

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18期（決算日2020年11月17日）

作成対象期間（2020年5月19日～2020年11月17日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式		
信託期間	2011年11月18日から2026年11月17日までです。		
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV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	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。	
	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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金 期 騰 落 中 率				
	円		円	%	%	%	%	百万円
14期(2018年11月19日)	14,972		10	△ 4.9	0.0	—	98.8	1,176
15期(2019年5月17日)	15,106		10	1.0	0.1	—	98.3	1,091
16期(2019年11月18日)	15,646		10	3.6	0.1	—	99.2	1,034
17期(2020年5月18日)	12,656		10	△19.0	0.1	—	98.9	888
18期(2020年11月17日)	14,920		10	18.0	0.0	—	99.0	794

* 基準価額の騰落率は分配金込み。
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首)	円		%	%	%	%
2020年5月18日	12,656	—	—	0.1	—	98.9
5月末	13,483		6.5	0.0	—	98.2
6月末	13,483		6.5	0.1	—	98.9
7月末	13,687		8.1	0.1	—	98.9
8月末	14,127		11.6	0.1	—	98.9
9月末	13,618		7.6	0.1	—	99.2
10月末	13,401		5.9	0.1	—	99.2
(期 末)						
2020年11月17日	14,930		18.0	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：12,656円

期 末：14,920円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 18.0%（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（2020年5月18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

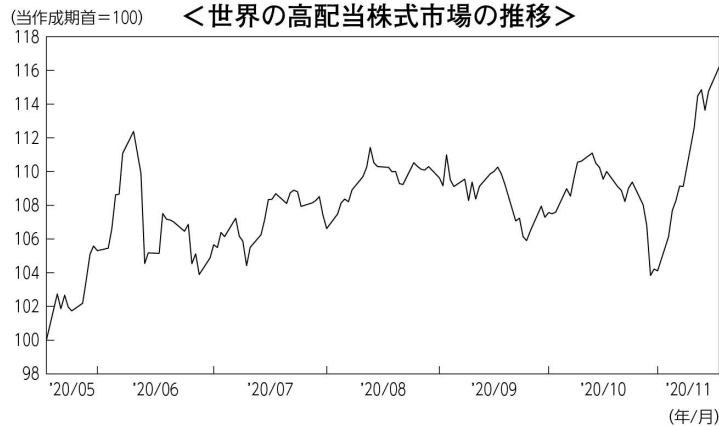
基準価額は、当作成期首12,656円から当作成期末には14,920円となりました。

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

○投資環境

<世界の高配当株式市場>

世界の高配当株式市場の騰落は以下のようになりました。



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

世界の高配当株式市場は、各国で経済活動を段階的に再開させる動きが広がったことなどから、2020年6月初旬にかけて堅調に推移しました。その後は、新型コロナウイルスの感染再拡大が懸念され下落しましたが、ワクチン開発に対する期待の高まりや、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融緩和策の長期化観測などを背景に、再び上昇基調で推移しました。10月には欧米での新型コロナウイルスの新規感染者が急増したことなどから大きく下落しました。しかし、11月に、米国の大統領選挙を終え政策リスクが後退したことや新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などを受けて反発し、当作成期間では値上がりとなりました。

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

○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	95.7%
カバー率	44.5%
平均行使価格	99.0%
平均行使期間	25.6日
配当利回り（年率、米ドル為替取引後ベース）※	3.3%
プレミアム（年率）	5.7%

- ・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27.4%、欧州36.2%、アジア・太平洋32.1%となりました。同ポートフォリオにおける業種別比率上位は、当作成期末現在で、金融25.7%、生活必需品19.1%、通信10.8%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。

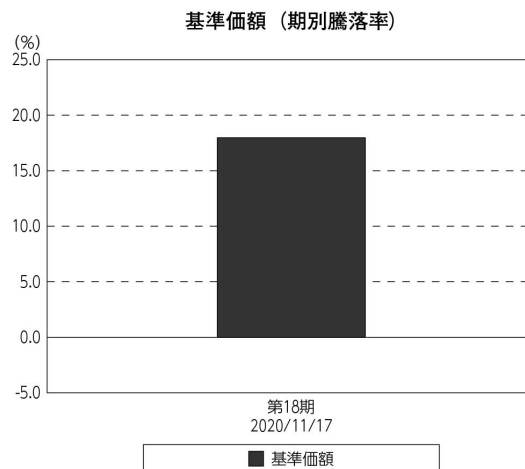
〔野村マネー マザーファンド〕

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 万口当たり・税込み)

項 目	第18期 2020年5月19日～ 2020年11月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.067%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	10,206

(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注意ください。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、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

(2020年5月19日～2020年11月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 66	% 0.485	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(26)	(0.193)	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)	(38)	(0.276)	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)	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	66	0.487	
期中の平均基準価額は、13,633円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

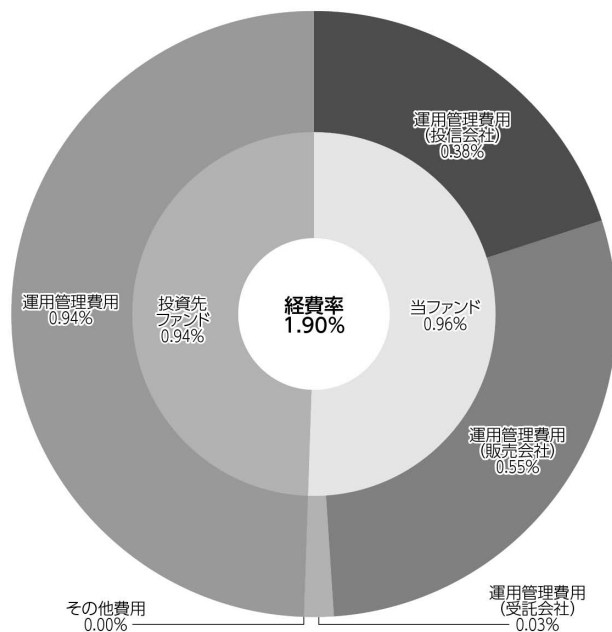
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.90%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	1.90
①当ファンドの費用の比率	0.96
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.94

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

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

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

○売買及び取引の状況

(2020年5月19日～2020年11月17日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅦー 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	口	千円	口	千円
		3,440	26,163	29,365	225,150

*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

(2020年5月19日～2020年11月17日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型>
該当事項はございません。

<野村マネー マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 3,439	百万円 100	% 2.9	百万円 —	百万円 —	% —

平均保有割合 0.0%

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

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

○組入資産の明細

(2020年11月17日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV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	124,133	98,208	786,547	99.0
合 計	124,133	98,208	786,547	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
	千口	千口	千円
野村マネー マザーファンド	983	983	1,002

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年11月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	786,547	98.3
野村マネー マザーファンド	1,002	0.1
コール・ローン等、その他	12,298	1.6
投資信託財産総額	799,847	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（2020年11月17日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	799,847,949
コール・ローン等	12,297,128
投資信託受益証券(評価額)	786,547,872
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,002,949
(B) 負債	5,468,084
未払収益分配金	532,427
未払解約金	990,561
未払信託報酬	3,931,739
未払利息	13
その他未払費用	13,344
(C) 純資産総額(A－B)	794,379,865
元本	532,427,008
次期繰越損益金	261,952,857
(D) 受益権総口数	532,427,008口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,920円

(注) 期首元本額は701,826,626円、期中追加設定元本額は7,782,704円、期中一部解約元本額は177,182,322円、1口当たり純資産額は1.4920円です。

○損益の状況（2020年5月19日～2020年11月17日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	34,524,409
受取配当金	34,526,456
支払利息	△ 2,047
(B) 有価証券売買損益	89,118,241
売買益	105,228,497
売買損	△ 16,110,256
(C) 信託報酬等	△ 3,945,083
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	119,697,567
(E) 前期繰越損益金	△ 78,899,241
(F) 追加信託差損益金	221,686,958
(配当等相当額)	(287,829,534)
(売買損益相当額)	(△ 66,142,576)
(G) 計(D＋E＋F)	262,485,284
(H) 収益分配金	△ 532,427
次期繰越損益金(G＋H)	261,952,857
追加信託差損益金	221,686,958
(配当等相当額)	(287,829,536)
(売買損益相当額)	(△ 66,142,578)
分配準備積立金	255,586,926
繰越損益金	△215,321,027

* 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（2020年5月19日～2020年11月17日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年5月19日～ 2020年11月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	33,424,397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	287,829,536円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	222,694,956円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	543,948,889円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	10,216円
g. 分配金	532,427円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細 （2020年11月17日現在）

<野村マネー マザーファンド>

下記は、野村マネー マザーファンド全体（6,430,760千口）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	890,000	893,217	13.6	—	—	—	13.6
	(890,000)	(893,217)	(13.6)	(—)	(—)	(—)	(13.6)
特殊債券 (除く金融債)	490,000	490,956	7.5	—	—	—	7.5
	(490,000)	(490,956)	(7.5)	(—)	(—)	(—)	(7.5)
金融債券	290,000	290,056	4.4	—	—	—	4.4
	(290,000)	(290,056)	(4.4)	(—)	(—)	(—)	(4.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	770,000	770,296	11.7	—	—	—	11.7
	(770,000)	(770,296)	(11.7)	(—)	(—)	(—)	(11.7)
合 計	2,440,000	2,444,526	37.3	—	—	—	37.3
	(2,440,000)	(2,444,526)	(37.3)	(—)	(—)	(—)	(37.3)

*（ ）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	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
神奈川県 公募（５年）第66回		0.101	200,000	200,019	2020/12/18
大阪府 公募第354回		1.03	100,000	100,990	2021/10/28
千葉県 公募平成22年度第9回		1.22	100,000	100,131	2020/12/25
共同発行市場地方債 公募第92回		1.03	190,000	190,057	2020/11/25
名古屋市中 公募第473回		1.29	100,000	100,109	2020/12/18
広島市中 公募平成23年度第2回		1.0	200,000	201,909	2021/10/25
小	計		890,000	893,217	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第126回		1.2	70,000	70,174	2021/ 1 /29
地方公共団体金融機構債券 第22回		1.34	100,000	100,471	2021/ 3 /26
都市再生債券 財投機関債第49回		1.46	50,000	50,198	2021/ 2 /26
関西国際空港社債 財投機関債第29回		1.538	70,000	70,086	2020/12/18
福祉医療機構債券 第53回財投機関債		0.001	200,000	200,025	2021/ 6 /18
小	計		490,000	490,956	
金融債券					
農林債券 利付第786回い号		0.25	100,000	100,005	2020/11/27
しんきん中金債券 利付第313回		0.225	190,000	190,050	2020/12/25
小	計		290,000	290,056	
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力 第485回		1.285	100,000	100,107	2020/12/18
北陸電力 第319回		0.17	100,000	100,013	2020/12/15
東北電力 第456回		1.176	170,000	170,048	2020/11/25
九州電力 第433回		0.375	200,000	200,018	2020/11/25
東海旅客鉄道 第81回社債間限定同順位特約付		0.02	100,000	100,003	2020/11/27
日本電信電話 第60回		1.31	100,000	100,106	2020/12/18
小	計		770,000	770,296	
合	計		2,440,000	2,444,526	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

Nomura Multi Managers Fund V – Global High Dividend Equity Premium

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

2019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	◆世界の高配当株を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。 ◆高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。		
投 資 態 度	●高配当株を上場市場や所在地、発行通貨等から、「米州」、「欧州」、「アジア・太平洋」の各地域に属する株式に分類します。 ●各地域の株式への投資比率は、原則として、下記の通りとします。		
	地域名	米州	欧州
	投資比率	25～50%	25～50%
	※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。 ●為替にかかる含み損益の状況によっては、一時的に上記のような運用ができない場合があります。 ●高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。 ※市場環境によっては、株式オプションのコール売り以外のオプション取引を行う場合があります。 ●株式プレミアム戦略によってさらなる収益の獲得を目指しますが、株価が権利行使価格を上回って値上がりした局面では、収益の一部を享受できない場合があります。 ●米ドル建て以外の資産に投資を行った場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行います。ファンドには2つのクラス(日本円クラス、通貨セレクトクラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、米ドルを売り、各クラスの通貨(通貨セレクトクラスについては、米ドル以外の選定通貨)を買う為替取引を行うことで、各通貨への投資効果を追求します。		
	<通貨セレクトクラスにおける通貨運用方針> ●原則として、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に(原則、毎月)見直すこととします。 ●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%～30%程度の範囲内に維持することを基本とします。 ●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。 ●投資顧問会社が、高配当株や株式オプションの運用を行う副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。 ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、高配当株や株式オプションの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およびファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行います。 ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。		
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー		
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社		
通 貨 運 用 会 社	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド		
管理事務代行会社 保 管 銀 行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー		

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

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

純資産計算書
2019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			644, 053, 540
<i>(取得原価 : 639, 991, 851米ドル)</i>			
投資オプション契約時価(買い)			78, 968
<i>(取得原価 : 323, 532米ドル)</i>			
現金預金等			62, 379, 682
外国為替先渡し契約に係る評価差益			3, 104, 302
ブローカーからの未収金			1, 130, 419
未収収益			1, 545, 640
現金および現金等価物に係る利息			9, 810
資産合計			712, 302, 361
負債			
投資オプション契約時価(売り)			4, 857, 379
<i>(取得原価 : 3, 885, 053米ドル)</i>			
銀行借越金			3, 707, 698
受益証券買戻支払金			3, 658, 842
ブローカーへの未払金			846, 592
未払費用			2, 112, 082
負債合計			15, 182, 593
純資産総額			697, 119, 768

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)	8, 951	375, 596	3, 361, 982, 245
通貨セレクトクラス(円)	3, 208	19, 117, 107	61, 333, 117, 571

運用計算書
2019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	1,636,635
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	26,801,091
雑収益	288
収益合計	28,438,014
費用	
投資顧問報酬	7,404,771
事務管理代行報酬	812,702
保管費用	244,354
当座借越利息	165,080
取引銀行報酬	125,012
銀行手数料	94,555
受託報酬	162,704
法務報酬	7,682
立替費用	162,506
専門家報酬	51,799
譲渡益税	33,515
雑費用	188,840
費用合計	9,453,520
純投資損益	18,984,494
投資有価証券売買に係る損益	14,108,375
オプション契約に係る損益	5,746,671
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	39,826,989
当期実現純損益	59,682,035
投資有価証券評価損益の増減	(76,483,062)
オプション契約に係る評価損益の増減	27,316
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	9,630,424
当期評価差損益	(66,825,322)
運用の結果による純資産の増減額	11,841,207

