

# 野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型

## 運用報告書(全体版)

第13期(決算日2018年5月17日)

作成対象期間(2017年11月18日～2018年5月17日)

### 受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/株式	
信託期間	2011年11月18日から2021年11月17日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-日本円クラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券を通じて、世界の高配当利回り株式(以下、「高配当株」といいます。)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-日本円クラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。	
主な投資対象	野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-日本円クラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV-グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム-日本円クラス	世界の高配当株を主要投資対象とします。加えて、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す「株式プレミアム戦略」を活用します。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への直接投資は行いません。
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
	野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	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います。

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近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 込 配 金	騰 落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
9期(2016年5月17日)	13,123	10	△3.8	0.0	—	98.2	3,136
10期(2016年11月17日)	13,884	10	5.9	0.0	—	99.2	2,770
11期(2017年5月17日)	14,875	10	7.2	0.0	—	99.1	2,229
12期(2017年11月17日)	15,208	10	2.3	0.0	—	98.8	1,795
13期(2018年5月17日)	15,758	10	3.7	0.0	—	99.0	1,355

\* 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	%	%	%	%	%
2017年11月17日	15,208	—	0.0	—	98.8	
11月末	15,398	1.2	0.0	—	99.0	
12月末	15,536	2.2	0.0	—	99.0	
2018年1月末	15,883	4.4	0.0	—	99.1	
2月末	15,636	2.8	0.0	—	99.0	
3月末	15,124	△0.6	0.0	—	98.8	
4月末	15,494	1.9	0.0	—	98.2	
(期末)						
2018年5月17日	15,758	3.7	0.0	—	99.0	

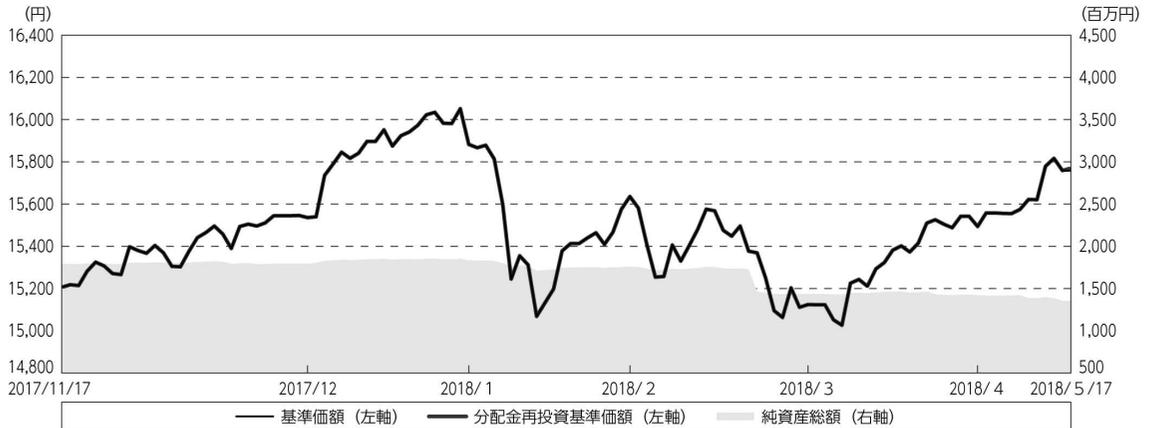
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：15,208円

期 末：15,758円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 3.7%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2017年11月17日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

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

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

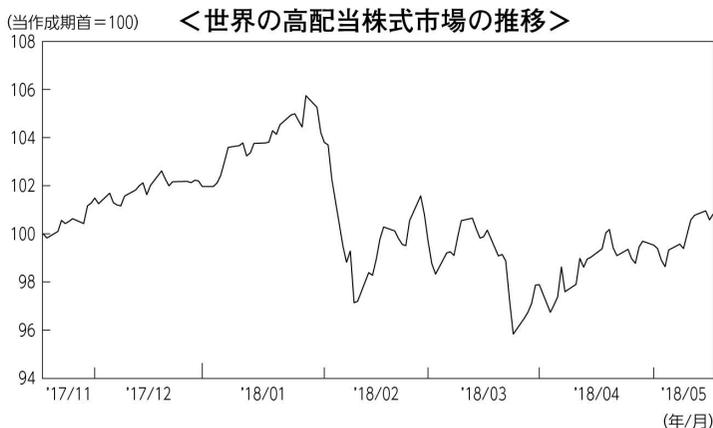
基準価額は、当作成期首15,208円から当作成期末には15,758円となりました。

