5 16/10/20	2020年10月16日	(2,588)	(1,300)	1,288
USD	(52)	C MO UN 40.5 23/10/20	2020年10月23日	(3,108)	(2,288)	820
USD	(52)	C MO UN 40.5 30/10/20	2020年10月30日	(4,200)	(3,640)	560
USD	(48)	C MO UN 44 30/10/20	2020年10月30日	(4,933)	(912)	4,021
USD	(21)	C MO UN 45 16/10/20	2020年10月16日	(1,801)	(42)	1,759
USD	(48)	C MO UN 45 23/10/20	2020年10月23日	(3,973)	(288)	3,685
USD	(111)	C MPC UN 31 06/11/20	2020年11月6日	(15,381)	(18,759)	(3,378)
USD	(37)	C MPC UN 34.5 30/10/20	2020年10月30日	(4,348)	(1,665)	2,683
USD	(11)	C MPC UN 35 23/10/20	2020年10月23日	(858)	(385)	473
USD	(10)	C MPC UN 37.5 09/10/20	2020年10月9日	(1,228)	(80)	1,148
USD	(37)	C MPC UN 40 16/10/20	2020年10月16日	(3,950)	(185)	3,765
AUD	(3,932)	C MQG AT 128.4634 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(5,071)	(4,797)	274
AUD	(4,485)	C MQG AT 129.1881 04/11/20 OTC	2020年11月4日	(4,363)	(2,532)	1,831
AUD	(3,909)	C MQG AT 129.4707 30/12/20 OTC	2020年12月30日	(6,864)	(5,454)	1,410
AUD	(4,442)	C MQG AT 132.3855 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(7,573)	(4,083)	3,490
GBP	(603,357)	C MRW LN 1.87403 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(22,622)	(23,546)	(924)
GBP	(527,116)	C MRW LN 1.93803 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(20,801)	(5,648)	15,153
GBP	(467,171)	C MRW LN 1.95719 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(20,236)	(8,670)	11,566
USD	(26)	C MSFT UW 212.5 09/10/20	2020年10月9日	(12,136)	(5,512)	6,624
USD	(26)	C MSFT UW 212.5 23/10/20	2020年10月23日	(17,361)	(13,390)	3,971
USD	(14)	C MSFT UW 217.5 06/11/20	2020年11月6日	(8,579)	(8,064)	515
USD	(54)	C MSFT UW 220 20/11/20	2020年11月20日	(35,725)	(33,750)	1,975
USD	(45)	C MSFT UW 232.5 09/10/20	2020年10月9日	(52,743)	(450)	52,293
USD	(31)	C MSFT UW 232.5 23/10/20	2020年10月23日	(29,533)	(2,201)	27,332