純資産変動計算書
2019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	985,326,827
純投資損益	18,984,494
当期実現純損益	59,682,035
当期評価差損益	(66,825,322)
運用の結果による純資産の増減額	11,841,207
受益証券の発行手取金	19,514,502
受益証券の買戻支払金	(200,814,314)
	(181,299,812)
受益者への支払分配金	(118,748,454)
期末純資産総額	697,119,768

発行済受益証券数の変動表
2019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	390,075
発行受益証券数	38,610
買戻受益証券数	(53,089)
期末発行済受益証券数	<u><u>375,596</u></u>

通貨セレクトクラス

期首受益証券数	23,904,528
発行受益証券数	221,725
買戻受益証券数	(5,009,146)
期末発行済受益証券数	<u><u>19,117,107</u></u>

統計情報
2019年9月30日現在
(未監査)

	2019	2018	2017
期末純資産総額(米ドル)	697,119,768	985,326,827	1,777,281,949
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	3,361,982,245	3,897,801,215	5,166,277,871
期末1口当たり純資産価格	8,951	9,992	10,129
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	61,333,117,571	93,578,949,254	176,198,062,233
期末1口当たり純資産価格	3,208	3,915	4,725

組入資産明細
2019年9月30日現在
(金額は米ドル表示)

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
オーストラリア					
普通株式					
	4,960,118	SOUTH32 LTD	10,825,375	8,707,105	1.26
	308,982	BHP BILLITON (AUD) *	7,312,884	7,662,964	1.11
	140,093	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA *	8,005,760	7,648,036	1.10
	47,167	CSL LTD	6,214,934	7,444,565	1.07
	367,348	WESTPAC BANKING CORP	8,132,202	7,353,884	1.05
	229,352	NTL AUSTRALIA BANK LTD *	4,613,439	4,600,658	0.66
	50,642	MACQUARIE GROUP LTD	4,353,446	4,483,407	0.64
	361,859	TRANSURBAN GROUP	3,406,059	3,590,229	0.52
	173,183	ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,623,520	3,579,214	0.51
	55,047	RIO TINTO LTD	3,431,475	3,445,353	0.49
	1,484,797	MIRVAC GROUP	2,875,296	3,068,665	0.44
	111,796	WOOLWORTHS GROUP	2,368,593	2,814,901	0.40
	116,260	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING *	2,533,987	2,239,447	0.32
	418,462	SANTOS LTD	2,104,380	2,184,723	0.31
	244,522	BRAMBLES LTD	2,185,503	1,882,711	0.27
	25,305	REA GROUP LTD	1,627,745	1,849,587	0.27
	223,950	BLUESCOPE STEEL LTD	2,488,087	1,816,582	0.26
	1,275,125	CLEANAWAY WASTE	1,821,884	1,679,377	0.24
	194,196	NORTHERN STAR RE	1,082,260	1,448,006	0.21
	65,269	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	1,711,491	1,427,397	0.20
	57,584	NEWCREST MINING LTD	1,114,101	1,351,505	0.19
	122,064	COMPUTERSHARE LIMITED	1,643,693	1,331,438	0.19
	170,489	WEBJET LTD	1,866,015	1,256,267	0.18
	168,525	OZ MINERALS LTD	1,119,022	1,093,827	0.16
	68,033	CORPORATE TRAVEL	1,104,155	867,526	0.12
	65,092	GOODMAN GROUP STAPLED	624,781	623,397	0.09
	88,311	THE STAR ENTERTAINMENT GROUP LTD	329,496	260,053	0.04
	50,802	TPG TELECOM LTD	274,981	238,123	0.03
			87,794,564	85,948,947	12.33
		合計：オーストラリア	87,794,564	85,948,947	12.33
ベルギー					
普通株式					
	84,996	AGEAS NV	3,028,802	4,734,956	0.68
			3,028,802	4,734,956	0.68
		合計：ベルギー	3,028,802	4,734,956	0.68

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
バミューダ諸島					
普通株式	150,000	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	1,332,151	1,009,144	0.15
	500,000	K WAH INTL HLDGS	296,465	264,003	0.04
	100,000	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE	67,463	86,343	0.01
			1,696,079	1,359,490	0.20
		合計：バミューダ諸島	1,696,079	1,359,490	0.20
ブラジル					
普通株式	352,938	ITAU UNIBANCO HOLDING SA SP ADR	2,097,754	2,992,915	0.43
	93,627	PETROLEO BRASILEIRO S.A ADR	842,680	1,352,910	0.19
	161,675	BANCO BRADESCO SPONSORED ADR	790,001	1,324,118	0.19
			3,730,435	5,669,943	0.81
		合計：ブラジル	3,730,435	5,669,943	0.81
カナダ					
普通株式	30,105	SUNCOR ENERGY	982,302	956,586	0.14
			982,302	956,586	0.14
		合計：カナダ	982,302	956,586	0.14
ケイマン諸島					
普通株式	220,000	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,626,909	1,941,637	0.28
	350,000	SHIMAO PROPERTY HOLDING LTD	760,365	1,022,216	0.15
	550,000	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	598,199	605,358	0.09
	110,000	SANDS CHINA LTD	540,469	498,035	0.07
	800,000	LEE & MAN MANUFACT LTD (HKD)	623,545	432,608	0.06
	620,000	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS LTD	777,545	416,717	0.06
	300,000	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	167,418	309,152	0.04
	150,000	CHINA AOYUAN GRO	188,510	169,880	0.02
			6,282,960	5,395,603	0.77
		合計：ケイマン諸島	6,282,960	5,395,603	0.77
中国					
普通株式	5,500,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	4,271,693	4,194,719	0.60
	3,400,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	2,219,642	2,276,550	0.33

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	2,300,000	BANK OF CHINA LTD H	1,067,409	903,478	0.13
	1,200,000	CHINA PETROL & CHEM CORP SINOPEC H	825,623	713,192	0.10
	800,000	PETROCHINA-H	468,045	411,182	0.06
	284,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	315,855	360,759	0.05
	300,000	DONGFENG MOTOR-H	297,552	285,047	0.04
			9,465,819	9,144,927	1.31
		合計：中国	9,465,819	9,144,927	1.31
		チェコ			
普通株式	1,882	PHILIP MORRIS CR AS	929,018	1,087,746	0.16
			929,018	1,087,746	0.16
		合計：チェコ	929,018	1,087,746	0.16
		フランス			
普通株式	121,079	SANOFI	10,253,485	11,248,401	1.62
	80,256	BNP PARIBAS	4,518,689	3,908,747	0.56
	78,168	PUBLICIS GROUPE	4,276,522	3,857,917	0.55
	265,847	COFACE SA	2,254,223	3,023,595	0.43
	23,710	SANOFI- ADR	1,112,397	1,098,010	0.16
			22,415,316	23,136,670	3.32
		合計：フランス	22,415,316	23,136,670	3.32
		ドイツ			
普通株式	21,185	ALLIANZ AG HOLDING REG	4,932,895	4,938,242	0.71
	34,994	CONTINENTAL A. G.	4,871,516	4,492,067	0.64
	38,150	SIEMENS AG- ADR	2,195,533	2,035,684	0.29
			11,999,944	11,465,993	1.64
		合計：ドイツ	11,999,944	11,465,993	1.64
		香港			
普通株式	183,000	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	2,544,973	2,632,686	0.39
	1,250,000	CNOOC LTD	1,898,477	1,906,691	0.27
	230,000	CHINA MOBILE LTD	2,017,502	1,902,291	0.27
	580,000	CHINA OVERSEAS LAND&INVEST LTD	1,831,249	1,823,408	0.26
	110,000	AIA GROUP LTD	620,608	1,038,859	0.15
	90,000	LINK REAL ESTATE INVEST TRUST	867,460	892,308	0.14
	240,000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	785,272	814,202	0.12

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
	320,000	HANG LUNG PROPERTIES LTD	762,768	726,456	0.10
	290,000	GUANGDONG INVESTMENT LTD	431,627	567,365	0.08
	280,000	SINO LAND	514,521	420,671	0.06
	260,000	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING CO LTD	455,450	391,286	0.06
			12,729,907	13,216,223	1.90
	合計：香港		12,729,907	13,216,223	1.90
		アイルランド			
普通株式	164,655	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	2,344,170	2,764,630	0.40
	23,263	MEDTRONIC PLC	1,524,726	2,516,359	0.36
	11,907	WILLIS TOWERS WA	2,093,897	2,307,100	0.33
			5,962,793	7,588,089	1.09
	合計：アイルランド		5,962,793	7,588,089	1.09
		イタリア			
普通株式	743,341	ENI SPA	11,984,930	11,424,747	1.64
	2,665,410	BANCA INTESA SPA	6,473,359	6,339,892	0.91
			18,458,289	17,764,639	2.55
	合計：イタリア		18,458,289	17,764,639	2.55
		日本			
普通株式	47,000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	1,654,204	1,610,021	0.24
	50,000	SUBARU CORP	1,610,672	1,409,168	0.20
	42,000	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	1,116,456	1,365,150	0.20
	28,000	NIPPON TELG & TEL CORP NTT	1,041,006	1,338,413	0.19
	50,000	JAPAN TOBACCO INC	1,641,482	1,096,741	0.16
	47,000	KOMATSU LTD	1,101,255	1,078,431	0.15
	52,000	ITOCHU CORP	702,931	1,075,529	0.15
	16,000	TOYOTA MOTOR CORP	983,473	1,070,374	0.15
	210,000	JXTG HOLDINGS	962,355	958,642	0.14
	69,000	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	896,371	916,353	0.13
	180,000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	1,028,230	915,143	0.13
	17,000	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	600,085	910,795	0.13
	56,000	ASTELLAS PHARMA INC	760,542	798,739	0.11
	4,100	TOKYO ELECTRON LTD	444,751	781,685	0.11
	20,000	HITACHI LTD	649,814	745,932	0.11
	38,000	YAMAHA MOTOR CO LTD	956,135	689,788	0.10
	26,000	HONDA MOTOR CO LTD	743,879	674,556	0.10

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
14,000	MURATA MANUFACTURING CO LTD	623,591	672,970	0.10
43,000	ORIX CORP	664,044	642,219	0.09
39,000	mitsui & CO LTD	560,815	639,243	0.09
25,000	NTT DOCOMO	523,945	638,066	0.09
7,000	TDK CORP	492,251	627,543	0.09
31,000	NGK SPARK PLUG CO LTD	631,583	591,461	0.08
29,000	HITACHI CAPITAL	611,906	590,135	0.08
50,000	ISUZU MOTORS LTD	608,573	551,847	0.08
35,000	SUMITOMO CORP	536,938	547,721	0.08
13,000	PIGEON CORP	474,995	536,921	0.08
35,000	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	680,228	528,577	0.08
17,000	AGC INC	675,116	527,974	0.08
32,500	RESORTTRUST INC	533,568	526,677	0.08
38,200	SOFTBANK CORP	487,556	518,470	0.07
7,000	KAO CORP	382,391	518,129	0.07
8,000	DAIICHI SANKYO CO LTD	225,856	504,630	0.07
20,000	mitsubishi CORP	477,295	491,540	0.07
4,500	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	361,902	482,269	0.07
43,000	SANWA HOLDINGS CORP	426,703	481,565	0.07
95,000	CITIZEN WATCH CO LTD	457,069	465,025	0.07
9,000	NIPPON EXPRESS	543,975	459,741	0.07
13,000	DENTSU	561,024	458,582	0.07
55,000	PANASONIC CORP	520,963	446,465	0.06
13,000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	556,196	444,722	0.06
70,000	NISSAN MOTOR CO LTD	681,765	437,463	0.06
14,000	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	421,785	434,413	0.06
12,000	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	459,674	433,430	0.06
9,000	TREND MICRO INC	420,307	428,869	0.06
22,000	KYOWA KIRIN CO LTD	413,570	427,905	0.06
16,000	KDDI CORP	409,032	419,042	0.06
17,000	KYOWA EXEO CORP	340,961	412,923	0.06
18,000	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT CO	491,592	411,347	0.06
5,000	FUJITSU LTD	321,283	401,196	0.06
18,000	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	460,697	401,168	0.06
15,000	CANON INC	472,278	400,848	0.06
1,800	HIKARI TSUSHIN INC	187,765	390,154	0.06
15,000	WACOAL HOLDINGS CORP	429,779	386,177	0.06
8,000	NITTO DENKO CORP	569,300	385,964	0.06
27,000	NGK INSULATORS LTD	547,499	385,231	0.06
33,000	HASEKO CORP	393,483	384,870	0.06
3,000	DAITO TRUST CONSTRUCTION CO LTD	410,183	384,091	0.06
27,000	STAR MICRONICS CO LTD	371,742	383,229	0.05

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
10,000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	440,373	383,071	0.05
40,000	SHIKOKU ELEC PWR	419,784	377,880	0.05
14,000	AZBIL CORP	231,044	374,968	0.05
19,000	SEKISUI HOUSE LTD	297,636	374,310	0.05
65,000	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	348,627	360,358	0.05
9,000	MITSUBISHI HEAVY IND LTD	457,108	353,108	0.05
12,300	IDEMITSU KOSAN CO LTD	450,161	348,366	0.05
12,500	DENKA CO LTD	343,645	344,296	0.05
44,000	NISSHINBO HOLDINGS INC	354,921	343,466	0.05
21,000	JSR CORPORATION	405,696	336,615	0.05
15,000	mitsui chemicals inc	444,372	335,975	0.05
12,000	DIC CORP	433,423	333,528	0.05
33,000	OBAYASHI CORP	368,206	329,189	0.05
11,000	JAPAN AIRLINES	367,443	327,557	0.05
30,000	AMADA HOLDINGS CO LTD	344,811	323,738	0.05
10,000	aisin seiki co ltd	444,551	314,745	0.05
5,000	KYOCERA CORP	322,660	310,805	0.04
7,000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	301,703	307,607	0.04
70,000	MITSUBISHI MOTORS CORP	517,119	304,362	0.04
16,000	RYOHIN KEIKAKU CO LTD	296,566	299,337	0.04
8,000	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	284,538	297,409	0.04
21,000	USHIO INC	274,003	297,093	0.04
5,000	HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CORP	211,309	289,250	0.04
45,000	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	255,435	287,442	0.04
40,000	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	246,473	285,579	0.04
8,900	TSUBAKIMOTO CHAIN CO	388,575	285,074	0.04
20,000	SEIKO EPSON CORP	398,390	281,834	0.04
10,000	HANWA CO LTD	352,005	273,861	0.04
14,000	USS CO LTD	250,609	272,173	0.04
10,000	SATO HOLDINGS CORP	219,639	270,523	0.04
23,000	J.FRONT RETAILING CO LTD	260,795	269,522	0.04
8,000	HITACHI CHEMICAL CO LTD	206,762	261,438	0.04
50,000	CHIBA BANK LTD	346,931	257,729	0.04
3,000	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	200,880	253,956	0.04
18,000	SUMCO CORP	209,323	241,969	0.03
22,000	K'S HOLDINGS CORP	251,748	239,855	0.03
4,000	TECHNOPRO HOLDINGS INC	191,186	237,334	0.03
19,000	RELIA INC	202,743	237,093	0.03
4,000	SCREEN HOLDINGS CO LTD	220,264	236,221	0.03
13,000	BROTHER INDS LTD	228,684	235,739	0.03
130,000	NIPPON LIGHT METAL HLDG CO LTD	306,652	233,811	0.03
3,000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	161,713	233,625	0.03