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

## ○投資環境

### <世界の高配当株式市場>

世界の高配当株式市場の騰落は以下のようになりました。



（注）市場指数の騰落は、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。また、市場指数は、MSCIワールド・ハイ・ディビデント・イールド・インデックスの現地通貨建て指数を用いています。（出所：ブルームバーグ）

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

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

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型]

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー日本円クラス〕受益証券および〔野村マネー マザーファンド〕受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー日本円クラス〕受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

### [ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー日本円クラス]

#### ・ポートフォリオ特性値

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

ポートフォリオ特性値	
組入比率	89.4%
カバー率	46.4%
平均行使価格	100.3%
平均行使期間	25.7日
配当利回り（年率、米ドル為替取引後ベース）*	3.8%
プレミアム（年率）	3.9%

・左記のポートフォリオ特性値は、各副投資顧問会社のポートフォリオの特性値（カバー率、平均行使価格等）を、その組入比率で加重平均したものです（米ドル建て）。

・カバー率：純資産に対するオプションのポジション

・平均行使価格：原資産価格（株価）に対する平均権利行使価格

・平均行使期間：権利行使日までの平均日数

・配当利回り：純資産に対する予想配当利回り

・プレミアム（年率）：純資産に対する年率調整後のプレミアム収入

※米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、原則として米ドル以外の株式など組入資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行います。また、当該為替取引では、米ドルの金利が株式など組入資産にかかる通貨の金利より低い場合は為替取引によるコストが発生する場合があります。配当利回りは、組入資産（現地通貨建て）の配当利回りに当該為替取引によるプレミアム／コストを反映し、表示しています。

主要投資対象である〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム〕のポートフォリオにおける地域別比率は、当作成期末現在で、米州27.0%、欧州33.0%、アジア・太平洋29.4%となりました。同ポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、金融26.4%、生活必需品16.2%、エネルギー9.3%となりました。

\*地域別株式配分比率において、国・地域は原則発行国・地域で区分しております。

また、高配当株への投資に加えて、『株式プレミアム戦略』に則り、現物株の買い入れと同時にコール・オプションの売却を行い、プレミアム収入の確保を図りました。

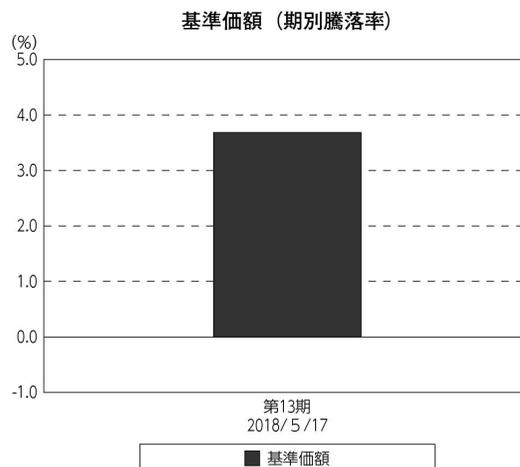
### [野村マネー マザーファンド]

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、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、分配を行いました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項 目	第13期
	2017年11月18日～ 2018年5月17日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.063%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,519

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

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

## ◎今後の運用方針

### 【野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型】

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

### 【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアムー日本円クラス】

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

米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が当該資産について、原則として対米ドルで為替取引を行います。組入資産について、原則として、日本円で為替ヘッジを行います。

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

### 【野村マネー マザーファンド】

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

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

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、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年11月18日～2018年5月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 73	% 0.471	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(29)	(0.187)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(42)	(0.268)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	( 2)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b)その他費用＝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	73	0.473	
期中の平均基準価額は、15,511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。

## ○売買及び取引の状況

(2017年11月18日～2018年5月17日)

## 投資信託証券

銘 柄		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- 日本円クラス	4,167	42,417 千円	47,795	477,828 千円

