

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21期（決算日2022年5月17日）

作成対象期間（2021年11月18日～2022年5月17日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式		
信託期間	2011年11月18日から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。外貨建資産への直接投資は行ないません。	
分配方針	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行ないません。	
		毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。	

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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 達 配	期 騰 落 中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
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
19期(2021年5月17日)	17,408	10	16.7	0.1	—	98.4	829
20期(2021年11月17日)	18,189	10	4.5	0.1	—	98.2	1,056
21期(2022年5月17日)	17,577	10	△3.3	0.1	—	98.2	988

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率	中 率			
(期 首)	円	%	%	%	%	%
2021年11月17日	18,189	—	0.1	—	—	98.2
11月末	17,617	△3.1	0.1	—	—	98.7
12月末	18,214	0.1	0.0	—	—	98.5
2022年1月末	18,111	△0.4	0.1	—	—	98.6
2月末	18,087	△0.6	0.1	—	—	98.0
3月末	18,477	1.6	0.1	—	—	98.9
4月末	17,775	△2.3	0.1	—	—	98.8
(期 末)						
2022年5月17日	17,587	△3.3	0.1	—	—	98.2

* 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：18,189円

期 末：17,577円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△3.3%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年11月17日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

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

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

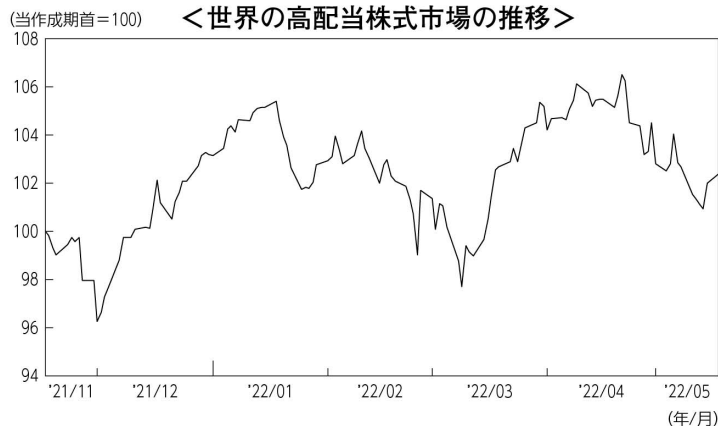
基準価額は、当作成期首18,189円から当作成期末には17,577円となりました。

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

○投資環境

<世界の高配当株式市場>

世界の高配当株式市場の騰落は以下のようになりました。



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

世界の高配当株式市場は、当作成期初には新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大への懸念などを背景に下落しましたが、感染による重症化リスクが低いとの見方などを背景に上昇に転じました。また、米国において伸び悩みが警戒されていた年末商戦の消費が堅調だったことなどを受けて上昇基調となりました。

2022年1月には、FRB（米連邦準備制度理事会）がインフレ対応重視で金融政策の正常化を前倒しで進めるとの見方が強まったことや、ウクライナ情勢を巡るロシアと米欧との緊張の高まりなどを受けて下落しました。その後、市場予想を上回る2021年10－12月期の米企業決算などから持ち直しましたが、ロシアがウクライナへ軍事侵攻するとの懸念から、世界経済の先行き不透明感が強まり、下落基調となりました。ロシアがウクライナへ軍事侵攻した後は、地政学的リスクの高まりなどから下落しましたが、FOMC（米連邦公開市場委員会）が市場予想と同じく0.25%の政策金利引き上げを決定し重要イベントを通過したことや、ロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待などから上昇しました。

2022年4月には、ロシアが一部東欧諸国への天然ガス供給を停止したこと、中国が経済活動への悪影響を覚悟の上で新型コロナウイルス感染拡大を封じ込める方針を維持していること、物価上昇による企業業績への警戒感が高まったことなどを背景に下落しましたが、当作成期末にかけては米株高を背景に上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

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

○当ファンドのポートフォリオ

【野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型】

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

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

・ポートフォリオ特性値

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

ポートフォリオ特性値	
組入比率	89.8%
カバー率	37.8%
平均行使価格	111.8%
平均行使期間	34.5日
配当利回り（年率、米ドル為替取引後ベース）※	3.5%
プレミアム（年率）	4.6%

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

- ・カバー率：純資産に対するオプションのポジション
- ・平均行使価格：原資産価格（株価）に対する平均権利行使価格
- ・平均行使期間：権利行使日までの平均日数
- ・配当利回り：純資産に対する予想配当利回り
- ・プレミアム（年率）：純資産に対する年率調整後のプレミアム収入

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

主要投資対象である〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドVーグローバル・ハイ・ディビデンド・エクイティ・プレミアム〕のポートフォリオにおける地域別比率は、当作成期末現在で、米州26.7%、欧州34.4%、アジア・太平洋28.8%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25.6%、生活必需品16.7%、通信11.7%となりました。

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

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

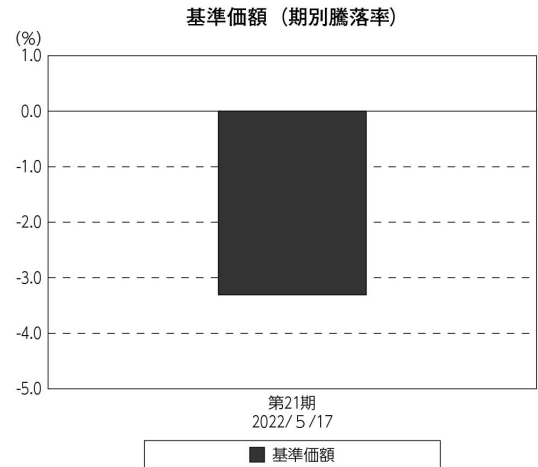
【野村マネー マザーファンド】

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

○分配金

収益分配については、分配原資の範囲内で、基準価額水準等を勘案して、分配を行ないました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1 万円当たり・税込み)

項 目	第21期
	2021年11月18日～ 2022年5月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.057%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	12,097

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

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

◎今後の運用方針

〔野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型〕

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

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

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

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

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

〔野村マネー マザーファンド〕

残存1年以内の公社債やコマーシャル・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。

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年11月18日～2022年5月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 87	% 0.480	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(34)	(0.191)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(49)	(0.273)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	87	0.482	
期中の平均基準価額は、18,046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。

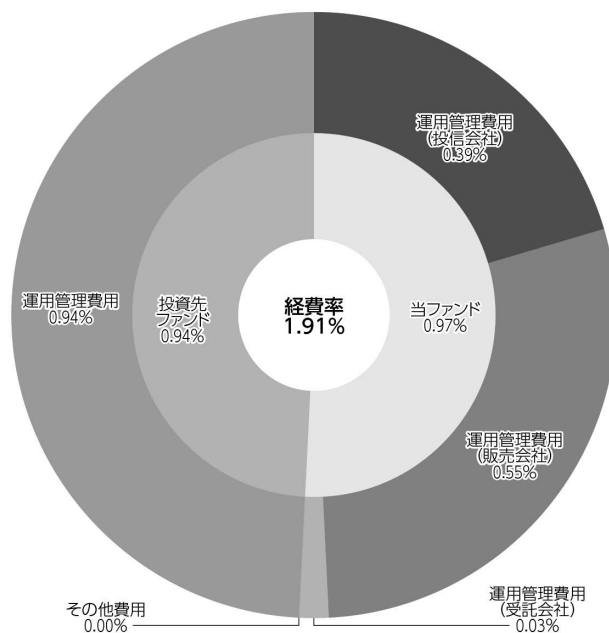
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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1.91%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	1.91
①当ファンドの費用の比率	0.97
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