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
13,000	LIXIL GROUP CORPORATION	238,339	228,990	0.03
12,000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	292,764	227,061	0.03
26,000	NSK LIMITED	231,189	219,348	0.03
20,000	HITACHI METALS LTD	246,183	216,196	0.03
17,000	TOYO TIRE CORP	228,508	215,288	0.03
11,000	EXEDY CORP	312,835	215,074	0.03
9,000	PARK24 CO LTD	222,720	209,261	0.03
42,000	YAMADA DENKI CO LTD	216,272	203,643	0.03
26,000	SENKO GROUP HOLDINGS	188,283	202,716	0.03
9,000	POLA ORBIS HOLDINGS INC	301,329	201,836	0.03
4,000	MEITEC CORPORATION	172,599	196,171	0.03
8,000	STARTS CORP INC	177,068	195,652	0.03
6,000	NIHON UNISYS LTD	94,165	193,575	0.03
16,000	JFE HOLDINGS INC	357,319	192,834	0.03
6,000	ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP	97,122	159,199	0.02
2,000	SHIMAMURA CORP	203,310	158,717	0.02
9,500	KYORIN HLDGS	171,932	157,563	0.02
4,000	NIPPON STEEL TRA	184,886	156,677	0.02
12,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	158,037	154,526	0.02
10,000	JAPAN POST INSURANCE CO LTD	222,801	151,115	0.02
3,000	SCSK CORP	147,286	141,010	0.02
31,000	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	140,290	139,387	0.02
4,000	TAIYO HOLDINGS CO LTD	173,569	134,798	0.02
35,000	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	139,882	134,335	0.02
4,000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	129,519	129,792	0.02
3,000	SOMPO HOLDINGS INC	94,455	125,629	0.02
3,000	OTSUKA CORP	99,972	119,733	0.02
23,000	ONWARD HOLDINGS	163,271	119,622	0.02
8,000	KONOIKE TRANSPORT CO LTD	120,503	118,296	0.02
3,000	DAIDO STEEL CO LTD	111,309	117,786	0.02
4,000	UTD ARROWS LIMITED	114,125	117,183	0.02
9,000	SUMITOMO ELECTRIC IND LTD	129,165	114,393	0.02
3,000	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	110,714	112,363	0.02
8,000	OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD	110,465	109,099	0.02
5,000	SONY FINANCIAL HOLDINGS INC	83,838	108,562	0.02
25,000	RESONA HOLDINGS INC	118,434	107,310	0.02
4,000	CAPCOM CO LTD	85,124	106,170	0.02
20,000	OJI HOLDINGS CORPORATION	94,441	93,450	0.01
9,000	SAKATA INX CORP	131,876	93,367	0.01
1,500	HORIBA LTD	76,245	86,775	0.01
合計：日本		57,265,469	56,382,585	8.09

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
ジャージー					
普通株式	312,700	WPP PLC ORD GBP 0.1	3,954,285	3,906,300	0.56
			3,954,285	3,906,300	0.56
		合計：ジャージー	3,954,285	3,906,300	0.56
ルクセンブルグ					
普通株式	154,379	RTL GROUP	10,704,636	7,428,471	1.07
			10,704,636	7,428,471	1.07
		合計：ルクセンブルグ	10,704,636	7,428,471	1.07
オランダ					
普通株式	658,419	ING GROEP NV - CVA	9,239,027	6,882,930	0.99
	86,081	KONINKLIJKE P-NY	3,192,211	3,971,777	0.57
	122,164	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	2,736,601	3,080,115	0.44
	37,779	UNILEVER NV NY SHS	2,191,446	2,270,518	0.33
	47,288	AKZO NOBEL- ADR	1,298,127	1,403,508	0.20
			18,657,412	17,608,848	2.53
		合計：オランダ	18,657,412	17,608,848	2.53
ニュージーランド					
普通株式	234,882	A2 MILK CO LTD	2,210,027	1,929,053	0.28
	20,063	XERO LTD	754,621	844,064	0.12
			2,964,648	2,773,117	0.40
		合計：ニュージーランド	2,964,648	2,773,117	0.40
ノルウェー					
普通株式	284,809	DNB ASA	4,365,231	5,045,670	0.72
			4,365,231	5,045,670	0.72
		合計：ノルウェー	4,365,231	5,045,670	0.72
パプアニューギニア					
普通株式	101,762	OIL SEARCH LTD	596,786	503,104	0.07
			596,786	503,104	0.07
		合計：パプアニューギニア	596,786	503,104	0.07

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
ポーランド					
普通株式	2,720,089	ORANGE POLSKA SA	6,596,413	3,746,583	0.53
	1,381,668	PGE POLSKA GRUPA ENERGA SA	6,257,976	2,690,554	0.39
			12,854,389	6,437,137	0.92
		合計：ポーランド	12,854,389	6,437,137	0.92
韓国					
普通株式	145,000	SAMSUNG ELECT CO LTD N/VOTING SHS	4,601,261	4,781,002	0.69
	18,000	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	1,746,101	1,585,181	0.23
	120,000	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	853,510	1,176,990	0.17
	12,000	DB INSURANCE CO LTD	578,298	516,874	0.07
	3,500	LG CHEM LTD PREFERENCE	680,856	489,369	0.07
	30,000	POSCO INTERNATIO	472,913	478,309	0.07
	7,000	HYUNDAI MOTOR CO LTD PREFERENCE	566,474	446,422	0.06
	5,000	WOONGJIN COWAY C	412,213	353,097	0.05
	1,500	SK TELECOM CO LTD	379,706	302,386	0.04
			10,291,332	10,129,630	1.45
		合計：韓国	10,291,332	10,129,630	1.45
ロシア					
普通株式	80,651	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,595,671	6,713,389	0.96
	868,785	GAZPROM- ADR	4,189,673	6,046,744	0.87
			8,785,344	12,760,133	1.83
		合計：ロシア	8,785,344	12,760,133	1.83
シンガポール					
普通株式	140,051	DBS GROUP HOLDING LTD	2,013,274	2,533,572	0.37
	110,008	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	1,888,515	2,042,623	0.29
	850,000	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST REIT	1,083,081	1,273,200	0.18
	160,088	OVERSEAS CHINESE BANKING CORP LTD	1,156,033	1,258,044	0.18
	500,000	SINGAPORE TELECOM 1000	1,511,796	1,121,602	0.16
	310,000	SINGAPORE TECH ENGINEERING	834,646	861,391	0.12
	140,000	KEPPEL CORP LTD	640,899	600,745	0.09
	350,000	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	397,985	579,977	0.08
	250,000	YANLORD LAND GRO	239,179	211,657	0.03
			9,765,408	10,482,811	1.50
		合計：シンガポール	9,765,408	10,482,811	1.50

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

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
		スペイン			
普通株式					
	489,105	REPSOL SA	9,536,284	7,651,534	1.10
			9,536,284	7,651,534	1.10
		合計：スペイン	9,536,284	7,651,534	1.10
		スイス			
普通株式					
	71,229	SWISS RE AG	6,172,846	7,463,795	1.06
	55,754	NOVARTIS AG-SPONSORED ADR	3,782,873	4,846,695	0.70
	203,020	ABB LTD SPON ADR	4,634,931	3,986,298	0.57
	25,694	ALCON INC	1,324,764	1,503,870	0.22
			15,915,414	17,800,658	2.55
		合計：スイス	15,915,414	17,800,658	2.55
		台湾			
普通株式					
	760,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	3,479,327	6,659,542	0.95
	700,000	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	2,438,975	1,650,711	0.24
	1,000,000	CATHAY FINANCIAL HOLDINGS	1,602,297	1,317,605	0.19
	400,000	FORMOSA PLASTICS CORP	1,360,847	1,217,737	0.17
	360,000	TAIWAN SECOM	1,029,582	1,020,580	0.15
	680,000	WPG HOLDINGS CO LTD	883,955	836,824	0.12
	450,000	CTCI CORP	672,749	604,520	0.09
	750,000	TECO ELECTRIC & MACHINERY CO LTD	490,329	604,036	0.09
	160,000	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	516,568	572,143	0.08
	140,000	TONG HSING ELECTRONIC INDUSTRIES LT	395,432	568,277	0.08
	50,000	EGIS TECH	375,876	426,852	0.06
	150,000	NANYA TECHNOLOGY	316,115	388,999	0.06
	350,000	E INK HOLDINGS	550,117	317,401	0.05
	20,000	WIWYNN CORP	235,203	284,461	0.04
	20,000	KING SLIDE WORKS CO LTD	233,656	227,440	0.03
	40,000	WALSIN TECH	203,705	224,863	0.03
	140,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR CO LTD	373,401	206,113	0.03
			15,158,134	17,128,104	2.46
ライツ					
	71,468	WPG HOLDINGS CO RTS	0	0	0.00
			0	0	0.00
		合計：台湾	15,158,134	17,128,104	2.46

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
タイ					
普通株式	2,600,000	DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F	909,704	1,480,078	0.21
	230,000	TISCO FINANCIAL GROUP PUB CO NVDR	438,218	771,283	0.11
	345,000	PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC CO LTD F	590,315	606,680	0.09
			1,938,237	2,858,041	0.41
		合計：タイ	1,938,237	2,858,041	0.41
トルコ					
普通株式	2,416,410	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	5,823,290	2,510,273	0.36
			5,823,290	2,510,273	0.36
		合計：トルコ	5,823,290	2,510,273	0.36
イギリス					
普通株式	4,219,868	MORRISON WM SUPERMARKETS PLC	12,108,284	10,496,547	1.50
	443,849	ANGLO AMER PLC	9,160,495	10,248,430	1.47
	3,482,214	RBS GROUP	12,142,679	8,897,126	1.28
	2,973,717	TESCO PLC	8,956,647	8,892,879	1.28
	982,909	STANDARD CHARTERED PLC	10,356,389	8,277,668	1.19
	8,373,751	CENTRICA PLC	24,356,595	7,657,736	1.10
	822,422	PEARSON PLC	8,444,539	7,470,406	1.07
	881,911	HSBC HOLDINGS PLC	7,749,221	6,782,683	0.97
	10,099,747	LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,911,819	6,756,278	0.97
	966,184	BP PLC	6,332,999	6,140,052	0.88
	116,421	BP PLC- ADR	4,896,664	4,449,611	0.64
	1,960,575	BARCLAYS PLC	3,713,251	3,624,935	0.52
	61,159	BAE SYSTEMS - ADR	1,664,987	1,734,255	0.25
			117,794,569	91,428,606	13.12
		合計：イギリス	117,794,569	91,428,606	13.12
アメリカ					
普通株式	75,140	APPLE INC *	8,536,193	16,662,294	2.38
	165,565	VERIZON COMMUNICATIONS INC	8,148,859	10,048,140	1.43
	195,565	CISCO SYSTEMS INC *	5,186,158	9,621,798	1.38
	169,678	COMCAST CORP A *	5,488,342	7,611,755	1.09
	135,577	ORACLE CORP *	5,440,251	7,403,860	1.06
	52,727	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,428,781	7,188,799	1.03

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
178,525	PFIZER INC *	5,580,618	6,462,605	0.93
48,632	JPMORGAN CHASE & CO *	2,868,082	5,721,555	0.82
114,945	FIRSTENERGY CORP	3,630,551	5,577,131	0.80
339,131	AES CORP *	4,293,253	5,544,792	0.80
72,108	QUALCOMM INC	4,559,244	5,529,963	0.79
72,821	CITIGROUP INC	3,815,436	5,034,116	0.72
78,017	KELLOGG CO	5,014,202	4,987,627	0.72
90,900	WELLS FARGO & CO	5,109,409	4,579,542	0.66
77,199	MOLSON COORS BREWING CO	5,361,344	4,455,926	0.64
158,031	CORTEVA INC	4,461,779	4,410,645	0.63
88,151	EXELON CORP	2,956,735	4,292,072	0.62
169,127	WILLIAMS COS INC	4,720,901	4,089,491	0.59
106,076	AT&T INC	3,238,312	4,007,551	0.57
33,549	LOWE'S COMPANIES INC	2,621,057	3,682,003	0.53
37,832	BAXTER INTL INC	1,531,270	3,295,167	0.47
124,737	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS INC	3,154,529	3,193,267	0.46
52,084	CONOCOPHILLIPS	2,408,939	2,994,830	0.43
21,695	PEPSICO INC	2,572,174	2,964,839	0.43
68,195	MORGAN STANLEY	3,226,341	2,910,563	0.42
48,010	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	1,876,608	2,907,486	0.42
16,731	LABORATORY CP	2,789,502	2,782,198	0.40
57,474	METLIFE INC	2,603,406	2,716,221	0.39
123,767	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2,655,984	2,667,179	0.38
17,010	HUBBELL INC	1,893,321	2,257,737	0.32
52,890	MASCO CORP	1,639,371	2,199,695	0.32
67,379	CONAGRA BRANDS INC	1,522,817	2,058,428	0.30
123,337	REGIONS FINANCIAL CORP	1,316,285	1,957,358	0.28
34,136	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,112,233	1,902,741	0.27
36,220	BRISTOL MYERS SQUIBB CO	1,686,574	1,857,362	0.27
41,576	E*TRADE FINANCIAL CORP	1,659,443	1,793,589	0.26
28,609	MARATHON PETROLEUM CORP	1,192,229	1,761,170	0.25
7,527	BIOGEN INC	2,335,573	1,744,909	0.25
18,694	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,471,899	1,703,210	0.24
13,834	DOLLAR TREE INC	1,311,711	1,595,475	0.23
24,456	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,992,884	1,345,080	0.19
33,460	GENERAL MOTORS CO	1,347,277	1,243,708	0.18
31,992	QUANTA SERVICES	1,212,767	1,196,501	0.17
17,464	COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP A	1,115,857	1,037,362	0.15
46,091	AXA EQUITABLE HO	944,866	1,036,126	0.15
106,525	FREEPORT MCMORAN INC	1,490,144	1,021,575	0.15
15,976	KOHL'S CORP	793,986	793,368	0.11
16,450	ALTRIA GROUP INC	676,493	667,706	0.10