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	(20)	C MU UW 49 09/10/20	2020年10月9日	(3,361)	(1,440)	1,921
USD	(16)	C MU UW 49.5 23/10/20	2020年10月23日	(3,397)	(2,400)	997
USD	(36)	C MU UW 52.5 20/11/20	2020年11月20日	(9,620)	(5,652)	3,968
USD	(48)	C MYL UW 17 09/10/20	2020年10月9日	(2,823)	(144)	2,679
USD	(48)	C MYL UW 17.5 02/10/20	2020年10月2日	(1,765)	(720)	1,045
AUD	(24,499)	C NAB AT 18.7656 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(4,928)	(3,281)	1,647
AUD	(31,473)	C NAB AT 18.879 04/11/20 OTC	2020年11月4日	(7,393)	(4,807)	2,586
AUD	(366)	C NAB AT 19 15/10/20	2020年10月15日	(6,209)	(1,433)	4,776
AUD	(31,127)	C NAB AT 19.0193 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(7,876)	(7,822)	54
AUD	(35,992)	C NAB AT 19.4156 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(8,445)	(2,382)	6,063
AUD	(15,924)	C NCM AT 34.9403 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(8,979)	(6,139)	2,840
AUD	(12,120)	C NCM AT 36.9859 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(6,416)	(546)	5,870
AUD	(28,566)	C NST AT 15.7896 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(4,659)	(4,911)	(252)
AUD	(29,440)	C NST AT 16.3691 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(7,774)	(465)	7,309
AUD	(26,282)	C NST AT 17.7213 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(10,755)	(8)	10,747
GBP	(396,738)	C NWG LN 1.25023 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(9,310)	(19,301)	(9,991)
GBP	(329,131)	C NWG LN 1.28136 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(7,989)	(7,479)	510
USD	(225)	C NWL UW 17 16/10/20	2020年10月16日	(10,409)	(14,625)	(4,216)
USD	(103)	C NWL UW 19 20/11/20	2020年11月20日	(7,598)	(5,150)	2,448
USD	(28)	C NXPI UW 127 30/10/20	2020年10月30日	(10,696)	(14,280)	(3,584)
USD	(17)	C NXPI UW 130 16/10/20	2020年10月16日	(9,883)	(3,757)	6,126
USD	(18)	C NXPI UW 131 09/10/20	2020年10月9日	(6,844)	(1,764)	5,080
USD	(110,258)	C OGZD LI 5.02 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2,260)	(482)	1,778
USD	(119,302)	C OGZD LI 5.28 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(8,411)	(2,882)	5,529
USD	(136,898)	C OGZD LI 5.61 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(9,528)	(1,793)	7,735
USD	(157,286)	C OGZD LI 5.89 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(12,142)	(61)	12,081
USD	(38)	C OTEX UW 45 20/11/20	2020年11月20日	(3,563)	(3,610)	(47)
USD	(38)	C OTEX 45.85 16/10/20 FLEX	2020年10月16日	(5,539)	(530)	5,009
AUD	(24,226)	C OZL AT 15.242 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(5,320)	(1,242)	4,078
AUD	(22,423)	C OZL AT 15.6892 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(5,919)	(4,271)	1,648
EUR	(258,662)	C O2D GY 2.4161 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(12,310)	(10,357)	1,953
EUR	(214,583)	C O2D GY 2.5633 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(9,186)	(2,044)	7,142
EUR	(252,901)	C O2D GY 2.7125 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(11,523)	(641)	10,882
USD	(27)	C PBR UN 8 06/11/20	2020年11月6日	(831)	(810)	21
USD	(18)	C PBR UN 8 20/11/20	2020年11月20日	(698)	(450)	248
USD	(61)	C PBR UN 9 02/10/20	2020年10月2日	(1,389)	(61)	1,328
USD	(61)	C PBR UN 9 16/10/20	2020年10月16日	(1,836)	(122)	1,714
USD	(181)	C PBR UN 9.23 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(5,297)	(45)	5,252
USD	(51)	C PEG UN 53 12/11/20 FLEX	2020年11月12日	(8,148)	(17,970)	(9,822)
USD	(7,600)	C PHG UN 48.931 27/10/20 OTC	2020年10月27日	(9,558)	(6,119)	3,439
USD	(181)	C PHG UN 50 16/10/20	2020年10月16日	(34,890)	(6,335)	28,555