(2021年11月18日～2022年5月17日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドⅣ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	口	千円	口	千円
		4,421	38,946	3,995	35,416

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年11月18日～2022年5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 5,757	百万円 30	% 0.5	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

(2022年5月17日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドV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	113,674	114,100	969,964	98.2
合 計	113,674	114,100	969,964	98.2

*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

(2022年5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	969,964	97.6
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	22,641	2.3
投資信託財産総額	993,607	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（2022年5月17日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	993,607,224
コール・ローン等	22,640,470
投資信託受益証券(評価額)	969,964,100
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,002,654
(B) 負債	5,589,984
未払収益分配金	562,107
未払信託報酬	5,010,847
未払利息	8
その他未払費用	17,022
(C) 純資産総額(A－B)	988,017,240
元本	562,107,205
次期繰越損益金	425,910,035
(D) 受益権総口数	562,107,205口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,577円

(注) 期首元本額は580,636,781円、期中追加設定元本額は17,086,718円、期中一部解約元本額は35,616,294円、1口当たり純資産額は1,7577円です。

○損益の状況（2021年11月18日～2022年5月17日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	40,188,435
受取配当金	40,189,749
支払利息	△ 1,314
(B) 有価証券売買損益	△ 69,079,697
売買益	1,197,524
売買損	△ 70,277,221
(C) 信託報酬等	△ 5,027,869
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 33,919,131
(E) 前期繰越損益金	177,320,862
(F) 追加信託差損益金	283,070,411
(配当等相当額)	(386,151,545)
(売買損益相当額)	(△103,081,134)
(G) 計(D＋E＋F)	426,472,142
(H) 収益分配金	△ 562,107
次期繰越損益金(G＋H)	425,910,035
追加信託差損益金	283,070,411
(配当等相当額)	(386,151,549)
(売買損益相当額)	(△103,081,138)
分配準備積立金	293,879,462
繰越損益金	△151,039,838

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

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

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

(注) 分配金の計算過程（2021年11月18日～2022年5月17日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年11月18日～ 2022年5月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	35,161,780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	386,151,549円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	259,279,789円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	680,593,118円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,107円
g. 分配金	562,107円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

○分配金のお知らせ

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。

Nomura Multi Managers Fund V – Global High Dividend Equity Premium

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

2021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なうことを基本とします。 ◆高配当株への投資に加えて、「株式プレミアム戦略」を活用し、さらなる収益の獲得を目指します。「株式プレミアム戦略」とは、保有する銘柄にかかるコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得を目指す戦略をいいます。		
投 資 態 度	●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%
	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なう場合があります。 ●株式プレミアム戦略によってさらなる収益の獲得を目指しますが、株価が権利行使価格を上回って値上がりした局面では、収益の一部を享受できない場合があります。 ●米ドル建て以外の資産に投資を行なった場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行ないます。ファンドには2つのクラス(日本円クラス、通貨セレクトクラス)があり、クラスごとに、組入資産について、原則として、米ドルを売り、各クラスの通貨(通貨セレクトクラスについては、米ドル以外の選定通貨)を買う為替取引を行なうことで、各通貨への投資効果を追求します。		
	<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・マーケッツ・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は、定期的に(原則、毎月)見直すこととします。 ●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%～30%程度の範囲内に維持することを基本とします。 ●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。 ●投資顧問会社が、高配当株や株式オプションの運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。 ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、高配当株や株式オプションの運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およびファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。 ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。		
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
2021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	409,141,251
(取得原価: 364,473,882米ドル)	
投資オプション契約時価(買い)	249,673
(取得原価: 329,056米ドル)	
現金預金等	34,147,025
デリバティブに係る未収証拠金	48,960
ブローカーからの未収金	1,571,138
未収収益	850,538
資産合計	446,008,585
負債	
投資オプション契約時価(売り)	3,931,639
(取得原価: 3,071,315米ドル)	
銀行借越金	44,397
外国為替先渡し契約に係る評価差損	1,365,212
受益証券買戻支払金	160,002
ブローカーへの未払金	873,547
未払費用	1,268,259
未払利息	5
負債合計	7,643,061
純資産総額	438,365,524

受益証券一口当たり情報:

	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産総額
日本円クラス(円)	8,953	447,437	4,005,974,076
通貨セレクトクラス(円)	2,958	12,289,049	36,350,011,146

運用計算書
2021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	1,404
受取配当金等(源泉徴収税控除後)	13,212,856
雑収益	22,273
収益合計	13,236,533
費用	
投資顧問報酬	4,201,770
事務管理代行報酬	460,134
保管費用	138,477
当座借越利息	2,834
取引銀行報酬	107,000
銀行手数料	106,501
受託報酬	92,116
法務報酬	12,646
立替費用	92,007
専門家報酬	37,780
キャピタルゲイン課税	14,790
雑費用	47,616
費用合計	5,313,671
純投資損益	7,922,862
投資有価証券売買に係る損益	31,349,961
オプション契約に係る損益	(10,492,049)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	27,041,558
当期実現純損益	47,899,470
投資有価証券評価損益の増減	97,902,696
オプション契約に係る評価損益の増減	(2,387,170)
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	1,113,432
当期評価差損益	96,628,958
運用の結果による純資産の増減額	152,451,290

純資産変動計算書
2021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	421,998,371
純投資損益	7,922,862
当期実現純損益	47,899,470
当期評価差損益	96,628,958
運用の結果による純資産の増減額	152,451,290
受益証券の発行手取金	34,529,115
受益証券の買戻支払金	(136,813,582)
	(102,284,467)
受益者への支払分配金	(33,799,670)
期末純資産総額	438,365,524

発行済受益証券数の変動表
2021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	388,797
発行受益証券数	138,718
買戻受益証券数	(80,078)
期末発行済受益証券数	447,437

通貨セレクトクラス

期首受益証券数	15,758,769
発行受益証券数	282,515
買戻受益証券数	(3,752,235)
期末発行済受益証券数	12,289,049

統計情報
2021年9月30日現在
(未監査)

	2021	2020	2019
期末純資産総額(米ドル)	438,365,524	421,998,371	697,119,768
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	4,005,974,076	2,876,286,672	3,361,982,245
期末1口当たり純資産価格	8,953	7,398	8,951
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	36,350,011,146	33,598,024,377	61,333,117,571
期末1口当たり純資産価格	2,958	2,132	3,208

組入資産明細
2021年9月30日現在
(金額は米ドル表示)