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
6,163	PACKAGING CORP OF AMERICA	448,844	651,491	0.09
7,665	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	684,921	580,700	0.08
		148,144,755	183,748,706	26.35
	合計：アメリカ	148,144,755	183,748,706	26.35
	組入資産合計	639,991,851	644,053,540	92.39

* 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

2019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

2019年9月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD	65,165	JPY	6,956,400	2019年10月10日	627
USD	31,584	JPY	3,371,670	2019年10月10日	304
USD	18,798	JPY	2,015,000	2019年10月10日	104
USD	18,817	JPY	2,015,000	2019年10月25日	103
USD	8,768	JPY	936,000	2019年10月10日	84
USD	40,297	JPY	4,345,000	2019年10月10日	(13)
USD	40,338	JPY	4,345,000	2019年10月25日	(17)
INR	5,303,000,000	USD	73,585,324	2019年11月22日	966,235
IDR	949,000,000,000	USD	65,971,498	2019年10月25日	748,760
MXN	1,010,000,000	USD	50,529,054	2019年11月4日	412,860
BRL	478,400,000	USD	114,405,969	2019年11月4日	309,936
INR	1,740,000,000	USD	24,314,750	2019年10月25日	218,421
MXN	50,000,000	USD	2,471,522	2019年11月4日	50,355
ZAR	37,000,000	USD	2,399,156	2019年10月25日	28,306
INR	80,000,000	USD	1,108,417	2019年10月25日	19,545
IDR	911,700,000,000	USD	64,412,886	2019年11月22日	(492,942)
ZAR	1,125,000,000	USD	74,407,714	2019年10月25日	(599,714)
MXN	1,370,000,000	USD	69,629,742	2019年12月3日	(830,251)
ZAR	461,000,000	USD	31,254,237	2019年11月22日	(1,114,587)
JPY	1,597,627,192	USD	14,805,249	2019年10月25日	33,179
JPY	1,040,000	USD	9,655	2019年10月25日	4
JPY	1,040,000	USD	9,645	2019年10月10日	3
JPY	65,000	USD	604	2019年10月10日	(2)
JPY	265,000	USD	2,475	2019年10月10日	(17)
JPY	480,000	USD	4,494	2019年10月10日	(41)
JPY	730,000	USD	6,838	2019年10月10日	(66)
JPY	1,485,000	USD	13,904	2019年10月10日	(128)
JPY	2,825,000	USD	26,451	2019年10月10日	(243)
JPY	6,385,000	USD	60,371	2019年10月10日	(1,134)
JPY	1,565,505,979	USD	14,812,199	2019年10月10日	(288,040)
USD	101,053,136	GBP	81,109,860	2019年10月17日	1,205,638
USD	83,767,120	EUR	75,482,576	2019年10月15日	1,120,306
USD	8,462,247	PLN	32,021,162	2019年10月16日	455,774

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	28,700,317	JPY	3,050,000,000	2019年10月11日	401,536
USD	5,394,185	NOK	45,989,059	2019年10月16日	327,408
USD	3,637,047	CZK	82,566,000	2019年10月16日	142,977
USD	7,062,508	CHF	6,894,520	2019年10月16日	105,630
USD	29,322,128	JPY	3,150,000,000	2019年10月25日	65,585
USD	10,084,457	KRW	12,000,000,000	2019年10月25日	60,218
USD	21,993,692	AUD	32,500,000	2019年10月31日	19,018
USD	21,993,335	AUD	32,500,000	2019年10月31日	18,661
USD	22,128,417	AUD	32,700,000	2019年10月31日	18,514
USD	21,991,092	AUD	32,500,000	2019年10月31日	16,418
USD	29,604,377	HKD	232,000,000	2019年10月11日	9,621
USD	336,509	CHF	330,667	2019年10月16日	2,852
USD	376,391	PLN	1,496,081	2019年10月16日	2,316
USD	252,206	KRW	300,000,000	2019年10月25日	1,601
USD	928,827	JPY	100,000,000	2019年10月11日	999
USD	403,646	CHF	399,262	2019年10月16日	773
THB	7,000,000	USD	228,414	2019年10月11日	601
THB	7,000,000	USD	228,500	2019年10月11日	515
THB	5,000,000	USD	163,079	2019年10月11日	503
CZK	6,140,560	USD	259,498	2019年10月16日	361
USD	893,090	HKD	7,000,000	2019年10月11日	146
HKD	5,000,000	USD	637,958	2019年10月11日	(141)
CZK	16,853,520	USD	713,960	2019年10月16日	(744)
USD	572,524	NOK	5,213,888	2019年10月16日	(1,908)
USD	3,498,675	THB	107,000,000	2019年10月11日	(1,987)
USD	257,429	TRY	1,474,458	2019年10月16日	(2,007)
SGD	1,600,000	USD	1,160,741	2019年10月11日	(2,805)
CZK	9,717,080	USD	415,819	2019年10月16日	(4,607)
NOK	4,337,626	USD	485,274	2019年10月16日	(7,383)
CHF	398,636	USD	411,043	2019年10月16日	(8,802)
CZK	10,140,680	USD	440,978	2019年10月16日	(11,840)
PLN	1,393,086	USD	361,364	2019年10月16日	(13,042)
CZK	15,022,320	USD	650,065	2019年10月16日	(14,343)
PLN	2,788,347	USD	713,184	2019年10月16日	(15,995)
USD	11,852,768	SGD	16,400,000	2019年10月11日	(16,084)
PLN	1,802,439	USD	475,383	2019年10月16日	(24,707)
USD	17,225,280	TWD	535,000,000	2019年10月25日	(36,774)
EUR	5,045,269	USD	5,588,536	2019年10月15日	(64,408)
USD	2,115,868	TRY	12,637,376	2019年10月16日	(107,723)
					3,104,302

注記２－オプション契約

2019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)
買い持ちポジション						
AUD	632	P AS51 6500 17/10/19	2019年10月17日	323,532	78,968	(244,564)
				323,532	78,968	(244,564)
売り持ちポジション						
USD	(9)	C CTVA UN 30 30/09/19	FLEX 2019年9月30日	(655)	0	655
USD	(9)	C CTVA UN 31.5 30/09/19	FLEX 2019年9月30日	(782)	0	781
SGD	(70,000)	C DBS SP 26.5636 01/10/19	OTC 2019年10月1日	(511)	0	511
USD	(56,300)	C ITUB UN 9.958 03/10/19	OTC 2019年10月3日	(19,643)	0	19,643
GBP	(128,212)	C PS0N LN 9.12683 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(6,092)	0	6,092
GBP	(199,281)	C S32 LN 1.67105 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(2,080)	0	2,080
USD	(87)	C UN UN 61.25 30/09/19	FLEX 2019年9月30日	(7,200)	0	7,200
SGD	(50,000)	C UOB SP 27.3056 01/10/19	OTC 2019年10月1日	(375)	0	375
HKD	(1,700,000)	C 1398 HK 5.6592 02/10/19	OTC 2019年10月2日	(510)	0	510
TWD	(650,000)	C 2317 TT 78.7611 01/10/19	OTC 2019年10月1日	(2,015)	0	2,015
JPY	(12,000)	C 7267 JT 3051.1886 01/10/19	OTC 2019年10月1日	(291)	0	291
JPY	(20,000)	C 8591 JT 1790.2954 02/10/19	OTC 2019年10月2日	(290)	0	290
JPY	(8,000)	C 8766 JT 6073.8308 01/10/19	OTC 2019年10月1日	(437)	0	437
HKD	(1,100,000)	C 883 HK 13.653 04/10/19	OTC 2019年10月4日	(660)	0	660
HKD	(1,800,000)	C 939 HK 6.4584 02/10/19	OTC 2019年10月2日	(720)	0	720
JPY	(11,000)	C 9432 JT 5392.2153 01/10/19	OTC 2019年10月1日	(320)	0	320
JPY	(8,000)	C 9432 JT 5505.8848 02/10/19	OTC 2019年10月2日	(235)	0	235
GBP	(54,792)	C AAL LN 20.43166 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(5,618)	(729)	4,888
GBP	(67,685)	C AAL LN 20.82556 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(17,548)	(20,343)	(2,795)
GBP	(59,031)	C AAL LN 22.01429 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(16,479)	(15,197)	1,282
GBP	(57,156)	C AAL LN 22.16922 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(17,711)	(10,852)	6,858
GBP	(69,149)	C AAL LN 23.05702 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(19,867)	(889)	18,978
USD	(3)	C AAPL UQ 212.5 04/10/19	2019年10月4日	(1,182)	(3,000)	(1,818)
USD	(57)	C AAPL UQ 215 11/10/19	2019年10月11日	(28,590)	(49,020)	(20,430)
USD	(39)	C AAPL UQ 220 18/10/19	2019年10月18日	(16,487)	(23,127)	(6,640)
USD	(77)	C AAPL UQ 225 08/11/19	2019年11月8日	(46,609)	(54,670)	(8,061)
USD	(69)	C AAPL UQ 227.5 25/10/19	2019年10月25日	(34,352)	(21,390)	12,962
USD	(17)	C AAPL UQ 230 01/11/19	2019年11月1日	(8,878)	(7,395)	1,483
USD	(33,400)	C ABB UN 18.594 18/10/19	OTC 2019年10月18日	(18,387)	(37,402)	(19,016)
USD	(299)	C ABB UN 20 15/11/19	2019年11月15日	(10,992)	(11,661)	(669)
USD	(28,000)	C ABB UN 20.463 25/10/19	OTC 2019年10月25日	(12,197)	(3,306)	8,891
EUR	(37,292)	C AD NA 21.3943 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(10,668)	(69,393)	(58,724)

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	(29,084)	C AD NA 22.644 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(3,134)	(14,860)	(11,726)
EUR	(28,158)	C AD NA 22.7537 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(7,943)	(25,730)	(17,787)
EUR	(27,630)	C AD NA 23.8287 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(10,328)	(12,746)	(2,419)
USD	(77,300)	C AES UN 15.186 03/10/19	OTC 2019年10月3日	(33,903)	(89,415)	(55,511)
USD	(3,400)	C AES UN 15.678 28/10/19	OTC 2019年10月28日	(1,076)	(2,831)	(1,754)
USD	(72,100)	C AES UN 15.95 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(37,579)	(46,763)	(9,184)
EUR	(25,026)	C AGS BB 50.6807 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(17,032)	(25,827)	(8,795)
EUR	(24,774)	C AGS BB 51.1837 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(15,990)	(29,573)	(13,583)
EUR	(17,932)	C AGS BB 53.0794 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(10,941)	(12,306)	(1,365)
EUR	(10,411)	C AGS BB 53.8261 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(6,092)	(6,207)	(115)
USD	(3)	C AIG UN 55 04/10/19	2019年10月4日	(266)	(483)	(217)
USD	(38)	C AIG UN 55 18/10/19	2019年10月18日	(6,071)	(7,334)	(1,263)
USD	(14)	C AIG UN 57.5 15/11/19	2019年11月15日	(2,089)	(1,988)	101
USD	(28)	C AIG UN 58 01/11/19	2019年11月1日	(4,249)	(2,548)	1,701
USD	(27)	C AIG UN 58 25/10/19	2019年10月25日	(2,910)	(1,620)	1,290
USD	(43)	C AIG UN 58.98 08/11/19	FLEX 2019年11月8日	(7,300)	(2,974)	4,326
USD	(40)	C ALC UN 60 15/11/19	2019年11月15日	(5,730)	(3,800)	1,930
USD	(75)	C ALC UN 60.11 18/10/19	FLEX 2019年10月18日	(12,931)	(1,551)	11,379
AUD	(18,174)	C ALL AT 30.7697 06/11/19	OTC 2019年11月6日	(7,278)	(10,768)	(3,491)
AUD	(19,003)	C ALL AT 30.8859 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(6,392)	(11,735)	(5,343)
AUD	(27,072)	C ALL AT 31.269 02/10/19	OTC 2019年10月2日	(8,205)	(471)	7,734
AUD	(23,997)	C ALL AT 31.5528 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(10,852)	(5,481)	5,371
AUD	(28,719)	C ALL AT 32.301 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(13,259)	(4,985)	8,274
EUR	(4,307)	C ALV GY 211.8884 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(11,445)	(28,060)	(16,615)
EUR	(3,487)	C ALV GY 214.5647 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(2,782)	(3,719)	(937)
EUR	(2,770)	C ALV GY 220.6575 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(7,052)	(8,611)	(1,559)
EUR	(4,461)	C ALV GY 221.3149 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(11,607)	(2,414)	9,193
EUR	(4,025)	C ALV GY 222.6544 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(9,780)	(11,611)	(1,831)
AUD	(24,936)	C ANZ AT 27.9285 16/10/19	OTC 2019年10月16日	(6,795)	(11,990)	(5,195)
AUD	(40,325)	C ANZ AT 28.0496 06/11/19	OTC 2019年11月6日	(8,039)	(21,970)	(13,931)
AUD	(39,680)	C A2M AT 13.9948 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(14,982)	(2,638)	12,344
AUD	(38,422)	C A2M AT 14.8355 06/11/19	OTC 2019年11月6日	(12,155)	(1,592)	10,563
AUD	(37,613)	C A2M AT 15.5559 09/10/19	OTC 2019年10月9日	(3,886)	(4)	3,882
GBP	(242,031)	C BARC LN 1.52147 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(1,872)	(4,820)	(2,948)
GBP	(298,980)	C BARC LN 1.57636 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(5,971)	(16,142)	(10,171)
GBP	(270,506)	C BARC LN 1.70193 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(5,470)	(6,715)	(1,245)
GBP	(279,381)	C BARC LN 1.72803 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(6,235)	(6,599)	(364)
GBP	(308,183)	C BARC LN 1.73847 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(7,673)	(591)	7,081
USD	(55)	C BAX UN 87.5 04/10/19	2019年10月4日	(8,127)	(7,150)	977
USD	(55)	C BAX UN 87.5 15/11/19	2019年11月15日	(17,339)	(12,980)	4,359
USD	(55)	C BAX UN 89 01/11/19	2019年11月1日	(8,732)	(8,855)	(123)