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	(30,300)	C PPL UN 28.4 13/11/20 OTC	2020年11月13日	(32,900)	(15,549)	17,351
USD	(103)	C PPL UN 30 16/10/20	2020年10月16日	(6,156)	(309)	5,847
GBP	(112,779)	C PSON LN 5.47404 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(3,886)	(41,559)	(37,673)
GBP	(108,381)	C PSON LN 5.90346 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(13,520)	(19,320)	(5,800)
GBP	(121,295)	C PSON LN 6.2385 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(14,267)	(27,544)	(13,277)
GBP	(102,917)	C PSON LN 6.29366 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(13,498)	(18,724)	(5,226)
GBP	(124,057)	C PSON LN 6.69432 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(16,169)	(18,182)	(2,013)
EUR	(12,150)	C PUB FP 29.6945 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2,081)	(5,618)	(3,537)
EUR	(11,087)	C PUB FP 31.7302 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(5,885)	(5,138)	747
EUR	(13,365)	C PUB FP 31.7662 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,387)	(9,931)	(3,544)
EUR	(11,676)	C PUB FP 32.6269 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(6,024)	(922)	5,102
EUR	(13,067)	C PUB FP 33.531 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(7,110)	(4,059)	3,051
USD	(60)	C PWR UN 51 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(12,406)	(13,845)	(1,439)
USD	(96)	C PWR UN 55 20/11/20	2020年11月20日	(20,905)	(21,120)	(215)
USD	(31)	C PXD UN 106 09/10/20	2020年10月9日	(7,371)	(155)	7,216
USD	(44)	C PXD UN 110 02/10/20	2020年10月2日	(14,884)	(3,520)	11,364
USD	(8)	C PXD UN 95 23/10/20	2020年10月23日	(2,147)	(1,232)	910
AUD	(3,487)	C REA AT 119.9498 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(5,402)	(2,782)	2,625
AUD	(3,529)	C REA AT 122.8737 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(5,875)	(159)	5,716
AUD	(3,587)	C REA AT 126.3207 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(6,329)	(131)	6,198
EUR	(60,839)	C REP SQ 6.7788 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,940)	(4,547)	2,393
EUR	(55,309)	C REP SQ 6.9054 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(1,805)	(714)	1,091
EUR	(50,472)	C REP SQ 7.6606 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(5,598)	(1,104)	4,494
EUR	(47,836)	C REP SQ 8.2908 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(6,153)	(64)	6,089
USD	(41)	C RHI UN 55 16/10/20	2020年10月16日	(6,323)	(2,255)	4,068
USD	(41)	C RHI UN 55 20/11/20	2020年11月20日	(12,352)	(12,013)	339
AUD	(3,984)	C RIO AT 107.6966 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(5,826)	(960)	4,866
AUD	(5,525)	C RIO AT 109.2415 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(8,376)	(366)	8,010
AUD	(5,669)	C RIO AT 111.452 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(6,904)	(12)	6,892
AUD	(4,380)	C RIO AT 111.6628 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(5,704)	(54)	5,650
USD	(59)	C RL UN 80 16/10/20	2020年10月16日	(20,650)	(1,475)	19,175
AUD	(16,374)	C RMD AT 26.8835 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,742)	(5,957)	785
AUD	(16,707)	C RMD AT 27.1634 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(4,096)	(1,133)	2,963
USD	(35)	C ROST UW 94.5 30/10/20	2020年10月30日	(9,415)	(9,450)	(35)
USD	(33)	C ROST UW 97 23/10/20	2020年10月23日	(13,835)	(5,412)	8,423
EUR	(16,038)	C RRTL GY 30.5564 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(7,538)	(61,495)	(53,957)
EUR	(11,493)	C RRTL GY 32.3608 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2,904)	(19,923)	(17,019)
EUR	(18,902)	C RRTL GY 34.6083 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(11,635)	(24,715)	(13,080)
EUR	(12,213)	C SAN FP 89.8928 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(20,890)	(26,625)	(5,735)
EUR	(18,881)	C SAN FP 93.483 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(35,288)	(33,443)	1,845
EUR	(16,363)	C SAN FP 93.8429 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(29,667)	(23,327)	6,340