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
オーストラリア					
投資信託	69,064	CHARTER HALL GRO REIT	735,884	853,810	0.19
			735,884	853,810	0.19
普通株式	82,957	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA *	5,668,671	6,238,891	1.43
	168,615	BHP GROUP LTD *	5,166,614	4,571,352	1.04
	220,757	NTL AUSTRALIA BANK LTD *	4,082,749	4,428,665	1.01
	1,715,368	SOUTH32 LTD	3,350,954	4,321,204	0.99
	17,650	CSL LTD *	3,772,014	3,732,931	0.85
	182,976	WESTPAC BANKING CORP *	3,397,070	3,429,357	0.78
	19,241	MACQUARIE GROUP LTD	2,197,183	2,524,319	0.58
	62,279	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,784,684	2,107,766	0.48
	46,952	WISETECH GLOBAL	1,208,572	1,815,804	0.41
	345,584	SANTOS LTD	1,668,202	1,786,150	0.41
	23,070	RIO TINTO LTD	2,064,225	1,665,995	0.38
	50,995	WOOLWORTHS GROUP	1,282,698	1,446,497	0.33
	83,847	OZ MINERALS LTD	1,291,761	1,360,530	0.31
	74,344	CORPORATE TRAVEL	994,267	1,310,298	0.30
	318,390	QANTAS AIRWAYS LTD	1,127,198	1,301,331	0.30
	154,029	QBE INSURANCE	1,207,644	1,294,632	0.30
	85,249	BLUESCOPE STEEL LTD	1,246,681	1,259,761	0.29
	10,650	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	789,502	1,231,861	0.28
	187,827	NORTHERN STAR RE	1,377,364	1,150,859	0.26
	272,686	CSR LTD	1,078,071	1,098,803	0.25
	70,116	GOODMAN GROUP STAPLED	1,054,170	1,095,775	0.25
	137,817	BRAMBLES LTD	1,168,422	1,069,950	0.24
	49,333	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING	969,212	1,001,062	0.23
	257,820	EML PAYMENTS LTD	720,289	722,955	0.16
	63,573	FORTESCUE METALS	1,007,891	685,566	0.16
	113,301	BAPCOR LTD	576,736	618,265	0.14
	96,709	WEBJET LTD	365,693	441,979	0.10
	186,251	MIRVAC GROUP	400,561	401,435	0.09
	3,355	REA GROUP LTD	338,802	384,171	0.09
			51,357,900	54,498,164	12.44
		合計：オーストラリア	52,093,784	55,351,974	12.63
ベルギー					
普通株式	46,224	AGEAS NV	1,748,467	2,317,178	0.53
			1,748,467	2,317,178	0.53
		合計：ベルギー	1,748,467	2,317,178	0.53
バミューダ諸島					
普通株式	70,866	AXALTA COATING S	1,890,872	2,117,476	0.48
	580,000	KUNLUN ENERGY	536,352	604,738	0.14
	235,000	NINE DRAGONS PAP	359,650	289,381	0.07
	260,000	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCTURE	175,060	172,936	0.04
	230,000	K WAH INTL HLDGS	136,374	93,325	0.02
			3,098,308	3,277,856	0.75
		合計：バミューダ諸島	3,098,308	3,277,856	0.75
カナダ					
普通株式	65,665	ROGERS COMMUNI-B	3,381,693	3,076,406	0.70
	77,167	GILDAN ACTIVEWEA	1,678,165	2,884,502	0.66
			5,059,858	5,960,908	1.36
		合計：カナダ	5,059,858	5,960,908	1.36

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
ケイマン諸島					
普通株式	306,000	CHINA RES LAND	1,298,347	1,290,743	0.30
	162,000	CK ASSET HOLDINGS LTD	987,639	938,155	0.22
	240,000	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	332,867	718,043	0.17
	168,000	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	151,262	602,940	0.14
	66,000	HENGAN INTL	449,768	353,397	0.08
	37,000	CHAILEASE	349,378	327,231	0.07
	70,000	MINTH GROUP LTD	209,645	239,091	0.05
	100,000	CHINA YONGDA AUT	143,558	144,328	0.03
	55,000	CHINA MEDICAL SY	150,373	100,285	0.02
	50,000	SHIMAO GROUP HOL	124,788	91,553	0.02
	90,000	CIFI HOLDINGS GR	70,639	61,249	0.01
			4,268,264	4,867,015	1.11
		合計：ケイマン諸島	4,268,264	4,867,015	1.11
中国					
普通株式	3,360,000	CHINA CONSTRUCTION BANK H	2,603,034	2,407,446	0.54
	2,410,000	IND & COMM BANK OF CHINA LTD H	1,538,763	1,339,948	0.31
	154,000	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD H	1,002,109	830,526	0.19
	200,000	CHINA PACIFIC INSURANCE CO LTD H	628,448	594,517	0.14
	312,000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD H	360,365	316,093	0.07
			6,132,719	5,488,530	1.25
		合計：中国	6,132,719	5,488,530	1.25
デンマーク					
普通株式	142,659	SCANDINAVIAN TOB	2,209,341	2,834,105	0.65
			2,209,341	2,834,105	0.65
		合計：デンマーク	2,209,341	2,834,105	0.65
フランス					
普通株式	55,786	SANOFI	4,880,688	5,393,648	1.24
	56,783	PUBLICIS GROUPE	2,854,885	3,832,224	0.87
	136,022	AXA	2,481,255	3,790,529	0.86
	26,489	ARKEMA	2,248,582	3,513,338	0.80
	60,758	SANOFI- ADR	2,930,097	2,934,004	0.67
	264,744	ORANGE SA	3,094,198	2,861,347	0.65
	40,226	BNP PARIBAS	2,097,090	2,580,376	0.59
	169,323	DANONE- ADR	2,396,888	2,317,185	0.53
	26,550	ATOS ORIGIN	1,427,642	1,399,329	0.32
			24,411,325	28,621,980	6.53
		合計：フランス	24,411,325	28,621,980	6.53
ドイツ					
普通株式	20,212	ALLIANZ AG HOLDING REG	4,552,835	4,564,623	1.03
	60,054	FRESENIUS SE & CO.KGaA	2,411,470	2,888,863	0.66
	26,005	CONTINENTAL A. G.	2,816,733	2,853,464	0.65
	32,750	HENKEL KGAA AG & CO	3,072,720	2,835,034	0.65
	962,145	TELEFONICA DEUTS	2,662,821	2,742,060	0.63
	153,707	BAYER AG- ADR	2,993,606	2,098,101	0.48
	24,691	BAYER AG	1,493,580	1,346,762	0.31
			20,003,765	19,328,907	4.41
新株予約権	5,201	VITESCO TECH GR - FRACTION	348,235	301,461	0.07
			348,235	301,461	0.07
		合計：ドイツ	20,352,000	19,630,368	4.48
香港					
普通株式	100,000	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	1,386,656	1,250,667	0.28
	120,000	LINK REIT REIT	1,164,839	1,028,526	0.23