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	(5)	C BAX UN 90 18/10/19	2019年10月18日	(1,048)	(165)	883
USD	(17,900)	C BBD UN 8.13 04/10/19	OTC 2019年10月4日	(3,172)	(2,967)	204
USD	(17,900)	C BBD UN 8.13 11/10/19	OTC 2019年10月11日	(3,652)	(4,379)	(727)
USD	(36,900)	C BBD UN 8.346 18/10/19	OTC 2019年10月18日	(8,148)	(7,166)	982
AUD	(29,484)	C BHP AT 36.7134 16/10/19	OTC 2019年10月16日	(5,921)	(12,841)	(6,919)
AUD	(18,702)	C BHP AT 37.2039 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(3,799)	(6,873)	(3,074)
AUD	(18,311)	C BHP AT 38.0503 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(10,794)	(4,698)	6,096
AUD	(25,258)	C BHP AT 38.0842 27/11/19	OTC 2019年11月27日	(8,018)	(11,932)	(3,914)
AUD	(25,744)	C BHP AT 38.5075 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(10,366)	(7,317)	3,049
AUD	(253)	C BHP AT 39 28/11/19	2019年11月28日	(7,903)	(7,519)	385
AUD	(27,111)	C BHP AT 43.6407 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(13,768)	(28)	13,740
USD	(34)	C BIIB UQ 240 18/10/19	2019年10月18日	(11,184)	(10,880)	304
USD	(52)	C BMV UN 49 18/10/19	2019年10月18日	(5,604)	(12,064)	(6,460)
USD	(36)	C BMV UN 50 18/10/19	2019年10月18日	(3,267)	(5,400)	(2,133)
USD	(37)	C BMV UN 51 01/11/19	2019年11月1日	(3,284)	(5,587)	(2,303)
USD	(37)	C BMV UN 51 25/10/19	2019年10月25日	(2,655)	(3,441)	(786)
EUR	(6,527)	C BNP FP 45.3683 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(3,550)	(9,387)	(5,838)
EUR	(8,403)	C BNP FP 46.7455 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(5,028)	(3,185)	1,844
EUR	(7,382)	C BNP FP 47.9403 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(5,394)	(5,520)	(126)
EUR	(7,624)	C BNP FP 48.5624 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(4,969)	(5,315)	(346)
GBP	(143,129)	C BP/ LN 5.30545 07/10/19	OTC 2019年10月7日	(3,111)	(2,263)	848
GBP	(176,806)	C BP/ LN 5.36715 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(10,765)	(13,981)	(3,215)
GBP	(159,968)	C BP/ LN 5.38272 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(10,928)	(15,825)	(4,898)
GBP	(155,010)	C BP/ LN 5.50719 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(12,620)	(2,917)	9,702
GBP	(165,217)	C BP/ LN 5.57261 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(11,102)	(9,815)	1,288
USD	(78)	C BP UN 37 04/10/19	2019年10月4日	(6,221)	(10,920)	(4,699)
USD	(209)	C BP UN 37.5 11/10/19	FLEX 2019年10月11日	(17,715)	(19,957)	(2,242)
USD	(28)	C BP UN 38 18/10/19	2019年10月18日	(1,813)	(2,184)	(371)
USD	(67)	C BP UN 39 01/11/19	2019年11月1日	(4,442)	(4,020)	422
USD	(63)	C BP UN 39 25/10/19	2019年10月25日	(2,475)	(2,583)	(108)
USD	(78)	C BP UN 40 15/11/19	2019年11月15日	(5,165)	(2,964)	2,201
AUD	(42,557)	C BSL AT 12.8825 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(12,122)	(4,829)	7,293
AUD	(440)	C BSL AT 13 28/11/19	2019年11月28日	(8,822)	(9,658)	(836)
AUD	(42,154)	C BSL AT 13.4804 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(11,439)	(3,768)	7,671
AUD	(50,695)	C BSL AT 14.1164 16/10/19	OTC 2019年10月16日	(6,725)	(131)	6,594
AUD	(47,218)	C BXB AU 11.7821 06/11/19	OTC 2019年11月6日	(4,315)	(3,594)	721
USD	(116)	C C UN 64.22 11/10/19	FLEX 2019年10月11日	(20,851)	(59,962)	(39,110)
USD	(40)	C C UN 66 04/10/19	2019年10月4日	(4,767)	(13,000)	(8,233)
USD	(10)	C C UN 68 25/10/19	2019年10月25日	(1,682)	(3,300)	(1,618)
USD	(40)	C C UN 71 01/11/19	2019年11月1日	(5,150)	(6,920)	(1,770)
USD	(60)	C C UN 71 11/10/19	2019年10月11日	(8,347)	(3,960)	4,387

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	(61)	C C UN 72.5 18/10/19	2019年10月18日	(6,898)	(2,867)	4,031
USD	(27)	C CAG UN 29.87 15/11/19 FLEX	2019年11月15日	(3,099)	(4,200)	(1,101)
USD	(34)	C CAG UN 30.25 02/12/19 FLEX	2019年12月2日	(4,582)	(5,589)	(1,007)
USD	(242)	C CAG UN 30.5 18/10/19 FLEX	2019年10月18日	(25,110)	(19,866)	5,244
AUD	(14,039)	C CBA AT 79.9881 23/10/19 OTC	2019年10月23日	(5,658)	(15,095)	(9,437)
AUD	(13,401)	C CBA AT 80.176 06/11/19 OTC	2019年11月6日	(7,470)	(16,325)	(8,855)
AUD	(13,700)	C CBA AT 80.4339 20/11/19 OTC	2019年11月20日	(8,556)	(17,766)	(9,210)
AUD	(13,325)	C CBA AT 80.8261 04/12/19 OTC	2019年12月4日	(11,113)	(17,480)	(6,367)
AUD	(128)	C CBA AT 84 19/12/19	2019年12月19日	(9,219)	(7,651)	1,568
USD	(123)	C CMCSA UQ 43.75 04/10/19 FLEX	2019年10月4日	(11,655)	(12,762)	(1,107)
USD	(187)	C CMCSA UQ 44.16 11/10/19 FLEX	2019年10月11日	(17,720)	(18,582)	(862)
USD	(115)	C CMCSA UQ 45 18/10/19	2019年10月18日	(10,783)	(8,740)	2,043
USD	(79)	C CMCSA UQ 46.5 08/11/19	2019年11月8日	(5,037)	(5,451)	(414)
USD	(147)	C CMCSA UQ 47 01/11/19	2019年11月1日	(16,135)	(7,350)	8,785
USD	(73)	C CMCSA UQ 47.5 18/10/19	2019年10月18日	(6,260)	(657)	5,603
USD	(39)	C CMCSA UQ 48 25/10/19	2019年10月25日	(3,384)	(897)	2,487
USD	(63)	C COF UN 87 04/10/19	2019年10月4日	(11,503)	(28,854)	(17,351)
USD	(21)	C COF UN 92.5 15/11/19	2019年11月15日	(6,476)	(6,048)	428
EUR	(7,115)	C CON GY 127.9802 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(10,350)	(13,440)	(3,090)
EUR	(5,760)	C CON GY 132.9833 07/10/19 OTC	2019年10月7日	(3,478)	(14)	3,464
EUR	(6,648)	C CON GY 135.2425 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(10,239)	(10,287)	(48)
EUR	(4,573)	C CON GY 143.2114 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(8,160)	(2,399)	5,761
EUR	(7,370)	C CON GY 144.3247 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(14,788)	(238)	14,549
USD	(28)	C COP UN 55.22 18/10/19 FLEX	2019年10月18日	(3,605)	(7,490)	(3,885)
USD	(28)	C COP UN 56 11/10/19	2019年10月11日	(2,464)	(6,272)	(3,808)
USD	(56)	C COP UN 59 25/10/19	2019年10月25日	(7,043)	(10,192)	(3,149)
USD	(61)	C COP UN 61 08/11/19	2019年11月8日	(7,488)	(5,795)	1,693
USD	(61)	C COP UN 63 01/11/19	2019年11月1日	(11,697)	(2,928)	8,769
AUD	(36,494)	C CPU AT 15.5624 16/10/19 OTC	2019年10月16日	(5,540)	(16,470)	(10,930)
AUD	(42,816)	C CPU AT 16.2685 06/11/19 OTC	2019年11月6日	(5,850)	(10,352)	(4,502)
USD	(192)	C CSCO UQ 49 04/10/19	2019年10月4日	(23,871)	(10,560)	13,311
USD	(109)	C CSCO UQ 50 18/10/19	2019年10月18日	(10,220)	(5,777)	4,443
USD	(109)	C CSCO UQ 50.5 08/11/19	2019年11月8日	(7,277)	(8,720)	(1,443)
USD	(144)	C CSCO UQ 51 01/11/19	2019年11月1日	(12,061)	(7,200)	4,861
USD	(130)	C CSCO UQ 52 25/10/19	2019年10月25日	(8,029)	(2,600)	5,429
AUD	(3,786)	C CSL AT 236.2516 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(10,094)	(10,529)	(436)
AUD	(4,058)	C CSL AT 240.5274 13/11/19 OTC	2019年11月13日	(9,773)	(9,725)	48
AUD	(3,848)	C CSL AT 245.8179 09/10/19 OTC	2019年10月9日	(4,073)	(229)	3,843
AUD	(3,863)	C CSL AT 247.899 27/11/19 OTC	2019年11月27日	(9,885)	(5,912)	3,973
AUD	(44)	C CSL AT 250 19/12/19	2019年12月19日	(10,228)	(8,425)	1,803
AUD	(29,131)	C CTD AT 19.2074 09/10/19 OTC	2019年10月9日	(5,300)	(5,042)	259

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

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	(27, 576)	C CTD AT 21.0336 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(3, 595)	(1, 608)	1, 987
USD	(40)	C CTSH UQ 62.5 15/11/19	2019年11月15日	(4, 830)	(4, 000)	830
USD	(19)	C CTSH UQ 64.5 01/11/19	2019年11月 1 日	(3, 548)	(950)	2, 598
USD	(19)	C CTSH UQ 64.5 25/10/19	2019年10月25日	(2, 566)	(2, 565)	1
USD	(150)	C CTVA UN 30 18/10/19	2019年10月18日	(14, 514)	(2, 250)	12, 264
USD	(126)	C CTVA UN 30 30/10/19	FLEX 2019年10月30日	(8, 916)	(6, 270)	2, 646
USD	(133)	C CTVA UN 30.51 25/10/19	FLEX 2019年10月25日	(9, 544)	(4, 569)	4, 975
USD	(126)	C CTVA UN 30.75 08/11/19	FLEX 2019年11月 8 日	(9, 168)	(5, 480)	3, 688
AUD	(254, 653)	C CWY AT 2.2261 06/11/19	OTC 2019年11月 6 日	(4, 182)	(2, 356)	1, 825
AUD	(246, 338)	C CWY AT 2.358 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(3, 760)	(235)	3, 525
USD	(18)	C DLTR UQ 100 18/10/19	2019年10月18日	(6, 643)	(25, 092)	(18, 449)
USD	(25)	C DLTR UQ 110 18/10/19	2019年10月18日	(7, 694)	(16, 000)	(8, 306)
USD	(19)	C DLTR UQ 113 25/10/19	2019年10月25日	(5, 406)	(7, 410)	(2, 004)
EUR	(84, 845)	C ENI IM 14.0674 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(4, 557)	(12, 249)	(7, 691)
EUR	(104, 808)	C ENI IM 14.3134 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(12, 664)	(31, 205)	(18, 541)
EUR	(94, 827)	C ENI IM 14.3865 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(14, 516)	(31, 249)	(16, 733)
EUR	(120, 574)	C ENI IM 14.6084 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(21, 200)	(8, 516)	12, 685
EUR	(84, 740)	C ENI IM 14.9759 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(13, 663)	(13, 430)	233
USD	(110)	C EQH UN 20.71 04/10/19	FLEX 2019年10月 4 日	(5, 254)	(19, 472)	(14, 218)
USD	(97)	C EQH UN 23.14 15/11/19	FLEX 2019年11月15日	(6, 865)	(6, 177)	687
USD	(5, 200)	C ETFC UQ 41.477 11/10/19	OTC 2019年10月11日	(6, 575)	(10, 439)	(3, 864)
USD	(49)	C ETFC UQ 43 04/10/19	2019年10月 4 日	(4, 643)	(3, 381)	1, 262
USD	(54)	C ETFC UQ 45 15/11/19	2019年11月15日	(5, 994)	(6, 480)	(486)
USD	(21)	C ETFC UQ 46 01/11/19	2019年11月 1 日	(2, 833)	(2, 835)	(2)
USD	(11)	C ETFC UQ 46.5 25/10/19	2019年10月25日	(1, 361)	(462)	899
USD	(202)	C EXC UN 46 18/10/19	2019年10月18日	(18, 333)	(59, 590)	(41, 256)
USD	(160)	C EXC UN 48.98 25/10/19	FLEX 2019年10月25日	(12, 282)	(12, 298)	(17)
USD	(3, 400)	C EXC UN 48.99 28/10/19	OTC 2019年10月28日	(2, 954)	(2, 803)	151
USD	(226)	C FCX UN 10.5 08/11/19	2019年11月 8 日	(6, 274)	(5, 650)	624
USD	(63)	C FCX UN 11.5 25/10/19	2019年10月25日	(2, 206)	(252)	1, 954
USD	(28)	C FCX UN 9.5 04/10/19	2019年10月 4 日	(859)	(728)	131
USD	(143)	C FE UN 45 18/10/19	2019年10月18日	(14, 981)	(51, 337)	(36, 356)
USD	(52)	C FE UN 45 30/09/19	FLEX 2019年 9 月30日	(4, 616)	(18, 302)	(13, 687)
USD	(134)	C FE UN 45.5 25/10/19	FLEX 2019年10月25日	(17, 500)	(43, 825)	(26, 325)
USD	(111)	C FE UN 46.6 12/11/19	FLEX 2019年11月12日	(13, 626)	(26, 173)	(12, 547)
USD	(98)	C FE UN 48.76 01/11/19	FLEX 2019年11月 1 日	(7, 327)	(10, 063)	(2, 737)
USD	(4)	C GM UN 39 01/11/19	2019年11月 1 日	(300)	(280)	20
USD	(3)	C GM UN 39 08/11/19	2019年11月 8 日	(250)	(249)	1
USD	(6)	C GM UN 39 18/10/19	2019年10月18日	(359)	(174)	185
USD	(55)	C GM UN 39 25/10/19	2019年10月25日	(4, 552)	(2, 145)	2, 407
USD	(82)	C GM UN 40.5 11/10/19	2019年10月11日	(5, 720)	(328)	5, 392