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	(10,199)	C SAN FP 93.8722 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(15,759)	(2,571)	13,188
AUD	(74,171)	C SAR AT 6.2267 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(7,826)	(1,581)	6,245
USD	(7,600)	C SIEGY UV 69.65 20/10/20 OTC	2020年10月20日	(16,351)	(17,098)	(747)
USD	(2,700)	C SIEGY UV 72.215 20/10/20 OTC	2020年10月20日	(6,278)	(2,918)	3,360
USD	(212)	C SNY UW 50 16/10/20	2020年10月16日	(47,551)	(31,800)	15,751
USD	(40)	C SNY UW 52.76 20/11/20 FLEX	2020年11月20日	(7,550)	(5,111)	2,439
CHF	(11,542)	C SREN SE 74.5959 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(6,181)	(2,696)	3,485
CHF	(12,696)	C SREN SE 75.4433 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(17,051)	(17,370)	(319)
CHF	(10,532)	C SREN SE 79.5305 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(14,568)	(3,372)	11,196
CHF	(5,660)	C SREN SE 80.7674 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(7,516)	(348)	7,168
GBP	(78,188)	C STAN LN 4.06539 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(1,884)	(2,172)	(288)
GBP	(86,007)	C STAN LN 4.22044 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,285)	(11,399)	(5,114)
GBP	(71,350)	C STAN LN 4.53 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(6,143)	(2,720)	3,423
GBP	(84,091)	C STAN LN 4.61472 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(6,548)	(5,000)	1,548
GBP	(75,138)	C STAN LN 4.91524 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(7,336)	(209)	7,127
DKK	(6,914)	C STG DC 100.6587 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(1,526)	(283)	1,243
AUD	(80,812)	C STO AT 5.7088 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,632)	(2,209)	4,423
AUD	(56,709)	C STO AT 6.2288 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(5,522)	(273)	5,249
AUD	(80,001)	C SYD AT 5.5289 14/10/20 OTC	2020年10月14日	(7,476)	(20,652)	(13,176)
GBP	(208,317)	C S32 LN 1.28751 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(5,476)	(5,970)	(494)
GBP	(129,202)	C S32 LN 1.33966 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(3,608)	(3,390)	218
GBP	(89,647)	C S32 LN 1.3586 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(1,011)	(147)	864
GBP	(150,535)	C S32 LN 1.39212 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(4,113)	(2,078)	2,035
AUD	(28,647)	C TCL AT 14.4148 21/10/20 OTC	2020年10月21日	(4,500)	(4,781)	(281)
AUD	(29,339)	C TCL AT 14.8914 28/10/20 OTC	2020年10月28日	(5,715)	(2,873)	2,842
USD	(242)	C TDS UN 21.37 16/10/20 FLEX	2020年10月16日	(10,833)	(1,302)	9,531
USD	(242)	C TDS UN 22.5 20/11/20	2020年11月20日	(16,983)	(6,050)	10,933
USD	(26)	C TJX UN 55 06/11/20	2020年11月6日	(3,842)	(7,800)	(3,958)
USD	(30)	C TJX UN 55 16/10/20	2020年10月16日	(4,133)	(5,040)	(907)
GBP	(366,041)	C TSCO LN 2.2533 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(16,346)	(17,747)	(1,401)
GBP	(531,280)	C TSCO LN 2.32839 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(22,385)	(9,301)	13,084
GBP	(524,253)	C TSCO LN 2.34543 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(10,732)	(7,612)	3,120
GBP	(649,950)	C TSCO LN 2.34652 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(33,154)	(28,388)	4,766
USD	(92)	C TSM UN 78.5 02/10/20	2020年10月2日	(34,182)	(22,908)	11,274
USD	(18)	C TSM UN 80 16/10/20	2020年10月16日	(6,570)	(6,750)	(180)
USD	(37)	C TSM UN 80.5 30/10/20	2020年10月30日	(10,480)	(14,504)	(4,024)
EUR	(51,559)	C UCG IM 10.3573 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(8,563)	(90)	8,473
EUR	(53,652)	C UCG IM 8.1843 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2,483)	(1,853)	630
EUR	(59,017)	C UCG IM 8.4554 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(7,889)	(11,723)	(3,834)
EUR	(48,960)	C UCG IM 9.6891 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(8,137)	(1,319)	6,818
CHF	(1,404)	C UHR SE 208.8909 22/10/20 OTC	2020年10月22日	(5,156)	(15,170)	(10,014)