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
	340,000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,194,917	1,025,959	0.23
	78,000	AIA GROUP LTD	593,220	900,905	0.21
	8,500	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	354,851	523,676	0.12
	190,000	CHINA OVERSEAS LAND&INVEST LTD	587,155	432,803	0.10
	175,000	HANG LUNG PROPERTIES LTD	418,930	399,084	0.09
	292,000	GUANGDONG INVESTMENT LTD	449,907	380,943	0.09
	204,000	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING CO LTD	332,073	349,961	0.08
	100,000	CHINA RES POWER	263,891	288,270	0.07
	90,000	SINO LAND	162,887	121,112	0.03
			6,909,326	6,701,906	1.53
		合計：香港	6,909,326	6,701,906	1.53
		アイルランド			
普通株式	69,878	JAMES HARDIES INDUSTRIES CDI	2,223,402	2,532,180	0.58
			2,223,402	2,532,180	0.58
		合計：アイルランド	2,223,402	2,532,180	0.58
		イタリア			
普通株式	485,589	ENI SPA	7,043,473	6,446,188	1.46
	192,964	UNICREDIT SPA	1,440,139	2,566,521	0.59
	795,331	BANCA INTESA SPA	1,831,996	2,262,497	0.52
			10,315,608	11,275,206	2.57
		合計：イタリア	10,315,608	11,275,206	2.57
		日本			
普通株式	56,000	TOYOTA MOTOR CORP	744,673	1,001,074	0.22
	30,300	NIPPON TELG & TEL CORP	605,339	835,498	0.18
	15,400	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	634,621	828,776	0.18
	25,700	HONDA MOTOR CO LTD	715,613	793,650	0.17
	37,800	ORIX CORP	613,007	712,889	0.16
	31,100	mitsui & co ltd	510,527	684,934	0.16
	19,800	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	699,769	682,594	0.16
	20,500	KDDI CORP	585,486	676,310	0.15
	11,200	HITACHI LTD	482,570	664,712	0.15
	39,200	ASTELLAS PHARMA INC	599,679	645,567	0.15
	21,100	ITOCHU CORP	355,831	618,026	0.14
	99,500	mitsubishi ufj financial group	567,816	585,101	0.13
	15,800	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	551,805	556,983	0.13
	6,000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	297,424	516,929	0.12
	13,500	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	386,178	451,167	0.10
	7,900	ASAHI GROUP HOLDINGS	326,764	382,784	0.09
	12,100	mitsubishi corp	303,838	382,424	0.09
	2,200	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	246,414	371,648	0.08
	800	TOKYO ELECTRON LTD	127,237	355,166	0.08
	3,800	MURATA MANUFACTURING CO LTD	198,688	338,291	0.08
	13,800	KOMATSU LTD	327,722	332,419	0.08
	6,800	SUZUKI MOTOR CORP	300,836	303,593	0.07
	3,900	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	272,448	292,814	0.07
	42,500	CHIBA BANK LTD	276,355	276,926	0.06
	20,000	SOFTBANK CORP	261,985	270,737	0.06
	31,800	OBAYASHI CORP	317,383	264,053	0.06
	7,800	mitsui chemicals inc	223,055	262,487	0.06
	4,500	ABC-MART INC	267,155	254,603	0.06
	1,400	FUJITSU LTD	109,464	254,147	0.06
	10,600	CANON MARKETING	237,529	246,714	0.06
	5,400	FUJI ELECTRIC CO LTD	177,614	246,639	0.06
	4,800	WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	302,574	242,188	0.06
	59,000	ENEOS HOLDINGS INC	263,038	240,419	0.05
	7,400	TAISEI CORP	232,626	238,112	0.05
	16,700	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	246,356	236,514	0.05
	13,000	ANRITSU CORPORATION	246,423	232,392	0.05
	10,500	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	200,101	232,093	0.05
	9,300	SATO HOLDINGS CORP	205,800	226,764	0.05

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
4,000	TREND MICRO INC	208,618	222,381	0.05
14,000	NGK SPARK PLUG CO LTD	267,141	219,235	0.05
31,500	SHIKOKU ELEC PWR	294,549	218,484	0.05
13,100	CASIO COMPUTER CO LTD	217,461	217,436	0.05
1,300	HIROSE ELECTRIC	188,971	216,473	0.05
5,900	JSR CORPORATION	120,939	213,841	0.05
12,800	NISSHIN SEIFUN GROUP INC	207,005	212,914	0.05
17,000	PANASONIC CORP	167,695	211,209	0.05
11,200	SUBARU CORP	317,794	208,073	0.05
1,200	HIKARI TSUSHIN INC	198,184	202,610	0.05
3,900	AGC INC	157,669	201,484	0.05
8,600	PIGEON CORP	294,673	199,857	0.05
3,600	MEITEC CORPORATION	172,769	199,178	0.05
25,800	NISSHINBO HOLDINGS INC	185,297	195,552	0.04
2,800	NIPPON EXPRESS	174,218	193,207	0.04
5,500	DENKA CO LTD	169,186	193,198	0.04
2,000	ROHM CO LTD	188,349	190,204	0.04
5,500	AICA KOGYO CO	180,361	188,528	0.04
5,100	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	130,976	187,034	0.04
4,100	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	164,493	186,347	0.04
19,000	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	208,994	184,345	0.04
8,700	SCSK CORP	145,542	183,985	0.04
2,800	DENSO CORP	165,165	183,822	0.04
10,300	NGK INSULATORS LTD	205,498	175,196	0.04
2,100	NIPPON SHINYAKU CO LTD	149,969	174,562	0.04
5,000	MABUCHI MOTOR CO LTD	179,825	173,400	0.04
13,300	SANWA HOLDINGS CORP	138,050	173,086	0.04
10,000	SEKISUI CHEM CO	150,082	172,238	0.04
7,800	BROTHER INDS LTD	143,603	171,993	0.04
12,900	SANKI ENGINEERING CO LTD	141,805	170,993	0.04
6,400	NIHON UNISYS LTD	149,794	166,750	0.04
16,000	AMADA CO LTD	175,140	166,464	0.04
2,300	EAST JAPAN RAILWAY CO	149,412	161,214	0.04
5,600	HITACHI CONST MACH CO LTD	134,503	158,920	0.04
17,300	SENKO GROUP HOLDINGS	129,356	158,805	0.04
12,000	ISUZU MOTORS LTD	149,657	157,991	0.04
27,000	NIPPON SUISAN KAISHA LTD	115,475	157,106	0.04
6,600	KANAMOTO CO LTD	157,369	154,794	0.04
9,800	BELLSYSTEM24 HOLDINGS INC	139,231	146,282	0.03
16,000	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO LTD	182,584	145,728	0.03
3,200	NIPPON STEEL TRA	135,922	144,727	0.03
8,400	USS CO LTD	149,185	143,629	0.03
9,900	STAR MICRONICS CO LTD	137,483	137,775	0.03
5,600	EXEO GROUP INC	117,398	137,597	0.03
5,600	KEWPIE CORP	130,898	135,896	0.03
2,100	MEIJI HOLDINGS CO LTD	149,723	135,333	0.03
5,500	INABA DENKISANGYO CO LTD	124,005	134,206	0.03
3,100	AZBIL CORP	76,570	133,277	0.03
5,000	NICHIREI CORP	121,297	130,765	0.03
33,000	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	130,384	130,372	0.03
4,600	MTSUI MINING & SMELTING CO LTD	119,540	128,897	0.03
2,700	NOEVIR HOLDING CO LTD	139,201	128,629	0.03
14,000	MTSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	129,721	128,075	0.03
10,400	JAPAN LIFELINE	135,717	127,537	0.03
24,200	MTSUBISHI HC CAPITAL INC	103,002	127,186	0.03
3,500	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	125,776	127,168	0.03
6,500	MARUI GROUP CO LTD	120,342	126,189	0.03
3,300	EIZO CORP	131,565	126,095	0.03
2,700	SAWAI GROUP HOLD	135,782	125,492	0.03
7,000	TOYO TIRE CORP	100,447	125,447	0.03
2,100	KAO CORP	142,823	124,915	0.03
8,000	INABATA & CO	110,893	123,847	0.03
6,800	TOSOH CORP	106,851	123,625	0.03
20,000	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	105,050	123,346	0.03
13,500	ITOCHU ENEX CO	125,792	121,510	0.03
1,700	NITTO DENKO CORP	119,288	121,255	0.03
11,000	FURUKAWA CO	120,451	120,638	0.03