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	(161)	C HIG UN 60 04/10/19	2019年10月 4 日	(9,364)	(13,685)	(4,321)
USD	(57)	C HIG UN 60 18/10/19	2019年10月18日	(7,068)	(7,125)	(57)
GBP	(105,143)	C HSBA LN 6.27475 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(9,091)	(17,747)	(8,656)
GBP	(85,115)	C HSBA LN 6.30066 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(3,491)	(3,685)	(194)
GBP	(95,129)	C HSBA LN 6.525 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(11,014)	(8,343)	2,672
GBP	(83,781)	C HSBA LN 6.54641 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(7,737)	(7,877)	(140)
GBP	(108,405)	C HSBA LN 6.80285 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(9,838)	(163)	9,675
USD	(3,800)	C HUBB UN 133.12 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(16,935)	(13,259)	3,676
USD	(3,800)	C HUBB UN 134.44 08/11/19 OTC	2019年11月 8 日	(17,045)	(13,058)	3,987
EUR	(81,281)	C INGA NA 10.0088 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(4,599)	(1,310)	3,289
EUR	(90,843)	C INGA NA 10.5985 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(12,446)	(10,799)	1,647
EUR	(93,824)	C INGA NA 10.784 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(10,310)	(10,020)	290
EUR	(103,521)	C INGA NA 11.1513 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(15,028)	(511)	14,517
EUR	(100,406)	C INGA NA 9.7554 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(11,577)	(33,587)	(22,010)
USD	(242)	C IPG UN 21 18/10/19	2019年10月18日	(9,622)	(16,456)	(6,834)
USD	(321)	C IPG UN 22 18/10/19	2019年10月18日	(11,158)	(11,235)	(77)
EUR	(374,375)	C ISP IM 2.2285 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(9,225)	(13,986)	(4,761)
EUR	(219,361)	C ISP IM 2.2558 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(2,298)	(1,413)	885
EUR	(270,976)	C ISP IM 2.2653 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(5,956)	(13,430)	(7,474)
EUR	(245,169)	C ISP IM 2.3679 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(7,452)	(7,960)	(508)
EUR	(253,213)	C ISP IM 2.4078 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(7,164)	(7,646)	(482)
USD	(49,000)	C ITUB UN 8.583 19/11/19 OTC	2019年11月19日	(16,846)	(20,464)	(3,618)
USD	(54,000)	C ITUB UN 8.915 17/10/19 OTC	2019年10月17日	(21,389)	(5,620)	15,769
AUD	(31,410)	C JHX AT 22.9874 23/10/19 OTC	2019年10月23日	(8,806)	(41,055)	(32,249)
AUD	(29,903)	C JHX AT 23.4843 06/11/19 OTC	2019年11月 6 日	(10,122)	(32,973)	(22,851)
AUD	(30,591)	C JHX AT 23.8069 09/10/19 OTC	2019年10月 9 日	(4,923)	(22,628)	(17,705)
AUD	(23,419)	C JHX AT 24.3512 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(4,656)	(14,708)	(10,052)
USD	(73)	C JPM UN 109 04/10/19	2019年10月 4 日	(12,245)	(61,320)	(49,074)
USD	(8)	C JPM UN 110 18/10/19	2019年10月18日	(1,720)	(6,576)	(4,856)
USD	(52)	C JPM UN 111 11/10/19	2019年10月11日	(8,655)	(46,800)	(38,145)
USD	(42)	C JPM UN 120 01/11/19	2019年11月 1 日	(6,332)	(6,594)	(262)
USD	(43)	C JPM UN 121 11/10/19	2019年10月11日	(7,386)	(1,376)	6,010
USD	(130)	C K UN 65 01/11/19 FLEX	2019年11月 1 日	(23,239)	(17,241)	5,998
USD	(131)	C K UN 65 15/11/19	2019年11月15日	(26,561)	(26,855)	(294)
USD	(91)	C K UN 65 18/10/19	2019年10月18日	(8,896)	(7,735)	1,161
USD	(37)	C KSS UN 50.5 01/11/19	2019年11月 1 日	(6,096)	(7,030)	(934)
USD	(34)	C KSS UN 55 18/10/19	2019年10月18日	(5,066)	(816)	4,250
USD	(37)	C LH UN 175 15/11/19	2019年11月15日	(23,227)	(9,620)	13,607
USD	(38)	C LH UN 175 18/10/19	2019年10月18日	(11,505)	(3,040)	8,465
USD	(10,620)	C LKOD LI 89.54 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(3,995)	(70)	3,925
USD	(11,869)	C LKOD LI 92.26 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(10,941)	(7,311)	3,630

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	(831, 204)	C LLOY LN 0.54265 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(2, 347)	(9, 888)	(7, 540)
GBP	(1, 026, 782)	C LLOY LN 0.56408 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(8, 753)	(18, 871)	(10, 118)
GBP	(1, 207, 691)	C LLOY LN 0.57997 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(10, 126)	(19, 432)	(9, 306)
GBP	(1, 591, 534)	C LLOY LN 0.59891 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(13, 869)	(3, 348)	10, 521
GBP	(1, 439, 213)	C LLOY LN 0.62225 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(13, 132)	(10, 375)	2, 757
USD	(60)	C LOW UN 112 01/11/19	2019年11月 1 日	(9, 789)	(10, 680)	(891)
USD	(30)	C LOW UN 112 11/10/19	2019年10月11日	(9, 566)	(2, 640)	6, 926
USD	(19)	C LOW UN 115 18/10/19	2019年10月18日	(5, 467)	(779)	4, 688
USD	(13)	C LOW UN 116 04/10/19	2019年10月 4 日	(2, 077)	(65)	2, 012
USD	(28)	C LOW UN 116 25/10/19	2019年10月25日	(4, 445)	(1, 232)	3, 213
USD	(66)	C MAS UN 42.36 25/10/19 FLEX	2019年10月25日	(4, 670)	(5, 600)	(930)
USD	(172)	C MAS UN 44 18/10/19	2019年10月18日	(16, 647)	(2, 580)	14, 067
SGD	(300, 000)	C MCT SP 2.394 04/10/19 OTC	2019年10月 4 日	(300)	(4)	296
USD	(7)	C MDT UN 108 01/11/19	2019年11月 1 日	(1, 300)	(1, 750)	(450)
USD	(33)	C MDT UN 110 04/10/19	2019年10月 4 日	(5, 833)	(759)	5, 074
USD	(33)	C MDT UN 110 11/10/19	2019年10月11日	(4, 678)	(2, 112)	2, 566
USD	(12)	C MDT UN 110 18/10/19	2019年10月18日	(1, 690)	(1, 092)	598
USD	(7)	C MDT UN 112 25/10/19	2019年10月25日	(1, 293)	(476)	817
USD	(12)	C MDT UN 113 01/11/19	2019年11月 1 日	(2, 085)	(444)	1, 641
USD	(51)	C MET UN 45.5 04/10/19	2019年10月 4 日	(3, 864)	(9, 588)	(5, 724)
USD	(47)	C MET UN 47.5 18/10/19	2019年10月18日	(4, 783)	(4, 089)	694
USD	(26)	C MET UN 48 25/10/19	2019年10月25日	(2, 100)	(2, 132)	(32)
USD	(27)	C MET UN 48.5 01/11/19	2019年11月 1 日	(2, 397)	(2, 430)	(33)
USD	(3)	C MET UN 49 25/10/19	2019年10月25日	(281)	(111)	170
USD	(107)	C MET UN 50 15/11/19	2019年11月15日	(9, 591)	(5, 350)	4, 241
AUD	(258, 725)	C MGR AT 3.4271 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(10, 304)	(213)	10, 091
USD	(74)	C MO UN 42.5 15/11/19	2019年11月15日	(9, 972)	(6, 808)	3, 164
USD	(28)	C MPC UN 51 04/10/19	2019年10月 4 日	(1, 925)	(27, 300)	(25, 375)
USD	(26)	C MPC UN 52.5 11/10/19	2019年10月11日	(2, 984)	(9, 880)	(6, 896)
USD	(26)	C MPC UN 55 25/10/19	2019年10月25日	(4, 414)	(20, 670)	(16, 256)
USD	(3)	C MPC UN 57.5 18/10/19	2019年10月18日	(230)	(1, 359)	(1, 129)
USD	(45)	C MPC UN 59.5 01/11/19	2019年11月 1 日	(11, 779)	(20, 250)	(8, 471)
AUD	(5, 527)	C MQG AT 129.4857 09/10/19 OTC	2019年10月 9 日	(3, 668)	(8, 391)	(4, 723)
AUD	(6, 381)	C MQG AT 130.1617 20/11/19 OTC	2019年11月20日	(5, 600)	(15, 467)	(9, 867)
AUD	(5, 512)	C MQG AT 130.5309 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(4, 561)	(10, 299)	(5, 738)
AUD	(7, 339)	C MQG AT 131.0923 06/11/19 OTC	2019年11月 6 日	(6, 931)	(13, 728)	(6, 797)
GBP	(759, 541)	C MRW LN 2.07868 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(20, 285)	(17, 902)	2, 383
GBP	(392, 072)	C MRW LN 2.13793 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(12, 680)	(13, 461)	(781)
GBP	(521, 153)	C MRW LN 2.16959 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(15, 615)	(15, 745)	(131)
USD	(135)	C MS UN 42 18/10/19	2019年10月18日	(12, 388)	(22, 410)	(10, 022)
USD	(20)	C MS UN 43 01/11/19	2019年11月 1 日	(2, 615)	(2, 660)	(45)

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	(131)	C MS UN 43 04/10/19	2019年10月 4 日	(9,008)	(5,240)	3,768
USD	(8)	C MS UN 45 01/11/19	2019年11月 1 日	(870)	(456)	414
USD	(12)	C MS UN 46 11/10/19	2019年10月11日	(855)	(60)	795
AUD	(39,100)	C NAB AT 28.0434 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(10,591)	(45,074)	(34,483)
AUD	(38,394)	C NAB AT 28.099 27/11/19	OTC 2019年11月27日	(9,649)	(44,895)	(35,246)
AUD	(24,372)	C NAB AT 28.2688 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(6,322)	(26,190)	(19,869)
AUD	(37,834)	C NAB AT 28.4072 16/10/19	OTC 2019年10月16日	(5,727)	(34,057)	(28,330)
AUD	(186)	C NCM AT 38.5 28/11/19	2019年11月28日	(10,231)	(8,542)	1,688
USD	(90)	C NVS UN 90 15/11/19	2019年11月15日	(12,398)	(10,530)	1,868
USD	(160)	C NVS UN 92.5 18/10/19	2019年10月18日	(24,995)	(1,600)	23,395
USD	(114,400)	C OGZD LI 7.79 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(3,649)	(13)	3,637
USD	(158,983)	C OGZD LI 7.85 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(13,164)	(7,235)	5,928
USD	(132,055)	C OGZD LI 8.13 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(9,812)	(7,491)	2,320
USD	(127,859)	C OGZD LI 8.2 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(9,999)	(4,640)	5,359
USD	(146)	C ORCL UN 54 01/11/19	2019年11月 1 日	(11,937)	(17,520)	(5,583)
USD	(185)	C ORCL UN 54 04/10/19	2019年10月 4 日	(23,450)	(16,650)	6,800
USD	(146)	C ORCL UN 55 15/11/19	2019年11月15日	(10,039)	(18,980)	(8,941)
AUD	(82,687)	C OSH AT 7.014 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(5,098)	(22,339)	(17,240)
AUD	(60,595)	C OZL AT 9.2674 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(8,887)	(23,875)	(14,989)
AUD	(58,088)	C OZL AT 9.9609 09/10/19	OTC 2019年10月 9 日	(3,932)	(1,844)	2,088
USD	(231)	C PBR UN 14 11/10/19	2019年10月11日	(10,109)	(20,097)	(9,988)
USD	(190)	C PBR UN 15 01/11/19	2019年11月 1 日	(7,869)	(9,120)	(1,251)
USD	(48)	C PEP UQ 137 25/10/19	2019年10月25日	(11,028)	(12,672)	(1,644)
USD	(25)	C PEP UQ 138 18/10/19	2019年10月18日	(3,288)	(4,650)	(1,362)
USD	(24)	C PEP UQ 139 01/11/19	2019年11月 1 日	(3,411)	(4,272)	(861)
USD	(85)	C PFE UN 35.63 11/10/19	FLEX 2019年10月11日	(6,695)	(7,667)	(972)
USD	(65)	C PFE UN 36 04/10/19	2019年10月 4 日	(3,169)	(3,185)	(16)
USD	(65)	C PFE UN 36 18/10/19	2019年10月18日	(4,341)	(4,940)	(599)
USD	(58)	C PFE UN 36.5 18/10/19	2019年10月18日	(3,292)	(3,016)	276
USD	(58)	C PFE UN 37 01/11/19	2019年11月 1 日	(3,924)	(4,060)	(136)
USD	(112)	C PFE UN 37 15/11/19	2019年11月15日	(10,957)	(8,736)	2,221
USD	(58)	C PFE UN 37 25/10/19	2019年10月25日	(2,596)	(2,436)	160
USD	(111)	C PFE UN 37.45 08/11/19	FLEX 2019年11月 8 日	(7,743)	(5,278)	2,465
USD	(48)	C PFE UN 37.5 11/10/19	2019年10月11日	(1,861)	(480)	1,381
USD	(157)	C PFE UN 37.5 25/10/19	2019年10月25日	(9,853)	(4,710)	5,143
USD	(66)	C PFE UN 38 01/11/19	2019年11月 1 日	(5,000)	(2,310)	2,690
USD	(113)	C PHG UN 46.84 18/10/19	FLEX 2019年10月18日	(16,245)	(6,723)	9,522
USD	(13,200)	C PHG UN 47.352 25/10/19	OTC 2019年10月25日	(11,208)	(7,765)	3,443
USD	(14,600)	C PHG UN 48 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(24,397)	(672)	23,725
USD	(19)	C PKG UN 105 18/10/19	2019年10月18日	(4,850)	(5,757)	(907)
USD	(1,800)	C PKG UN 110.674 25/10/19	OTC 2019年10月25日	(3,849)	(1,963)	1,886