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	(1,333)	C UHR SE 212.0712 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(4,390)	(16,359)	(11,969)
CHF	(1,461)	C UHR SE 223.6581 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(2,369)	(3,590)	(1,221)
CHF	(1,607)	C UHR SE 229.9989 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(7,242)	(10,555)	(3,313)
CHF	(1,571)	C UHR SE 230.9472 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(6,929)	(8,401)	(1,472)
USD	(19)	C UN UN 58.86 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(2,427)	(3,877)	(1,450)
USD	(3,200)	C UN UN 61.75 16/11/20 OTC	2020年11月16日	(5,968)	(4,342)	1,626
USD	(97)	C UN UN 61.87 01/10/20 FLEX	2020年10月1日	(9,095)	(369)	8,726
USD	(31)	C UN UN 62.5 16/10/20	2020年10月16日	(3,651)	(1,271)	2,380
USD	(85)	C UN UN 62.5 20/11/20	2020年11月20日	(9,670)	(10,625)	(955)
USD	(58)	C VZ UN 59 02/10/20	2020年10月2日	(7,657)	(2,610)	5,047
USD	(38)	C VZ UN 60 09/10/20	2020年10月9日	(5,273)	(950)	4,323
USD	(80)	C VZ UN 60 16/10/20	2020年10月16日	(7,949)	(2,800)	5,149
USD	(28)	C VZ UN 60 20/11/20	2020年11月20日	(3,605)	(3,388)	217
USD	(33)	C VZ UN 61 23/10/20	2020年10月23日	(3,325)	(1,254)	2,071
AUD	(27,103)	C WBC AT 17.7693 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,318)	(5,589)	729
AUD	(29,686)	C WBC AT 18.4288 30/12/20 OTC	2020年12月30日	(8,693)	(5,769)	2,924
AUD	(298)	C WBC AT 19 15/10/20	2020年10月15日	(3,152)	(148)	3,004
USD	(35)	C WFC UN 25 20/11/20	2020年11月20日	(3,492)	(3,500)	(8)
USD	(117)	C WFC UN 25.5 06/11/20	2020年11月6日	(6,866)	(6,903)	(37)
USD	(32)	C WFC UN 25.5 23/10/20	2020年10月23日	(2,456)	(1,216)	1,240
USD	(36)	C WFC UN 25.75 20/11/20 FLEX	2020年11月20日	(3,105)	(2,850)	255
USD	(32)	C WFC UN 26.5 30/10/20	2020年10月30日	(2,648)	(960)	1,688
USD	(9)	C WFC UN 27.5 16/10/20	2020年10月16日	(484)	(72)	412
USD	(21)	C WMB UN 20.86 30/10/20 FLEX	2020年10月30日	(1,948)	(1,360)	588
USD	(46)	C WMB UN 21.95 09/10/20 FLEX	2020年10月9日	(2,075)	(141)	1,934
USD	(113)	C WMB UN 21.97 23/10/20 FLEX	2020年10月23日	(4,493)	(2,141)	2,352
USD	(46)	C WMB UN 22 16/10/20	2020年10月16日	(2,427)	(414)	2,013
USD	(78)	C WMB UN 22 20/11/20	2020年11月20日	(5,856)	(3,900)	1,956
USD	(22)	C WMB UN 22.5 02/10/20	2020年10月2日	(1,667)	(198)	1,469
AUD	(13,842)	C WOW AT 38.8443 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(5,458)	(4,072)	1,386
AUD	(16,609)	C WOW AT 39.0293 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(7,056)	(5,158)	1,898
AUD	(16,841)	C WOW AT 39.6533 16/12/20 OTC	2020年12月16日	(8,234)	(5,534)	2,700
AUD	(16,276)	C WOW AT 39.6652 09/12/20 OTC	2020年12月9日	(9,585)	(4,776)	4,809
AUD	(13,838)	C WOW AT 41.4059 25/11/20 OTC	2020年11月25日	(6,611)	(1,263)	5,348
AUD	(13,514)	C WOW AT 41.5986 18/11/20 OTC	2020年11月18日	(5,186)	(885)	4,301
AUD	(10,113)	C WOW AT 41.7536 11/11/20 OTC	2020年11月11日	(3,429)	(461)	2,968
GBP	(48,604)	C WPP LN 6.20355 19/10/20 OTC	2020年10月19日	(1,600)	(8,995)	(7,395)
GBP	(53,464)	C WPP LN 6.78783 23/12/20 OTC	2020年12月23日	(6,818)	(11,134)	(4,316)
GBP	(44,353)	C WPP LN 6.80761 19/11/20 OTC	2020年11月19日	(5,621)	(6,672)	(1,051)
GBP	(52,274)	C WPP LN 7.32238 10/12/20 OTC	2020年12月10日	(6,746)	(4,874)	1,872
USD	(156)	C XRAY UW 45 16/10/20	2020年10月16日	(16,967)	(9,360)	7,607