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
15,200	TANSEISHA CO LTD	109,012	120,236	0.03
2,900	TOKYO SEIMITSU CO LTD	133,318	119,624	0.03
4,500	COMSYS HOLDINGS CORP	110,415	118,614	0.03
6,300	EIKEN CHEMICAL CO LTD	116,560	118,533	0.03
3,800	NIFCO INC	95,030	118,368	0.03
11,000	SAKATA INX CORP	133,099	115,624	0.03
3,000	DENTSU GROUP INC	110,739	115,436	0.03
14,700	INPEX CORP	92,648	115,098	0.03
11,100	RICOH CO LTD	85,829	113,897	0.03
3,100	KYOWA KIRIN CO LTD	67,421	111,526	0.03
8,000	MTSUBISHI ELECTRIC CORP	108,559	111,334	0.03
2,000	OTSUKA CORP	91,200	102,610	0.02
4,300	STARTS CORP INC	96,980	102,427	0.02
4,000	TAIYO HOLDINGS CO LTD	99,439	101,859	0.02
3,500	LIXIL CORP	66,576	101,828	0.02
1,600	TOKYO OHKA KOGYO CO LTD	69,303	98,534	0.02
4,100	MTSUI FUDOSAN CO LTD	77,708	97,754	0.02
3,500	YAMAHA MOTOR CO LTD	87,590	97,605	0.02
3,000	ITOCHEU TECHNO-SOLUTIONS CORP	68,184	97,605	0.02
13,800	KITZ CORP	86,429	97,320	0.02
3,400	DIC CORP	117,039	96,183	0.02
12,000	DAICEL CORP	110,082	93,636	0.02
1,600	FUJIMI INC	55,897	92,528	0.02
4,100	MIXI INC	101,821	92,312	0.02
1,100	TOYOTA INDUSTRIES CORP	70,993	90,454	0.02
3,200	NISSHIN OILIO GRP	89,200	86,950	0.02
800	ADVANTEST CORP	47,985	71,720	0.02
7,700	OKI ELECTRIC INDUSTRY CO LTD	97,997	67,378	0.02
4,000	MTSUBISHI ESTATE CO LTD	64,846	63,658	0.01
7,700	PENTA-OCEAN CONSTRUCTION CO LTD	44,054	52,513	0.01
2,600	SUMCO CORP	36,042	52,311	0.01
2,000	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	51,189	47,462	0.01
8,000	OJI HOLDINGS CORPORATION	41,026	40,400	0.01
1,000	EN JAPAN INC	35,368	36,334	0.01
	合計：日本	27,353,829	30,806,155	7.03
	ジャージー	27,353,829	30,806,155	7.03
普通株式				
298,313	WPP PLC ORD GBP 0.1	3,489,395	4,010,074	0.91
55,382	AMCOR PLC-CDI	618,360	657,917	0.15
	合計：ジャージー	4,107,755	4,667,991	1.06
	ルクセンブルグ	4,107,755	4,667,991	1.06
普通株式				
400,405	SES SA	3,102,527	3,559,998	0.81
54,880	RTL GROUP	3,368,424	3,273,297	0.75
	合計：ルクセンブルグ	6,470,951	6,833,295	1.56
	オランダ	6,470,951	6,833,295	1.56
普通株式				
248,514	ING GROEP NV - CVA	3,095,197	3,657,760	0.83
58,423	AIRBUS - ADR	824,349	1,950,744	0.45
	合計：オランダ	3,919,546	5,608,504	1.28
	ニュージーランド	3,919,546	5,608,504	1.28
普通株式				
839	XERO LTD	37,436	84,066	0.02
	合計：ニュージーランド	37,436	84,066	0.02

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
ノルウェー					
普通株式	119,696	DNB BK ASA REG SHS	1,564,841	2,734,823	0.62
			1,564,841	2,734,823	0.62
		合計：ノルウェー	1,564,841	2,734,823	0.62
韓国					
普通株式	61,500	SAMSUNG ELECT CO LTD N/VOTING SHS	2,158,968	3,614,423	0.82
	8,100	HYUNDAI MOTOR CO LTD PREFERENCE	650,891	660,035	0.15
	2,300	SK TELECOM CO LTD	627,184	629,256	0.14
	51,000	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	386,918	551,232	0.13
	11,000	KB FINANCIAL GRO	442,488	513,656	0.12
	9,300	DB INSURANCE CO LTD	408,907	499,453	0.11
	1,100	KOREA ZINC CO LTD	342,258	467,213	0.11
	4,500	KOREA TOBACCO & GINSENG CORP	410,105	308,548	0.07
	350	LG CHEM-PREFER	135,372	110,977	0.03
			5,563,091	7,354,793	1.68
		合計：韓国	5,563,091	7,354,793	1.68
ロシア					
普通株式	316,189	GAZPROM- ADR	1,542,991	3,140,389	0.71
	32,782	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,946,855	3,095,932	0.71
			3,489,846	6,236,321	1.42
		合計：ロシア	3,489,846	6,236,321	1.42
シンガポール					
投資信託	570,000	LENDLEASE GLOBAL REIT	372,638	364,404	0.08
			372,638	364,404	0.08
普通株式	93,051	DBS GROUP HOLDING LTD	1,437,483	2,073,194	0.48
	68,508	UTD OVERSEAS BANK LTD UOB	1,199,654	1,301,342	0.30
	72,588	OVERSEAS CHINESE BANKING CORP LTD	542,574	613,412	0.14
	163,000	SINGAPORE TECH ENGINEERING	436,428	456,354	0.10
	145,000	SINGAPORE TELECO	386,249	262,115	0.06
			4,002,388	4,706,417	1.08
		合計：シンガポール	4,375,026	5,070,821	1.16
スペイン					
普通株式	300,502	REPSOL SA	5,057,682	3,900,590	0.89
			5,057,682	3,900,590	0.89
		合計：スペイン	5,057,682	3,900,590	0.89
スイス					
普通株式	47,228	SWISS RE AG	4,030,663	4,046,527	0.92
	8,972	SWATCH GROUP-BR	1,758,117	2,359,031	0.54
			5,788,780	6,405,558	1.46
		合計：スイス	5,788,780	6,405,558	1.46
台湾					
普通株式	321,000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUF CO LTD	2,135,064	6,693,459	1.53
	600,000	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	1,984,293	2,264,947	0.52
	1,300,000	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	941,658	1,070,278	0.24
	238,000	FORMOSA PLASTICS CORP	802,933	971,159	0.22
	260,000	E INK HOLDINGS	346,662	689,838	0.16
	5,615	TAIWAN SEMIC- ADR	328,962	633,597	0.14
	67,878	MAKALOT	446,654	601,539	0.14
	50,000	GIANT MANUFACTUR	585,110	572,528	0.13
	19,000	GLOBAL WAFERS	316,610	543,048	0.12
	65,018	TONG HSING ELECTRONIC INDUSTRIES LT	255,955	528,274	0.12
	430,000	TECO ELECTRIC & MACHINERY CO LTD	324,763	483,099	0.11