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	(4)	C PM UN 75 11/10/19	2019年10月11日	(449)	(684)	(235)
USD	(4)	C PM UN 75 15/11/19	2019年11月15日	(720)	(1, 276)	(557)
USD	(17)	C PM UN 75 25/10/19	2019年10月25日	(2, 444)	(3, 961)	(1, 517)
USD	(8)	C PM UN 85 18/10/19	2019年10月18日	(1, 723)	(56)	1, 667
GBP	(158, 380)	C PSON LN 9.08803 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(19, 248)	(1, 596)	17, 652
GBP	(143, 296)	C PSON LN 9.30384 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(19, 842)	(1, 565)	18, 277
EUR	(9, 649)	C PUB FP 48.1957 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(1, 655)	(463)	1, 192
EUR	(11, 920)	C PUB FP 49.7312 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(6, 891)	(6, 517)	373
EUR	(11, 138)	C PUB FP 50.2679 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(6, 554)	(7, 694)	(1, 140)
EUR	(12, 289)	C PUB FP 50.6433 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(7, 835)	(1, 350)	6, 484
EUR	(10, 785)	C PUB FP 51.2512 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(5, 979)	(4, 882)	1, 098
USD	(45)	C PWR UN 35 18/10/19	2019年10月18日	(3, 327)	(12, 645)	(9, 318)
USD	(2, 500)	C PWR UN 35.11 30/09/19 OTC	2019年 9 月30日	(1, 663)	(5, 849)	(4, 187)
USD	(3, 700)	C PWR UN 35.527 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(3, 886)	(9, 471)	(5, 585)
USD	(36)	C PWR UN 39 18/10/19	2019年10月18日	(2, 619)	(1, 584)	1, 035
USD	(166)	C QCOM UQ 77.5 18/10/19	2019年10月18日	(56, 067)	(31, 042)	25, 025
USD	(138)	C QCOM UQ 81 01/11/19	2019年11月 1 日	(15, 269)	(17, 250)	(1, 981)
USD	(20)	C QCOM UQ 81 25/10/19	2019年10月25日	(3, 515)	(2, 580)	935
GBP	(429, 876)	C RBS LN 2.09381 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(5, 595)	(15, 182)	(9, 587)
GBP	(531, 024)	C RBS LN 2.18089 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(11, 963)	(34, 661)	(22, 698)
GBP	(416, 390)	C RBS LN 2.26457 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(13, 195)	(20, 991)	(7, 796)
GBP	(583, 119)	C RBS LN 2.32362 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(18, 863)	(3, 945)	14, 917
GBP	(496, 215)	C RBS LN 2.397 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(15, 357)	(13, 203)	2, 154
AUD	(6, 953)	C REA AT 108.6275 09/10/19 OTC	2019年10月 9 日	(6, 600)	(7, 671)	(1, 071)
AUD	(5, 124)	C REA AT 109.8126 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(6, 122)	(9, 608)	(3, 486)
EUR	(74, 586)	C REP SQ 14.386 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(10, 890)	(34, 890)	(23, 999)
EUR	(60, 379)	C REP SQ 14.5324 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(4, 162)	(4, 167)	(5)
EUR	(67, 483)	C REP SQ 14.9424 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(10, 286)	(20, 363)	(10, 078)
EUR	(69, 697)	C REP SQ 15.2391 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(11, 435)	(10, 200)	1, 235
EUR	(76, 900)	C REP SQ 15.6905 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(13, 753)	(944)	12, 808
USD	(21, 400)	C RF UN 14.456 28/10/19 OTC	2019年10月28日	(8, 656)	(33, 773)	(25, 117)
USD	(6, 500)	C RF UN 15.048 18/10/19 OTC	2019年10月18日	(3, 181)	(6, 472)	(3, 291)
USD	(21, 500)	C RF UN 15.93 08/10/19 OTC	2019年10月 8 日	(12, 244)	(5, 351)	6, 893
USD	(61)	C RF UN 17 15/11/19	2019年11月15日	(1, 937)	(1, 525)	412
AUD	(7, 851)	C RIO AT 91.3105 09/10/19 OTC	2019年10月 9 日	(7, 184)	(11, 049)	(3, 865)
AUD	(9, 190)	C RIO AT 93.5376 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(5, 851)	(12, 686)	(6, 835)
AUD	(8, 919)	C RIO AT 94.3386 20/11/19 OTC	2019年11月20日	(8, 976)	(14, 560)	(5, 585)
AUD	(73)	C RIO AT 97.01 28/11/19	2019年11月28日	(5, 892)	(7, 938)	(2, 046)
EUR	(12, 705)	C RRTL GY 46.2978 07/10/19 OTC	2019年10月 7 日	(2, 768)	(281)	2, 487
EUR	(14, 666)	C RRTL GY 48.6464 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(8, 500)	(6, 901)	1, 599
EUR	(12, 367)	C RRTL GY 49.6133 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(7, 912)	(248)	7, 664

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	(14, 199)	C RRTL GY 50.4975 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(9, 457)	(2, 533)	6, 925
EUR	(22, 566)	C SAN FP 80.9931 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(23, 886)	(109, 831)	(85, 944)
EUR	(14, 187)	C SAN FP 82.6682 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(5, 581)	(39, 401)	(33, 820)
EUR	(18, 985)	C SAN FP 83.1197 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(19, 654)	(74, 170)	(54, 514)
EUR	(17, 177)	C SAN FP 85.1944 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(19, 617)	(52, 107)	(32, 490)
EUR	(16, 103)	C SAN FP 90.8441 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(17, 954)	(17, 566)	388
USD	(17, 100)	C SIEGY UV 51.511 23/10/19	OTC 2019年10月23日	(17, 704)	(40, 913)	(23, 209)
CHF	(11, 199)	C SREN SE 100.1327 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(13, 638)	(49, 110)	(35, 472)
CHF	(8, 689)	C SREN SE 100.8315 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(10, 046)	(39, 613)	(29, 568)
CHF	(7, 034)	C SREN SE 105.1586 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(3, 257)	(2, 501)	756
CHF	(8, 517)	C SREN SE 107.6794 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(11, 506)	(11, 954)	(448)
CHF	(10, 150)	C SREN SE 108.7736 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(12, 746)	(12, 871)	(124)
GBP	(121, 339)	C STAN LN 6.97128 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(5, 408)	(5, 617)	(209)
GBP	(149, 889)	C STAN LN 6.9975 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(11, 353)	(34, 696)	(23, 343)
GBP	(140, 064)	C STAN LN 7.45153 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(14, 161)	(16, 107)	(1, 945)
GBP	(154, 540)	C STAN LN 7.46106 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(18, 584)	(1, 814)	16, 770
GBP	(135, 614)	C STAN LN 7.50798 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(14, 816)	(11, 024)	3, 792
AUD	(100, 078)	C STO AT 7.1403 09/10/19	OTC 2019年10月 9 日	(7, 829)	(40, 155)	(32, 327)
AUD	(99, 493)	C STO AT 7.2496 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(7, 639)	(37, 279)	(29, 639)
AUD	(73, 997)	C STO AT 7.5922 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(6, 487)	(17, 977)	(11, 490)
USD	(94)	C SU UN 30.5 11/10/19	2019年10月11日	(4, 584)	(4, 700)	(116)
USD	(28)	C SU UN 32 18/10/19	2019年10月18日	(840)	(1, 232)	(392)
USD	(13)	C SU UN 32.5 25/10/19	2019年10月25日	(1, 239)	(1, 430)	(191)
GBP	(160, 918)	C S32 LN 1.64163 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(4, 286)	(1, 964)	2, 322
GBP	(285, 284)	C S32 LN 1.69421 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(8, 056)	(1, 642)	6, 413
USD	(253)	C T UN 35 18/10/19	2019年10月18日	(26, 782)	(71, 346)	(44, 563)
USD	(224)	C T UN 38 25/10/19	2019年10月25日	(12, 546)	(13, 888)	(1, 342)
USD	(60)	C TAP UN 52.5 04/10/19	2019年10月 4 日	(4, 901)	(4, 860)	41
USD	(55)	C TAP UN 57.5 25/10/19	2019年10月25日	(5, 721)	(5, 005)	716
USD	(39)	C TAP UN 58 08/11/19	2019年11月 8 日	(7, 908)	(7, 995)	(87)
AUD	(62, 768)	C TCL AT 15.5937 13/11/19	OTC 2019年11月13日	(8, 221)	(1, 850)	6, 372
AUD	(43, 721)	C TCL AT 15.7234 30/10/19	OTC 2019年10月30日	(3, 750)	(365)	3, 386
AUD	(44, 302)	C TCL AT 15.7309 16/10/19	OTC 2019年10月16日	(5, 791)	(40)	5, 752
USD	(27, 000)	C TDS UN 26.672 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(21, 708)	(6, 804)	14, 904
USD	(29, 100)	C TDS UN 26.722 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(13, 334)	(152)	13, 182
GBP	(513, 977)	C TSCO LN 2.40616 21/11/19	OTC 2019年11月21日	(16, 461)	(55, 020)	(38, 559)
GBP	(529, 496)	C TSCO LN 2.48397 24/10/19	OTC 2019年10月24日	(18, 654)	(22, 231)	(3, 577)
GBP	(465, 027)	C TSCO LN 2.53144 11/12/19	OTC 2019年12月11日	(17, 603)	(25, 079)	(7, 475)
GBP	(423, 754)	C TSCO LN 2.6362 23/12/19	OTC 2019年12月23日	(15, 309)	(11, 572)	3, 736
USD	(87)	C UN UN 62.5 18/10/19	2019年10月18日	(6, 504)	(1, 914)	4, 590
USD	(51)	C VZ UN 57 04/10/19	2019年10月 4 日	(5, 251)	(17, 085)	(11, 834)

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	(45)	C VZ UN 57.5 18/10/19	2019年10月18日	(4,579)	(14,625)	(10,046)
USD	(51)	C VZ UN 58.75 17/10/19 FLEX	2019年10月17日	(4,425)	(8,892)	(4,467)
USD	(50)	C VZ UN 59 04/10/19	2019年10月4日	(3,938)	(6,250)	(2,312)
USD	(43)	C VZ UN 59 11/10/19	2019年10月11日	(3,774)	(7,654)	(3,880)
USD	(57)	C VZ UN 60 01/11/19	2019年11月1日	(6,712)	(7,239)	(527)
USD	(257)	C VZ UN 61 01/11/19	2019年11月1日	(23,839)	(25,186)	(1,347)
USD	(73)	C VZ UN 61 25/10/19	2019年10月25日	(5,968)	(5,986)	(18)
USD	(118)	C VZ UN 62.5 15/11/19	2019年11月15日	(7,290)	(7,670)	(380)
USD	(55)	C WBA UQ 52.5 18/10/19	2019年10月18日	(6,931)	(15,620)	(8,689)
USD	(55)	C WBA UQ 56 25/10/19	2019年10月25日	(7,989)	(4,950)	3,039
AUD	(37,830)	C WBC AT 28.8916 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(5,906)	(25,091)	(19,185)
AUD	(23,901)	C WBC AT 29.2179 09/10/19 OTC	2019年10月9日	(5,848)	(8,342)	(2,494)
AUD	(27,886)	C WBC AT 29.3367 20/11/19 OTC	2019年11月20日	(5,457)	(14,281)	(8,824)
AUD	(33,250)	C WBC AT 29.3673 23/10/19 OTC	2019年10月23日	(6,687)	(12,738)	(6,051)
AUD	(43,401)	C WEB AT 13.6042 30/10/19 OTC	2019年10月30日	(4,770)	(379)	4,391
USD	(39)	C WFC UN 45.6 18/10/19 FLEX	2019年10月18日	(4,944)	(19,224)	(14,280)
USD	(29)	C WFC UN 46.75 18/10/19 FLEX	2019年10月18日	(2,690)	(11,192)	(8,502)
USD	(34)	C WFC UN 49.5 01/11/19	2019年11月1日	(4,616)	(7,242)	(2,626)
USD	(52)	C WFC UN 49.5 11/10/19	2019年10月11日	(4,720)	(8,008)	(3,288)
USD	(1)	C WFC UN 50 15/11/19	2019年11月15日	(125)	(176)	(51)
USD	(26)	C WFC UN 50 25/10/19	2019年10月25日	(1,970)	(4,160)	(2,190)
USD	(27)	C WLTW UQ 195 18/10/19	2019年10月18日	(16,409)	(13,257)	3,152
USD	(26)	C WLTW UQ 200 30/10/19 FLEX	2019年10月30日	(10,342)	(6,160)	4,181
USD	(64)	C WMB UN 24 18/10/19	2019年10月18日	(4,401)	(3,456)	945
USD	(33)	C WMB UN 25 15/11/19	2019年11月15日	(1,741)	(1,716)	25
USD	(166)	C WMB UN 25 18/10/19	2019年10月18日	(8,864)	(3,320)	5,544
USD	(166)	C WMB UN 25 25/10/19	2019年10月25日	(10,086)	(4,648)	5,438
USD	(166)	C WMB UN 25.15 31/10/19 FLEX	2019年10月31日	(9,754)	(5,280)	4,474
USD	(166)	C WMB UN 26 15/11/19	2019年11月15日	(8,034)	(4,150)	3,884
AUD	(24,671)	C WOW AT 35.0802 23/10/19 OTC	2019年10月23日	(9,282)	(37,693)	(28,411)
AUD	(18,024)	C WOW AT 37.2379 06/11/19 OTC	2019年11月6日	(4,830)	(9,055)	(4,225)
AUD	(20,962)	C WPL AT 33.8991 23/10/19 OTC	2019年10月23日	(4,851)	(2,463)	2,388
GBP	(25,735)	C WPP LN 10.25251 07/10/19 OTC	2019年10月7日	(1,419)	(551)	868
GBP	(32,776)	C WPP LN 10.25753 24/10/19 OTC	2019年10月24日	(4,888)	(4,063)	825
GBP	(31,790)	C WPP LN 10.58488 21/11/19 OTC	2019年11月21日	(3,004)	(5,600)	(2,596)
GBP	(29,706)	C WPP LN 10.86848 23/12/19 OTC	2019年12月23日	(4,392)	(5,335)	(943)
GBP	(28,762)	C WPP LN 10.9568 11/12/19 OTC	2019年12月11日	(4,720)	(3,856)	865
AUD	(8,818)	C XRO AT 66.5688 23/10/19 OTC	2019年10月23日	(7,263)	(2,594)	4,669
AUD	(4,249)	C XRO AT 68.4117 06/11/19 OTC	2019年11月6日	(2,983)	(1,345)	1,638
USD	(105)	C ZBH UN 145 18/10/19	2019年10月18日	(14,499)	(3,150)	11,349
KRW	(140,000)	C 005935 KP 42992.6 04/10/19 OTC	2019年10月4日	(1,876)	(3)	1,873