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	(3,334)	C XRO AT 104.3825	11/11/20 OTC	2020年11月11日	(7,161)	(7,182)	(21)
AUD	(3,974)	C XRO AT 108.7917	16/12/20 OTC	2020年12月16日	(8,307)	(8,420)	(113)
TWD	(200,000)	C 2317 TT 83.3495	12/10/20 OTC	2020年10月12日	(100)	(142)	(42)
HKD	(110,000)	C 2601 HK 24.6388	09/10/20 OTC	2020年10月9日	(66)	(110)	(44)
HKD	(6,000)	C 388 HK 400.044	12/10/20 OTC	2020年10月12日	(84)	(138)	(54)
JPY	(13,000)	C 4185 JT 2593.9056	02/10/20 OTC	2020年10月2日	(154)	(20)	134
HKD	(90,000)	C 425 HK 35.784	09/10/20 OTC	2020年10月9日	(261)	(6,214)	(5,953)
JPY	(9,000)	C 4568 JT 3515.64	02/10/20 OTC	2020年10月2日	(56)	0	56
JPY	(20,000)	C 6301 JT 2455.425	02/10/20 OTC	2020年10月2日	(89)	(6)	83
JPY	(5,000)	C 6988 JT 7367	05/10/20 OTC	2020年10月5日	(99)	(74)	25
JPY	(12,000)	C 7203 JT 7333.04	02/10/20 OTC	2020年10月2日	(161)	0	161
JPY	(1,200)	C 9435 JT 27541.8	08/10/20 OTC	2020年10月8日	(59)	(24)	35
AUD	(318)	P AS51 5450	19/11/20	2020年11月19日	(181,712)	(230,635)	(48,923)
					(4,295,191)	(2,957,174)	1,338,017
					(3,982,296)	(2,534,830)	1,447,466

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年8月19日）

作成対象期間（2020年8月20日～2021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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		騰落	中率			
	円		%	%	%	百万円
15期(2017年8月21日)	10,208		△0.0	64.0	—	17,754
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