	数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
	450,000	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	409,440	399,601	0.09
	12,000	WIWYNN CORP	157,690	375,334	0.09
	17,000	KING SLIDE WORKS CO LTD	198,608	237,136	0.05
	35,000	CHROMA ATE	204,220	221,462	0.05
	110,000	PRIMAX ELECTRONICS LTD	174,621	202,875	0.05
			9,613,243	16,488,174	3.76
		合計：台湾	9,613,243	16,488,174	3.76
		タイ			
普通株式	1,500,000	PTT PCL/FOREIGN	1,972,492	1,729,739	0.39
	210,000	TISCO FINANCIAL GROUP PUB CO NVDR	454,346	569,705	0.13
	1,300,000	DIGITAL TELECOMMUNICATIONS F	461,779	495,858	0.11
	1,290,000	WHA CORP PCL-F	133,643	119,006	0.03
			3,022,260	2,914,308	0.66
		合計：タイ	3,022,260	2,914,308	0.66
		イギリス			
普通株式	7,988,332	CENTRICA PLC	18,137,297	6,084,331	1.38
	1,509,702	TESCO PLC	5,692,536	5,150,662	1.17
	1,144,869	WM MORRISON SUPERMARKETS PLC	3,131,457	4,540,022	1.04
	230,544	GLAXOSMITHKLINE PLC	4,236,087	4,357,319	0.99
	1,759,012	BT GROUP PLC	3,474,980	3,805,747	0.87
	1,157,858	NATWEST GROUP PL	3,548,318	3,491,120	0.80
	162,215	IMPERIAL BRANDS PLC	2,917,855	3,403,879	0.78
	632,359	HSBC HOLDINGS PL	4,174,399	3,328,791	0.76
	334,444	PEARSON PLC	3,192,675	3,222,564	0.74
	424,803	STANDARD CHARTERED PLC	4,138,815	2,495,452	0.57
	45,697	UNILEVER PLC- ADR	2,535,063	2,479,062	0.57
	65,983	ANGLO AMER PLC	1,445,920	2,331,418	0.53
	75,665	BP PLC- ADR	2,862,986	2,054,305	0.47
	61,791	BAE SYSTEMS - ADR	1,738,618	1,900,691	0.43
	50,703	BRIT AMER TO- ADR	2,011,894	1,806,548	0.41
			63,238,900	50,451,911	11.51
		合計：イギリス	63,238,900	50,451,911	11.51
		アメリカ			
普通株式	32,533	MICROSOFT CORP *	5,139,163	9,316,800	2.12
	42,970	APPLE INC *	1,592,982	6,158,889	1.39
	107,467	WELLS FARGO & CO *	4,616,084	5,033,753	1.14
	65,232	CITIGROUP INC *	3,490,994	4,643,865	1.05
	75,519	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,947,486	4,216,225	0.96
	62,508	CISCO SYSTEMS INC	1,977,049	3,481,071	0.79
	9,856	META PLATFORMS I *	2,132,895	3,365,134	0.77
	28,873	RALPH LAUREN COR	2,881,988	3,322,127	0.76
	61,217	GENERAL MOTORS CO	2,066,496	3,232,870	0.74
	30,633	MORGAN STANLEY	1,368,587	3,054,110	0.70
	18,092	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,482,268	3,008,519	0.69
	7,745	ANTHEM INC	2,088,798	3,006,764	0.69
	9,926	LABORATORY CP	1,891,338	2,873,081	0.66
	39,675	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,771,027	2,793,120	0.64
	10,220	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,493,196	2,720,666	0.62
	23,956	FISERV INC	2,761,157	2,644,503	0.60
	978	ALPHABET INC A *	1,408,799	2,643,104	0.60
	39,960	APOLLO GLOBAL MA	2,165,172	2,503,894	0.57
	24,621	DOLLAR TREE INC	2,185,142	2,393,161	0.55
	40,847	COMCAST CORP A *	1,325,160	2,321,539	0.53
	843	ALPHABET INC C	1,215,780	2,277,811	0.52
	33,117	CONOCOPHILLIPS	1,570,870	2,263,216	0.52
	2,526	FIRST CITIZENS-A	2,160,827	2,202,470	0.50
	10,443	CIGNA CORP	1,848,202	2,149,483	0.49
	28,311	COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP A *	1,944,403	2,145,974	0.49
	12,615	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,041,732	1,889,979	0.43
	16,486	ROSS STORES INC	1,676,842	1,849,729	0.42

数量	銘柄名	取得時価	評価金額	純資産比率(%)
20,142	HOWARD HUGHES CORP	1,833,724	1,786,394	0.41
6,678	CACI INTL-A	1,694,569	1,776,882	0.41
27,662	STEEL DYNAMICS	1,418,690	1,671,615	0.38
35,777	FIDELITY NATIONA	1,217,895	1,658,264	0.38
27,334	DENTSPLY SIRONA INC	1,501,018	1,614,893	0.37
45,836	EQUITABLE HOLDIN	831,144	1,392,956	0.32
22,367	MARATHON PETROLEUM CORP	889,445	1,387,649	0.32
6,950	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,256,931	1,376,726	0.31
27,610	EXELON CORP	926,087	1,337,981	0.31
10,370	SEMPRA ENERGY	1,409,752	1,333,271	0.30
7,221	LEAR CORP	1,267,508	1,150,161	0.26
42,951	NISOURCE INC	996,875	1,041,562	0.24
11,919	AMERICAN ELECTRI	954,282	981,291	0.22
15,033	PUBLIC SERV ENTERPRISE GROUP	810,166	925,882	0.21
20,466	CDK GLOBAL INC	983,375	879,424	0.20
58,593	VIATRIS INC	1,020,618	814,443	0.19
9,024	RAYTHEON TECHNOL	666,389	783,825	0.18
8,603	CVS HEALTH CORPORATION	548,102	750,268	0.17
10,360	COCA-COLA	577,287	549,391	0.13
合計：アメリカ		82,048,294	110,724,735	25.25
組入資産合計		364,473,882	409,141,251	93.33

* 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

2021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

2021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	80,776	JPY	8,880,000	2021年10月12日	1,399
USD	27,386	JPY	3,010,620	2021年10月12日	474
USD	13,666	JPY	1,502,370	2021年10月12日	237
IDR	271,300,000,000	USD	18,728,427	2021年10月25日	179,153
INR	1,598,250,000	USD	21,364,693	2021年10月25日	105,375
IDR	238,400,000,000	USD	16,553,831	2021年10月8日	88,610
USD	1,185,919	ZAR	17,000,000	2021年11月2日	66,159
INR	1,115,000,000	USD	14,945,579	2021年10月8日	61,483
USD	10,429,956	ZAR	157,000,000	2021年10月8日	52,124
USD	15,026,954	INR	1,115,000,000	2021年10月8日	19,892
IDR	272,400,000,000	USD	18,951,542	2021年11月2日	16,720
IDR	238,400,000,000	USD	16,541,196	2021年12月3日	4,298
USD	16,644,557	IDR	238,400,000,000	2021年10月8日	2,116
INR	1,115,000,000	USD	14,936,349	2021年12月3日	(15,442)
ZAR	157,000,000	USD	10,349,310	2021年12月3日	(54,791)
IDR	204,000,000,000	USD	14,251,283	2021年11月18日	(72,144)
MXN	438,000,000	USD	21,380,768	2021年10月29日	(83,617)
INR	768,250,000	USD	10,452,807	2021年11月2日	(141,607)
ZAR	205,500,000	USD	13,698,831	2021年10月25日	(147,386)
INR	1,131,500,000	USD	15,311,625	2021年11月18日	(147,645)
BRL	74,200,000	USD	13,758,575	2021年11月30日	(193,098)