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年11月18日～2018年5月17日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;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&gt;

該当事項はございません。

&lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 9,954	百万円 703	% 7.1	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

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

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

## ○組入資産の明細

(2018年5月17日現在)

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV- グローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム- 日本円クラス	176,028	132,400	1,342,271	99.0
合 計	176,028	132,400	1,342,271	99.0

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 親投資信託残高

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

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年5月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 1,342,271	% 95.4
野村マネー マザーファンド	1,003	0.1
コール・ローン等、その他	63,930	4.5
投資信託財産総額	1,407,204	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（2018年5月17日現在）

## ○損益の状況（2017年11月18日～2018年5月17日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,407,204,420
コール・ローン等	28,595,365
投資信託受益証券(評価額)	1,342,271,200
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,003,440
未収入金	35,334,415
(B) 負債	52,054,224
未払収益分配金	859,977
未払解約金	43,250,799
未払信託報酬	7,916,471
未払利息	49
その他未払費用	26,928
(C) 純資産総額(A-B)	1,355,150,196
元本	859,977,994
次期繰越損益金	495,172,202
(D) 受益権総口数	859,977,994口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,758円

(注) 期首元本額は1,180,569,569円、期中追加設定元本額は15,848,879円、期中一部解約元本額は336,440,454円、1口当たり純資産額は1,5758円です。

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	48,329,962
受取配当金	48,336,387
支払利息	△ 6,425
(B) 有価証券売買損益	6,255,975
売買益	11,241,361
売買損	△ 4,985,386
(C) 信託報酬等	△ 7,943,399
(D) 当期損益金(A+B+C)	46,642,538
(E) 前期繰越損益金	124,299,495
(F) 追加信託差損益金	325,090,146
(配当等相当額)	( 360,327,754)
(売買損益相当額)	(△ 35,237,608)
(G) 計(D+E+F)	496,032,179
(H) 収益分配金	△ 859,977
次期繰越損益金(G+H)	495,172,202
追加信託差損益金	325,090,146
(配当等相当額)	( 360,327,756)
(売買損益相当額)	(△ 35,237,610)
分配準備積立金	286,375,643
繰越損益金	△116,293,587

\* 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(2017年11月18日～2018年5月17日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2017年11月18日～ 2018年5月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	41,298,305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	360,327,756円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	245,937,315円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	647,563,376円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,529円
g. 分配金	859,977円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

## ○分配金のお知らせ

1 万円当たり分配金（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。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2018年5月17日現在）

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

下記は、野村マネー マザーファンド全体（15,574,560千口）の内容です。

## 国内公社債

## (A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	1,246,000 (1,246,000)	1,247,766 (1,247,766)	7.8 ( 7.8)	— (—)	— (—)	— (—)	7.8 ( 7.8)
特殊債券 (除く金融債)	1,683,000 (1,683,000)	1,684,568 (1,684,568)	10.6 (10.6)	— (—)	— (—)	— (—)	10.6 (10.6)
金融債券	1,340,000 (1,340,000)	1,340,264 (1,340,264)	8.4 ( 8.4)	— (—)	— (—)	— (—)	8.4 ( 8.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	2,900,000 (2,900,000)	2,905,841 (2,905,841)	18.3 (18.3)	— (—)	— (—)	— (—)	18.3 (18.3)
合 計	7,169,000 (7,169,000)	7,178,440 (7,178,440)	45.2 (45.2)	— (—)	— (—)	— (—)	45.2 (45.2)