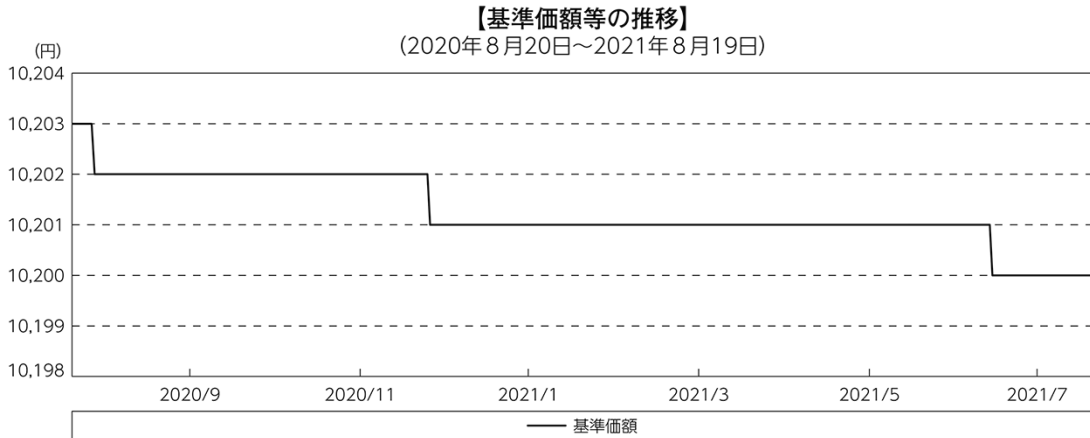
年月日	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰落	率			
(期首) 2020年8月19日	円		%	%	%	%
	10,203		—	68.2	—	—
8月末	10,202		△0.0	58.9	—	—
9月末	10,202		△0.0	50.4	—	—
10月末	10,202		△0.0	56.6	—	—
11月末	10,202		△0.0	28.3	—	—
12月末	10,201		△0.0	48.3	—	—
2021年1月末	10,201		△0.0	58.0	—	—
2月末	10,201		△0.0	56.6	—	—
3月末	10,201		△0.0	53.8	—	—
4月末	10,201		△0.0	59.8	—	—
5月末	10,201		△0.0	58.1	—	—
6月末	10,201		△0.0	57.9	—	—
7月末	10,200		△0.0	55.9	—	—
(期末) 2021年8月19日	円		%	%	%	%
	10,200		△0.0	60.1	—	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

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

○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.07%程度で推移しました。

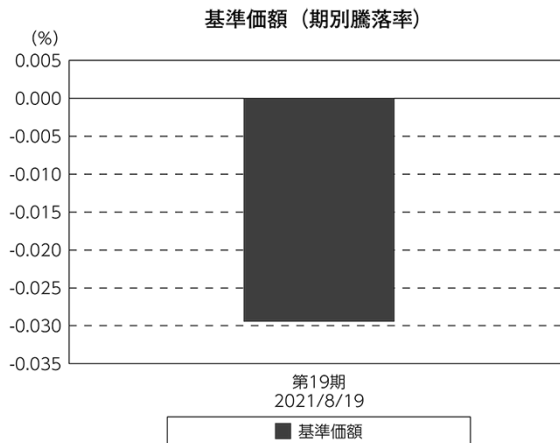
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年8月20日～2021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

(2020年8月20日～2021年8月19日)

公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 2,933,243	千円 — (2,410,000)
	特殊債券	7,744,464	— (6,142,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	4,656,400	— (3,416,400)

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

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

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 200,000	千円 — (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

(2020年8月20日～2021年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円		%	百万円
公社債	15,334	130	0.8	—	—	—