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)
MXN	300,000,000	USD	14,738,031	2021年11月30日	(222,808)
BRL	67,500,000	USD	12,662,098	2021年11月12日	(282,386)
ZAR	143,000,000	USD	9,749,320	2021年11月18日	(352,331)
MXN	350,000,000	USD	17,430,157	2021年11月12日	(448,485)
MXN	411,000,000	USD	20,529,019	2021年10月15日	(500,974)
ZAR	157,000,000	USD	10,910,968	2021年10月8日	(533,136)
BRL	117,200,000	USD	22,194,237	2021年10月15日	(602,236)
ZAR	212,500,000	USD	14,687,096	2021年11月2日	(690,090)
BRL	140,500,000	USD	26,645,678	2021年10月29日	(815,567)
JPY	975,000	USD	8,869	2021年10月12日	(154)
JPY	975,000	USD	8,869	2021年10月25日	(154)
JPY	3,515,000	USD	32,160	2021年10月12日	(740)
JPY	1,891,706,578	USD	17,205,308	2021年10月12日	(295,504)
JPY	1,912,678,399	USD	17,406,718	2021年10月25日	(307,870)
USD	50,847,433	GBP	36,795,644	2021年10月13日	1,384,006
USD	66,929,163	EUR	56,742,952	2021年10月13日	1,068,072
USD	16,005,230	JPY	1,760,000,000	2021年10月15日	272,417
USD	15,269,891	JPY	1,680,000,000	2021年10月8日	252,941
USD	7,927,002	KRW	9,200,000,000	2021年10月8日	159,560
USD	18,074,031	TWD	500,000,000	2021年10月8日	98,385
USD	2,915,229	THB	95,500,000	2021年10月15日	92,980
USD	6,780,661	CHF	6,234,556	2021年12月15日	89,596
USD	14,072,895	AUD	19,407,250	2021年10月29日	81,516
USD	14,072,837	AUD	19,407,250	2021年10月29日	81,458
USD	14,072,391	AUD	19,407,250	2021年10月29日	81,011
USD	14,070,943	AUD	19,407,250	2021年10月29日	79,564
USD	15,976,621	JPY	1,780,000,000	2021年11月10日	62,093
USD	5,018,393	SGD	6,750,000	2021年10月15日	58,434
USD	16,944,875	TWD	470,000,000	2021年11月10日	48,241
USD	2,906,324	DKK	18,303,150	2021年12月15日	45,421
USD	2,613,344	NOK	22,598,476	2021年12月15日	44,742
USD	19,285,718	HKD	150,000,000	2021年10月15日	23,877
USD	7,354,837	KRW	8,700,000,000	2021年11月10日	13,753
USD	906,472	JPY	100,000,000	2021年10月8日	12,606
USD	727,544	JPY	80,000,000	2021年10月15日	12,416
USD	91,027	THB	3,000,000	2021年10月15日	2,371
USD	74,638	THB	2,500,000	2021年10月15日	757
USD	147,263	SGD	200,000	2021年10月15日	302
HKD	5,000,000	USD	642,484	2021年10月15日	(423)
CHF	299,958	USD	324,932	2021年12月15日	(3,011)
TWD	15,000,000	USD	542,299	2021年10月8日	(3,030)
KRW	350,000,000	USD	299,017	2021年10月8日	(3,517)
JPY	70,000,000	USD	638,966	2021年10月15日	(13,229)
KRW	8,850,000,000	USD	7,485,979	2021年10月8日	(14,037)
TWD	485,000,000	USD	17,458,603	2021年10月8日	(22,226)
JPY	1,780,000,000	USD	15,972,950	2021年10月8日	(62,133)
					(1,365,212)

注記２ーオプション契約

2021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	321	P ASS1 6950 16/12/21	2021年12月16日	329,056	249,673	(79,383)
				329,056	249,673	(79,383)