\*（ ）内は非上場債で内書きです。

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

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

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

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内その他有価証券

区 分	当 期	末
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 3,399,999	% 21.4

\*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。  
\*金額の単位未満は切り捨て。

Nomura Multi Managers Fund V – Global High Dividend Equity Premium

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

2017年9月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託										
投 資 目 的	<ul style="list-style-type: none"> <li>◆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。</li> <li>◆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。</li> </ul>										
投 資 態 度	<ul style="list-style-type: none"> <li>●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。</li> <li>●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。</li> </ul> <table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width:25%;">地域名</td> <td style="width:25%;">米州</td> <td style="width:25%;">欧州</td> <td style="width:25%;">アジア・太平洋</td> </tr> <tr> <td>投資比率</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> <td>25～50%</td> </tr> </table>			地域名	米州	欧州	アジア・太平洋	投資比率	25～50%	25～50%	25～50%
	地域名	米州	欧州	アジア・太平洋							
投資比率	25～50%	25～50%	25～50%								
<p>※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●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。</li> <li>●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。</li> <li>※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。</li> <li>●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。</li> <li>●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。</li> </ul> <p>&lt;通貨セレクトクラスにおける通貨運用方針&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>●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。</li> <li>●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。</li> <li>●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。</li> <li>●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。</li> <li>●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。</li> <li>●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。</li> <li>●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。</li> </ul>											
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー										
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社										
管理事務代行会社 保 管 銀 行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー										

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

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

純資産計算書  
2017年9月30日現在  
(金額は米ドル表示)

資産	
投資有価証券時価 (取得原価 : 1,487,745,969米ドル)	1,614,718,170
現金預金等	213,180,019
先物契約に係る評価差益	389,025
デリバティブに係る委託証拠金	428,055
ブローカーからの未収金	5,399,752
未収収益	3,086,589
現金および現金等価物に係る利息	5,463
	1,837,207,073
資産合計	
	1,837,207,073
負債	
投資オプション契約時価(売り) (取得原価 : 9,170,326米ドル)	13,365,328
銀行借越金	1,849,483
外国為替先渡し契約に係る評価差損	26,374,712
受益証券買戻支払金	10,567,303
ブローカーへの未払金	2,736,177
未払費用	5,032,121
	59,925,124
負債合計	
	59,925,124
純資産総額	1,777,281,949

## 受益証券一口当たり情報 :

	期末1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス(円)	10,129	510,042	5,166,277,871
通貨セレクトクラス(円)	4,725	37,294,220	176,198,062,233

**運用計算書**  
**2017年9月30日に終了する計測期間**  
*(金額は米ドル表示)*

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

純資産変動計算書  
2017年9月30日に終了する計測期間  
(金額は米ドル表示)

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

**発行済受益証券数の変動表**  
**2017年9月30日に終了する計測期間**  
*(未監査)*

## 日本円クラス

期首受益証券数	652,143
発行受益証券数	74,906
買戻受益証券数	(217,007)
期末発行済受益証券数	510,042

## 通貨セレクトクラス

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

**統計情報**  
**2017年9月30日現在**  
*(未監査)*

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

組入資産明細  
2017年9月30日現在  
(金額は米ドル表示)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

\* 部分的にデリバティブの担保として差し入れられている有価証券

## 財務書類に関する注記

2017年9月30日現在

(購入金額、売却金額、契約数は通貨を欄左側に表示)

## 注記1ー外国為替先渡し契約

2017年9月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

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

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

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

## 注記2 - 先物契約

2017年9月30日現在、ファンドは以下の未決済先物契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
<i>買い持ちポジション</i>					
USD	182	FUT S&P 500 EMINI	2017年12月	22,809,150	389,025
				<u>22,809,150</u>	<u>389,025</u>
					<u><b>389,025</b></u>

## 注記3 - オプション契約

2017年9月30日現在、ファンドは以下の未決済オプション契約を有していた。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日2017年8月21日）

作成対象期間（2016年8月20日～2017年8月21日）

### 受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		騰	落			
11期(2013年8月19日)	円 10,191		% 0.1	% 80.9	% —	百万円 5,297
12期(2014年8月19日)	10,199		0.1	59.7	—	8,648
13期(2015年8月19日)	10,206		0.1	44.7	—	22,034
14期(2016年8月19日)	10,211		0.0	68.6	—	19,722
15期(2017年8月21日)	10,208		△0.0	64.0	—	17,754