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
KRW	(110,000)	C 088980 KP 12157.6 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(429)	(6)	423
HKD	(140,000)	C 1038 HK 55.5342 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(854)	(14)	840
HKD	(100,000)	C 1299 HK 79.5545 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(850)	(9)	841
HKD	(1,500,000)	C 1398 HK 5.5854 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(450)	(2)	448
JPY	(15,000)	C 1802 JT 1140.608 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(153)	(81)	72
JPY	(19,000)	C 1925 JT 3736.083 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(254)	(12)	242
JPY	(9,000)	C 1925 JT 3772.82 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(293)	(23)	271
JPY	(16,000)	C 1928 JT 2169.82 09/10/19	OTC 2019年10月 9 日	(333)	(922)	(589)
TWD	(350,000)	C 2330 TT 280.9 01/10/19	OTC 2019年10月 1 日	(1,785)	(18)	1,767
TWD	(350,000)	C 2330 TT 282.7368 08/10/19	OTC 2019年10月 8 日	(1,505)	(5,091)	(3,586)
HKD	(220,000)	C 2388 HK 28.355 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(528)	(7)	521
JPY	(15,000)	C 2914 JT 2464.8312 08/10/19	OTC 2019年10月 8 日	(231)	(199)	32
JPY	(9,000)	C 3382 JT 4350.24 09/10/19	OTC 2019年10月 9 日	(274)	(299)	(24)
JPY	(38,000)	C 4188 JT 830.2944 10/10/19	OTC 2019年10月10日	(219)	(131)	88
JPY	(6,000)	C 4452 JT 8651.1826 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(225)	(33)	192
JPY	(25,000)	C 4503 JT 1631.75 08/10/19	OTC 2019年10月 8 日	(212)	(252)	(40)
JPY	(30,000)	C 4503 JT 1658.816 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(218)	(55)	163
JPY	(3,000)	C 4519 JT 8913.1 10/10/19	OTC 2019年10月10日	(186)	(157)	29
JPY	(4,000)	C 4568 JT 7459.96 09/10/19	OTC 2019年10月 9 日	(127)	(59)	67
JPY	(14,000)	C 6301 JT 2677.9517 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(133)	(2)	131
JPY	(9,000)	C 6501 JT 4315.2521 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(447)	(14)	433
JPY	(9,000)	C 6501 JT 4374 08/10/19	OTC 2019年10月 8 日	(169)	(68)	102
JPY	(22,000)	C 6503 JT 1558.3506 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(240)	(2)	238
JPY	(4,500)	C 6702 JT 9367.4555 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(222)	(42)	180
JPY	(6,000)	C 6981 JT 5624.2996 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(176)	(10)	166
JPY	(7,000)	C 6981 JT 5628.96 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(203)	(103)	100
JPY	(7,000)	C 7011 JT 4575.579 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(229)	(8)	221
JPY	(7,000)	C 7203 JT 7692.793 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(438)	(17)	421
JPY	(11,000)	C 7267 JT 3017.4 11/10/19	OTC 2019年10月11日	(115)	(128)	(13)
JPY	(15,000)	C 7270 JT 3195.12 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(382)	(210)	172
JPY	(10,000)	C 7270 JT 3308.5311 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(174)	(48)	126
JPY	(25,000)	C 8001 JT 2350.8585 03/10/19	OTC 2019年10月 3 日	(261)	(2)	259
JPY	(17,000)	C 8031 JT 1877.79 11/10/19	OTC 2019年10月11日	(307)	(165)	142
JPY	(19,000)	C 8031 JT 1886.1638 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(259)	(29)	230
JPY	(3,000)	C 8035 JT 22695.4286 03/10/19	OTC 2019年10月 3 日	(528)	(2)	526
JPY	(32,000)	C 8053 JT 1844.0864 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(420)	0	420
HKD	(80,000)	C 823 HK 89.5125 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(608)	(205)	403
JPY	(19,000)	C 8591 JT 1712.96 11/10/19	OTC 2019年10月11日	(398)	(130)	269
JPY	(8,000)	C 8766 JT 6194.7633 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(403)	(1)	402
JPY	(3,000)	C 9021 JT 9721.4534 07/10/19	OTC 2019年10月 7 日	(184)	(8)	176
HKD	(1,800,000)	C 939 HK 6.3291 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(360)	(5)	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)
HKD	(200,000)	C 941 HK 69.3416 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(660)	(9)	651
JPY	(7,000)	C 9432 JT 5518.24 09/10/19	OTC 2019年10月 9 日	(412)	(34)	378
JPY	(15,000)	C 9433 JT 3040.44 08/10/19	OTC 2019年10月 8 日	(204)	(29)	175
JPY	(30,000)	C 9434 JT 1542.5652 04/10/19	OTC 2019年10月 4 日	(215)	0	215
JPY	(23,000)	C 9437 JT 2909.1296 08/10/19	OTC 2019年10月 8 日	(362)	(69)	293
AUD	(632)	P AS51 6150 17/10/19	2019年10月17日	(103,691)	(16,646)	87,043
				(3,885,053)	(4,857,379)	(972,326)
				(3,561,521)	(4,778,411)	(1,216,890)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日2020年8月19日）

作成対象期間（2019年8月20日～2020年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期騰落中率			
	円	%	%	%	百万円
14期(2016年 8 月19日)	10, 211	0. 0	68. 6	—	19, 722
15期(2017年 8 月21日)	10, 208	△0. 0	64. 0	—	17, 754
16期(2018年 8 月20日)	10, 206	△0. 0	38. 7	—	13, 511
17期(2019年 8 月19日)	10, 205	△0. 0	59. 3	—	8, 458
18期(2020年 8 月19日)	10, 203	△0. 0	68. 2	—	3, 175

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
* 当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

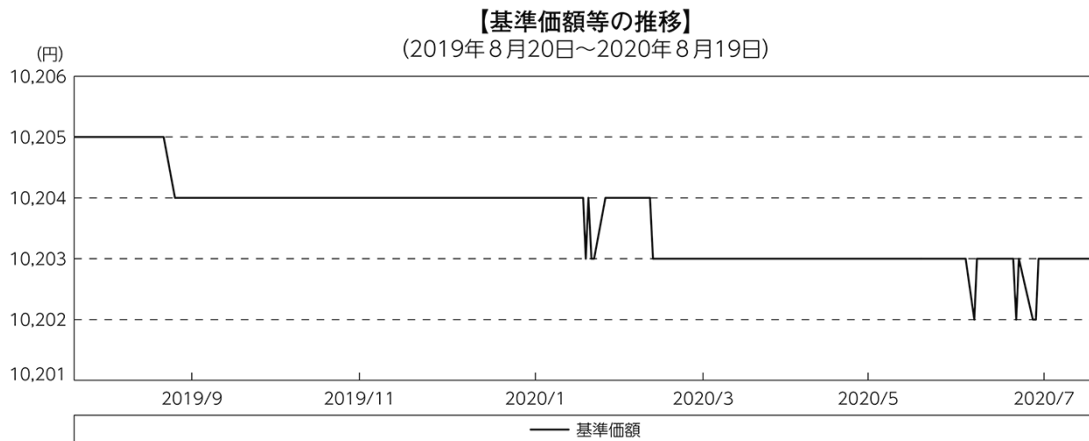
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰落率		
(期 首) 2019年 8 月19日	円	%	%	%
	10, 205	—	59. 3	—
8 月末	10, 205	0. 0	53. 9	—
9 月末	10, 204	△0. 0	61. 6	—
10月末	10, 204	△0. 0	59. 5	—
11月末	10, 204	△0. 0	61. 1	—
12月末	10, 204	△0. 0	55. 6	—
2020年 1 月末	10, 204	△0. 0	48. 8	—
2 月末	10, 204	△0. 0	66. 5	—
3 月末	10, 203	△0. 0	68. 1	—
4 月末	10, 203	△0. 0	58. 3	—
5 月末	10, 203	△0. 0	47. 0	—
6 月末	10, 203	△0. 0	68. 2	—
7 月末	10, 203	△0. 0	70. 2	—
(期 末) 2020年 8 月19日	10, 203	△0. 0	68. 2	—

* 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が、2020年2月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大により、個人消費を始め、輸出入や生産が減少するとともに、企業収益が急速に悪化しました。しかし、6月以降は、徐々に消費や生産に持ち直しの動きも出始めました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、3月および4月には資産買入の拡大などの金融緩和策を決定しました。

マイナス金利政策のもと、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、2019年9月末以降の年越え銘柄への国内外の投資家需要の拡大や、2020年3月下旬にかけての円調達コスト低下による外国人投資家需要の拡大により、一時-0.4%前後まで低下する局面もありましたが、概ね-0.1%台で推移し、期末にかけてはTDBの発行増加を受けた需給軟化により上昇基調で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01~-0.07%程度で推移しました。

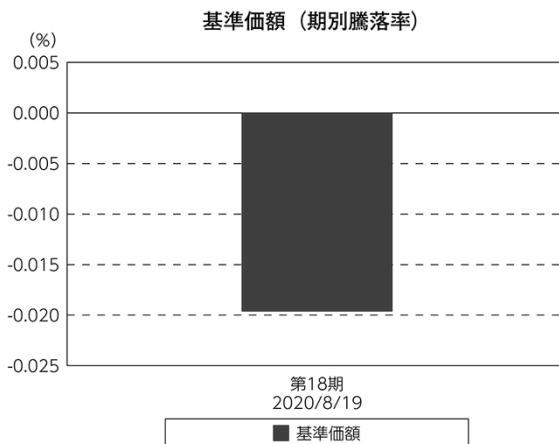
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

(2019年８月20日～2020年８月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2019年８月20日～2020年８月19日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	10,440,559	10,440,548
	地方債証券	3,868,329	1,201,158 (3,026,000)
	特殊債券	5,915,704	200,000 (5,959,400)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,085,413	100,000 (5,210,000)

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	699,994	— (1,200,000)

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2019年8月20日～2020年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 12,869	百万円 52	% 0.4	百万円 1,501	百万円 —	% —

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

○組入資産の明細

(2020年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	790,000	790,841	24.9	—	—	—	24.9
	(790,000)	(790,841)	(24.9)	(—)	(—)	(—)	(24.9)
特殊債券 (除く金融債)	302,000	302,052	9.5	—	—	—	9.5
	(302,000)	(302,052)	(9.5)	(—)	(—)	(—)	(9.5)
金融債券	500,000	500,174	15.8	—	—	—	15.8
	(500,000)	(500,174)	(15.8)	(—)	(—)	(—)	(15.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	570,000	571,314	18.0	—	—	—	18.0
	(570,000)	(571,314)	(18.0)	(—)	(—)	(—)	(18.0)
合 計	2,162,000	2,164,383	68.2	—	—	—	68.2
	(2,162,000)	(2,164,383)	(68.2)	(—)	(—)	(—)	(68.2)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
東京都 公募第687回		1. 12	100, 000	100, 091	2020/ 9 /18
神奈川県 公募（5 年）第66回		0. 101	200, 000	200, 069	2020/12/18
共同発行市場地方債 公募第90回		1. 12	100, 000	100, 109	2020/ 9 /25
共同発行市場地方債 公募第92回		1. 03	190, 000	190, 530	2020/11/25
北九州市 公募（5 年）平成27年度第 1 回		0. 136	200, 000	200, 039	2020/ 9 /30
小	計		790, 000	790, 841	
特殊債券(除く金融債)					
日本政策金融公庫債券 政府保証第32回		0. 16	120, 000	120, 024	2020/ 9 /16
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第115回		1. 0	22, 000	22, 007	2020/ 8 /31
中日本高速道路 第62回		0. 225	100, 000	100, 019	2020/ 9 /18
西日本高速道路 第44回		0. 001	60, 000	60, 001	2020/ 9 /18
小	計		302, 000	302, 052	
金融債券					
農林債券 利付第783回い号		0. 26	110, 000	110, 011	2020/ 8 /27
しんきん中金債券 利付第313回		0. 225	190, 000	190, 151	2020/12/25
商工債券 利付（3 年）第211回		0. 07	200, 000	200, 012	2020/ 8 /27
小	計		500, 000	500, 174	
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力 第484回		0. 976	100, 000	100, 165	2020/10/23
関西電力 第485回		1. 285	100, 000	100, 418	2020/12/18
東北電力 第456回		1. 176	170, 000	170, 529	2020/11/25
九州電力 第433回		0. 375	200, 000	200, 201	2020/11/25
小	計		570, 000	571, 314	
合	計		2, 162, 000	2, 164, 383	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年8月19日現在)

項 目	当期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,164,383	68.1
コール・ローン等、その他	1,011,870	31.9
投資信託財産総額	3,176,253	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 (2020年8月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,176,253,835
コール・ローン等	1,008,018,870
公社債(評価額)	2,164,383,267
未収利息	1,976,573
前払費用	1,875,125
(B) 負債	604,189
未払解約金	603,000
未払利息	1,189
(C) 純資産総額(A－B)	3,175,649,646
元本	3,112,610,329
次期繰越損益金	63,039,317
(D) 受益権総口数	3,112,610,329口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,203円

(注) 期首元本額は8,288,568,727円、期中追加設定元本額は1,394,946,702円、期中一部解約元本額は6,570,905,100円、1口当たり純資産額は1.0203円です。

○損益の状況 (2019年8月20日～2020年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	20,874,808
受取利息	21,660,304
支払利息	△ 785,496
(B) 有価証券売買損益	△ 22,026,194
売買益	4,150
売買損	△ 22,030,344
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,151,386
(D) 前期繰越損益金	169,592,351
(E) 追加信託差損益金	28,367,699
(F) 解約差損益金	△133,769,347
(G) 計(C+D+E+F)	63,039,317
次期繰越損益金(G)	63,039,317

*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50 (適格機関投資家販売限定付)	2,050,866,611
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30 (非課税適格機関投資家専用)	287,434,434
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	214,572,748
野村世界高金利通貨投資	151,953,753
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	102,454,283
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)1プライス(適格機関投資家専用)	61,746,546
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第12回 野村短期公社債ファンド	6,664,982
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
ネクストコア	2,282,012
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
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	1,861,159
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース) 年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	984,834

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投資(円コース) 毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(円コース) 年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース) 毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース) 毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルリアルコース) 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(ブラジルリアルコース) 年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース) 年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース) 年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース) 年2回決算型	983,672

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (アジア通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルリアルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルリアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルリアルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルリアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルリアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルリアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信 (ブラジルリアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信 (ブラジルリアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信 (中国元コース) 年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信 (毎月分配型)	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,607

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村新エマージング債券投信 (中国元コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信 (米ドルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信 (米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 年2回決算型	980,297
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村グローバルCB投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型	836,392
第7回 野村短期公社債ファンド	686,093
野村通貨選択日本株投信 (メキシコペソコース) 毎月分配型	626,503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信 (ブラジルリアルコース) 毎月分配型	398,357
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715
野村通貨選択日本株投信 (メキシコペソコース) 年2回決算型	373,897
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投信 (インドルピーコース) 毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投信 (トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村通貨選択日本株投信 (ブラジルリアルコース) 年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資(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
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資 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投資 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投資 Eコース	98,049
(年3%目標払出) のむらップ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出) のむらップ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投資(インドルピーコース) 年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投資(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(中国元コース) 年2回決算型	41,054
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	27,600
野村通貨選択日本株投資(中国元コース) 毎月分配型	23,859
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	18,851
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	14,308
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テンプルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプルトン・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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村アジアハイ・イールド債券投資(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イング ブラジルレアル毎月分配型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり) 毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり) 年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース) 年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投資(ユーロコース) 毎月分配型	966

○お知らせ

該当事項はございません。

＜お申し込み時の留意点＞

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

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

(2020年11月17日現在)

年 月	日
2020年11月	26
12月	24、25、28

※2020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下さい。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。