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

○組入資産の明細

(2021年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	1,300,000 (1,300,000)	1,302,420 (1,302,420)	14.2 (14.2)	— (—)	— (—)	— (—)	14.2 (14.2)
特殊債券 (除く金融債)	1,167,000 (1,167,000)	1,168,119 (1,168,119)	12.8 (12.8)	— (—)	— (—)	— (—)	12.8 (12.8)
金融債券	1,230,000 (1,230,000)	1,230,089 (1,230,089)	13.4 (13.4)	— (—)	— (—)	— (—)	13.4 (13.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,800,000 (1,800,000)	1,801,060 (1,801,060)	19.7 (19.7)	— (—)	— (—)	— (—)	19.7 (19.7)
合 計	5,497,000 (5,497,000)	5,501,690 (5,501,690)	60.1 (60.1)	— (—)	— (—)	— (—)	60.1 (60.1)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第702回	1.04	100,000	100,353	2021/12/20
大阪府 公募第354回	1.03	100,000	100,201	2021/10/28
共同発行市場地方債 公募第102回	1.03	500,000	500,520	2021/9/24
熊本県 公募平成23年度第2回	1.0	340,000	340,645	2021/10/28
広島市 公募平成23年度第2回	1.0	200,000	200,380	2021/10/25
広島市 公募平成23年度第5回	1.01	60,000	60,319	2022/2/25
小 計		1,300,000	1,302,420	
特殊債券(除く金融債)				
政保 地方公共団体金融機構債券(8年) 第2回	0.502	30,000	30,058	2021/12/24
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第152回	1.1	77,000	77,321	2021/12/28
首都高速道路 第19回	0.07	500,000	500,131	2021/12/20
阪神高速道路 第19回	0.02	460,000	460,073	2021/12/20
成田国際空港 第11回	1.067	100,000	100,534	2022/2/18
小 計		1,167,000	1,168,119	
金融債券				
商工債券 利付第802回い号	0.06	30,000	30,002	2022/3/25
しんきん中金債券 利付第321回	0.03	150,000	150,002	2021/8/27
しんきん中金債券 利付第322回	0.03	450,000	450,018	2021/9/27
商工債券 利付(3年)第223回	0.11	500,000	500,053	2021/8/27
商工債券 利付(3年)第224回	0.11	100,000	100,013	2021/9/27
小 計		1,230,000	1,230,089	
普通社債券(含む投資法人債券)				
中部電力 第522回	0.13	300,000	300,284	2022/4/25
関西電力 第525回	0.14	100,000	100,050	2021/12/20
クレディセゾン 第53回社債間限定同順位特約付	0.435	600,000	600,488	2021/10/22
トヨタファイナンス 第66回社債間限定同順位特約付	0.233	100,000	100,018	2021/9/17
三菱UFJリース 第43回社債間限定同順位特約付	0.06	500,000	500,088	2021/10/25
三井不動産 第44回社債間限定同順位特約付	1.173	200,000	200,129	2021/9/6
小 計		1,800,000	1,801,060	
合 計		5,497,000	5,501,690	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	5,501,690	60.1
コール・ローン等、その他	3,657,462	39.9
投資信託財産総額	9,159,152	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 (2021年8月19日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	9,159,152,994
コール・ローン等	3,648,709,633
公社債(評価額)	5,501,690,180
未収利息	6,302,831
前払費用	2,450,350
(B) 負債	3,052
未払利息	3,052
(C) 純資産総額(A-B)	9,159,149,942
元本	8,979,256,768
次期繰越損益金	179,893,174
(D) 受益権総口数	8,979,256,768口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,200円

(注) 期首元本額は3,112,610,329円、期中追加設定元本額は11,088,903,882円、期中一部解約元本額は5,222,257,443円、1口当たり純資産額は1.0200円です。

○損益の状況 (2020年8月20日～2021年8月19日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	26,935,137
受取利息	27,892,600
支払利息	△ 957,463
(B) 有価証券売買損益	△ 28,401,101
売買損	△ 28,401,101
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,465,964
(D) 前期繰越損益金	63,039,317
(E) 追加信託差損益金	223,303,118
(F) 解約差損益金	△ 104,983,297
(G) 計(C+D+E+F)	179,893,174
次期繰越損益金(G)	179,893,174

*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)	2,690,621,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,977,425,742
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家販売制限付)	1,413,674,178
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	287,434,434
野村世界業種別投資シリーズ(マネーブル・ファンド)	241,214,028
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーブル・ファンド)	101,692,450
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投資	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
ネクストコア	2,282,012
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第12回 野村短期公社債ファンド	1,901,723
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村グローバル・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

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
野村テンプレートン・トータル・リターン Aコース	983,381

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・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
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 (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) 年2回決算型	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) 年2回決算型	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PIMCO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 (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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO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
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 (米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
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
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資 (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資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	398,357
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715
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	373,897
第7回 野村短期公社債ファンド	204,767
野村通貨選択日本株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投資 (インドルピーコース) 毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村通貨選択日本株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (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資 (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資 (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資 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投資 (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資 (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資 (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資 (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資 (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資 (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資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンプルトン・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資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
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
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
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772
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(中国元コース)年2回決算型	41,054
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859
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	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
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テンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプレートン・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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

〇お知らせ

該当事項はございません。