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

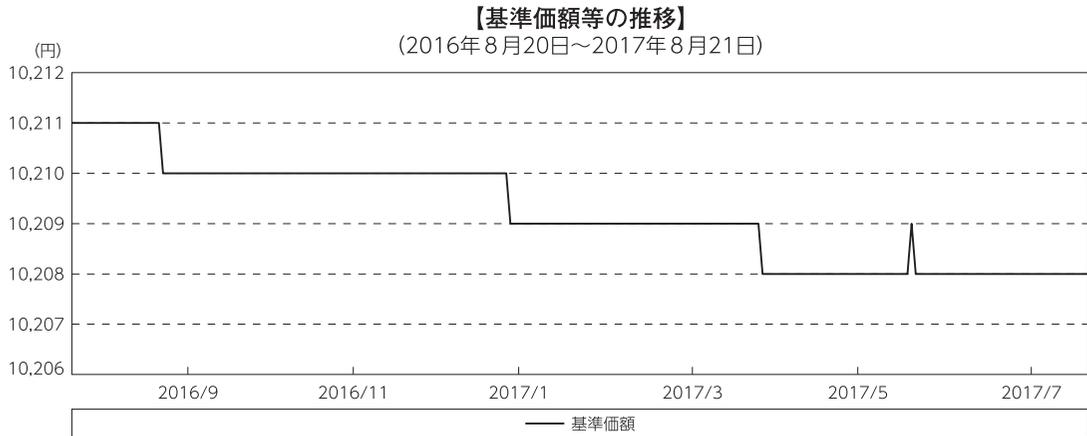
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落		
(期首) 2016年8月19日	円 10,211		% —	% 68.6	% —
8月末	10,211		0.0	66.8	—
9月末	10,210		△0.0	55.4	—
10月末	10,210		△0.0	67.1	—
11月末	10,210		△0.0	81.1	—
12月末	10,210		△0.0	54.1	—
2017年1月末	10,209		△0.0	49.7	—
2月末	10,209		△0.0	48.6	—
3月末	10,209		△0.0	29.2	—
4月末	10,208		△0.0	75.0	—
5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

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



### ○基準価額の主な変動要因

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

## ○投資環境

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

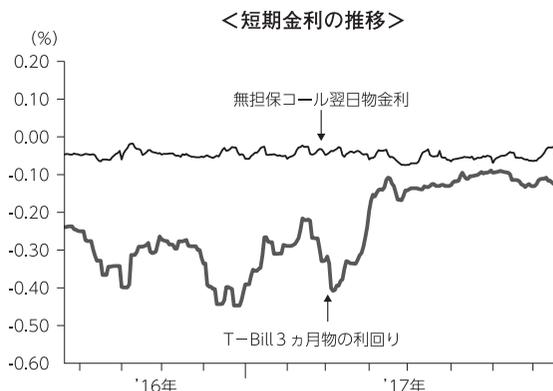
このような中、日本銀行は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を継続し、2016年9月には、これらの政策枠組みを強化する意味合いから「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入しました。

### ・無担保コール翌日物金利の推移

マイナス金利政策のもと、-0.05%程度で推移しました。

### ・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

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



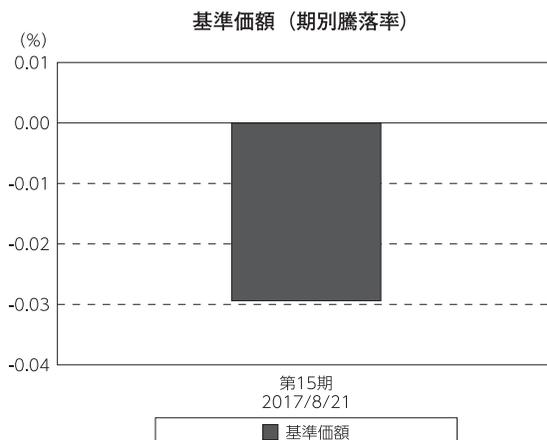
## ○当ファンドのポートフォリオ

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

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2016年8月20日～2017年8月21日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2016年8月20日～2017年8月21日)

### 公社債

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

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は償還等による増減分です。

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

### その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	3,599,972	—
			(3,900,000)

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は償還等による増減分です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年8月20日～2017年8月21日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 41,994	百万円 4,092	% 9.7	百万円 —	百万円 —	% —

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

## ○組入資産の明細

(2017年8月21日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	4,020,000 ( 4,020,000)	4,031,567 ( 4,031,567)	22.7 (22.7)	— (—)	— (—)	— (—)	22.7 (22.7)
特殊債券 (除く金融債)	1,205,000 ( 1,205,000)	1,207,280 ( 1,207,280)	6.8 ( 6.8)	— (—)	— (—)	— (—)	6.8 ( 6.8)
金融債券	2,090,000 ( 2,090,000)	2,090,748 ( 2,090,748)	11.8 (11.8)	— (—)	— (—)	— (—)	11.8 (11.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	4,030,000 ( 4,030,000)	4,034,993 ( 4,034,993)	22.7 (22.7)	— (—)	— (—)	— (—)	22.7 (22.7)
合 計	11,345,000 (11,345,000)	11,364,590 (11,364,590)	64.0 (64.0)	— (—)	— (—)	— (—)	64.0 (64.0)

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
住友不動産 第84回社債間限定同順位特約付		0.388	100,000	100,196	2018/2/28
東日本旅客鉄道 第7回社債間限定同順位特約付		3.3	600,000	600,236	2017/8/25
東日本旅客鉄道 第50回社債間限定同順位特約付		1.86	100,000	100,153	2017/9/20
東海旅客鉄道 第3回		2.825	200,000	201,066	2017/10/30
電源開発 第34回社債間限定同順位特約付		0.592	200,000	200,095	2017/9/20
小 計			4,030,000	4,034,993	
合 計			11,345,000	11,364,590	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

### 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	899,993	5.1

\*比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

### ○投資信託財産の構成

(2017年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	11,364,590	63.6
その他有価証券	899,993	5.0
コール・ローン等、その他	5,590,335	31.4
投資信託財産総額	17,854,918	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年8月21日現在)

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

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

## ○損益の状況 (2016年8月20日～2017年8月21日)

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

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

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

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

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30 (非課税適格機関投資家専用)	5,423,785,404
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50 (適格機関投資家転売制限付)	4,206,288,588
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	3,161,244,481
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Zプライス(適格機関投資家専用)	2,296,160,091
日本株インカムプラス <sub>a</sub> (公社債運用移行型)1305(適格機関投資家転売制限付)	969,401,962
野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	436,168,504
野村世界高金利通貨投資	151,953,753
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06	146,986,772
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	98,153,976
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09	98,039,216
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村米国ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	49,417,625
野村高金利国際機関債投資(毎月分配型)	49,354,623
ネクストコア	19,922,154
野村新中國株投資 マネーボール・ファンド	14,424,815
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	10,258,341
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド	6,983,416
野村新米国ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	6,929,426
野村新興国消費関連株投資 マネーボール・ファンド	5,350,038
野村グローバルCB投資(マネーボールファンド)年2回決算型	3,826,372
野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド	3,459,024
野村新エマージング債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	3,279,122

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	3,123,334
米国変動好金利ファンド Aコース	2,952,997
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネーボールファンド)年2回決算型	1,937,870
野村・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド	1,020,305
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768



ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチュ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
第1回 野村短期公社債ファンド	98,261
第2回 野村短期公社債ファンド	98,261
第3回 野村短期公社債ファンド	98,261
第4回 野村短期公社債ファンド	98,261
第5回 野村短期公社債ファンド	98,261
第6回 野村短期公社債ファンド	98,261
第7回 野村短期公社債ファンド	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
第11回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Bコース	98,260
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260
野村通貨選択日本株投資(中国元コース)年2回決算型	98,146
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投資(インドネシアルピアコース)年2回決算型	82,780
野村通貨選択日本株投資(インドネシアルピアコース)毎月分配型	80,956
野村通貨選択日本株投資(中国元コース)毎月分配型	58,906
野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース)年2回決算型	52,622
野村通貨選択日本株投資(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投資(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
野村新興国高配当株トリプルウィング ブラジルリアル毎月分配型	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイトータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース)年2回決算型	4,908
野村高金利国際機関債投資(年2回決算型)	1,967
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース)毎月分配型	1,963

## 〇お知らせ

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

＜変更適用日：2017年3月31日＞

### <お申し込み時の留意点>

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

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

(2018年5月17日現在)

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

※2018年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ (<http://www.nomura-am.co.jp/>) にも掲載いたしております。