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
売り持ちポジション						
AUD	(12, 094)	C BHP AT 51.5 06/10/21 OTC	2021年10月 6 日	(18, 118)	0	18, 118
AUD	(4, 916)	C RIO AT 127.8662 06/10/21 OTC	2021年10月 6 日	(10, 023)	0	10, 023
JPY	(5, 500)	C 4901 JT 10536.29 01/10/21 OTC	2021年10月 1 日	(98)	0	98
JPY	(15, 000)	C 8766 JT 6470.625 01/10/21 OTC	2021年10月 1 日	(84)	0	84
JPY	(29, 000)	C 9432 JT 3332.7666 01/10/21 OTC	2021年10月 1 日	(84)	0	84
GBP	(8, 907)	C AAL LN 29.646 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1, 659)	(1, 415)	244
GBP	(24, 146)	C AAL LN 31.97751 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(13, 492)	(1, 402)	12, 090
USD	(127)	C AAPL UW 148 05/11/21	2021年11月 5 日	(55, 882)	(40, 640)	15, 242
USD	(7)	C AAPL UW 149.5 12/11/21 FLEX	2021年11月12日	(1, 832)	(2, 037)	(205)
USD	(33)	C AAPL UW 155 08/10/21	2021年10月 8 日	(10, 986)	(198)	10, 788
USD	(18)	C AAPL UW 155 15/10/21	2021年10月15日	(4, 020)	(306)	3, 714
USD	(22)	C AAPL UW 155 19/11/21	2021年11月19日	(7, 185)	(3, 696)	3, 489
USD	(50)	C AAPL UW 155 22/10/21	2021年10月22日	(26, 351)	(1, 700)	24, 651
USD	(39)	C AEP UW 90 15/10/21	2021年10月15日	(6, 738)	(273)	6, 465
USD	(14)	C AEP UW 90 19/11/21	2021年11月19日	(2, 452)	(294)	2, 158
EUR	(9, 360)	C AGS BB 42.2836 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1, 486)	(13, 965)	(12, 479)
EUR	(9, 360)	C AGS BB 45.0207 09/12/21 OTC	2021年12月 9 日	(5, 245)	(11, 320)	(6, 075)
EUR	(9, 360)	C AGS BB 46.6877 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6, 358)	(5, 394)	964
EUR	(9, 707)	C AGS BB 49.1939 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(6, 178)	(1, 906)	4, 272
USD	(56)	C AIG UN 55 05/11/21	2021年11月 5 日	(11, 788)	(16, 800)	(5, 012)
USD	(57)	C AIG UN 55 15/10/21	2021年10月15日	(9, 905)	(11, 172)	(1, 267)
USD	(61)	C AIG UN 55 19/11/21	2021年11月19日	(17, 310)	(20, 923)	(3, 613)
USD	(35)	C AIG UN 55 29/10/21	2021年10月29日	(6, 117)	(8, 995)	(2, 878)
USD	(6)	C AIG UN 56 01/10/21	2021年10月 1 日	(815)	(240)	575
USD	(81)	C AIG UN 56 22/10/21	2021年10月22日	(11, 389)	(13, 932)	(2, 543)
USD	(43)	C AIG UN 56.26 08/10/21 FLEX	2021年10月 8 日	(6, 569)	(3, 334)	3, 235
EUR	(7, 416)	C AKE FP 110.0247 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(10, 762)	(43, 351)	(32, 589)
EUR	(6, 887)	C AKE FP 111.9833 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(11, 415)	(40, 083)	(28, 668)
EUR	(3, 974)	C AKE FP 118.5096 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2, 316)	(2, 774)	(458)
EUR	(6, 887)	C AKE FP 123.3232 09/12/21 OTC	2021年12月 9 日	(14, 171)	(10, 226)	3, 945
AUD	(14, 624)	C ALL AT 45.0296 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(8, 078)	(23, 261)	(15, 183)
AUD	(11, 000)	C ALL AT 45.6263 10/11/21 OTC	2021年11月10日	(6, 926)	(16, 549)	(9, 623)
AUD	(13, 139)	C ALL AT 47.9912 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(3, 846)	(4, 376)	(530)
EUR	(4, 092)	C ALV GY 197.8979 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3, 085)	(10, 133)	(7, 048)
EUR	(4, 092)	C ALV GY 206.4017 09/12/21 OTC	2021年12月 9 日	(10, 759)	(12, 198)	(1, 439)
EUR	(4, 365)	C ALV GY 212.6701 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(11, 658)	(4, 148)	7, 510
EUR	(2, 829)	C ALV GY 221.5723 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(9, 812)	(272)	9, 540
AUD	(22, 113)	C AMC AT 17.2569 22/12/21 OTC	2021年12月22日	(3, 306)	(3, 619)	(313)
AUD	(33, 269)	C AMC AT 17.514 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(4, 850)	(1, 175)	3, 675
USD	(1)	C ANTM UN 380 01/10/21	2021年10月 1 日	(654)	(900)	(246)
USD	(10)	C ANTM UN 385 05/11/21	2021年11月 5 日	(12, 108)	(12, 400)	(292)
USD	(11)	C ANTM UN 390 15/10/21	2021年10月15日	(6, 135)	(8, 360)	(2, 225)
USD	(12)	C ANTM UN 395 29/10/21	2021年10月29日	(5, 374)	(10, 224)	(4, 850)
AUD	(215)	C ANZ AT 28.5 21/10/21	2021年10月21日	(7, 158)	(5, 269)	1, 889
AUD	(19, 744)	C ANZ AT 29.8244 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(4, 387)	(1, 119)	3, 268
USD	(107)	C APO UN 60 15/10/21	2021年10月15日	(24, 935)	(28, 676)	(3, 741)
USD	(44)	C APO UN 63 22/10/21	2021年10月22日	(5, 886)	(9, 460)	(3, 574)
USD	(28)	C APO UN 65 19/11/21	2021年11月19日	(4, 981)	(5, 880)	(899)
USD	(11, 200)	C AXTA UN 30.028 19/10/21 OTC	2021年10月19日	(6, 690)	(12, 165)	(5, 475)
USD	(206)	C AXTA UN 32 15/10/21	2021年10月15日	(18, 707)	(10, 918)	7, 789
USD	(5, 000)	C BAESY UV 30.866 03/11/21 OTC	2021年11月 3 日	(1, 396)	(1, 434)	(38)
USD	(4, 000)	C BAESY UV 30.9 26/10/21 OTC	2021年10月26日	(2, 782)	(868)	1, 914
USD	(3, 400)	C BAESY UV 31.13 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(1, 210)	(947)	263
USD	(2, 000)	C BAESY UV 31.225 10/11/21 OTC	2021年11月10日	(1, 249)	(422)	827
USD	(3, 400)	C BAESY UV 31.436 06/10/21 OTC	2021年10月 6 日	(2, 317)	(85)	2, 232
USD	(10, 000)	C BAESY UV 33.079 12/10/21 OTC	2021年10月12日	(6, 681)	(7)	6, 674

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	(61,303)	C BAP AT 8.1492 24/11/21 OTC	2021年11月24日	(8,381)	(3,958)	4,423
EUR	(3,333)	C BAYN GY 50.0234 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(618)	(722)	(104)
EUR	(3,333)	C BAYN GY 52.5863 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(2,076)	(2,198)	(122)
EUR	(3,333)	C BAYN GY 53.725 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(2,124)	(968)	1,156
EUR	(3,456)	C BAYN GY 57.9584 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(2,083)	(51)	2,032
AUD	(25,329)	C BHP AT 42.2456 08/12/21 OTC	2021年12月8日	(8,661)	(8,572)	89
AUD	(18,813)	C BHP AT 43.5184 24/11/21 OTC	2021年11月24日	(5,230)	(2,858)	2,372
AUD	(227)	C BHP AT 45.5 18/11/21	2021年11月18日	(11,343)	(1,473)	9,870
AUD	(285)	C BHP AT 46 16/12/21	2021年12月16日	(14,819)	(3,184)	11,635
AUD	(15,113)	C BHP AT 47.0916 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(6,672)	(495)	6,177
AUD	(15,026)	C BHP AT 50.3014 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(12,297)	(1)	12,296
AUD	(15,151)	C BHP AT 50.3403 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(12,133)	(15)	12,118
AUD	(14,764)	C BHP AT 51.8346 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(11,207)	(32)	11,175
EUR	(8,145)	C BNP FP 55.2113 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,684)	(14,806)	(12,122)
EUR	(5,631)	C BNP FP 55.8291 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(5,698)	(8,945)	(3,247)
EUR	(5,430)	C BNP FP 56.6848 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(4,959)	(11,440)	(6,481)
EUR	(5,430)	C BNP FP 57.3097 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,089)	(12,389)	(7,300)
USD	(71)	C BP UN 26 08/10/21	2021年10月8日	(2,326)	(9,585)	(7,259)
USD	(247)	C BP UN 27 05/11/21	2021年11月5日	(17,399)	(30,134)	(12,735)
USD	(22)	C BP UN 27 22/10/21	2021年10月22日	(594)	(2,112)	(1,518)
AUD	(24,171)	C BSL AT 27.8217 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(8,356)	(140)	8,216
AUD	(22,978)	C BSL AT 28.7655 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(6,069)	(479)	5,590
GBP	(237,466)	C BT/A LN 1.71886 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1,758)	(2,867)	(1,109)
GBP	(237,466)	C BT/A LN 1.81959 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(7,860)	(6,119)	1,741
GBP	(237,466)	C BT/A LN 1.96115 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(8,417)	(2,257)	6,160
GBP	(246,261)	C BT/A LN 2.05091 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(10,640)	(288)	10,352
AUD	(411)	C BXB AT 11.25 16/12/21	2021年12月16日	(5,395)	(6,222)	(827)
AUD	(46,618)	C BXB AT 11.8031 22/12/21 OTC	2021年12月22日	(6,191)	(3,041)	3,150
AUD	(50,041)	C BXB AT 12.6511 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(6,866)	(348)	6,518
USD	(76)	C C UN 70 19/11/21	2021年11月19日	(13,662)	(27,436)	(13,774)
USD	(62)	C C UN 72 01/10/21	2021年10月1日	(11,765)	(1,736)	10,029
USD	(34)	C C UN 72 29/10/21	2021年10月29日	(6,497)	(7,378)	(881)
USD	(28)	C C UN 73 08/10/21	2021年10月8日	(3,491)	(1,484)	2,007
USD	(93)	C C UN 75 15/10/21	2021年10月15日	(19,322)	(4,464)	14,858
USD	(30)	C CACI UN 270 19/11/21	2021年11月19日	(10,470)	(23,730)	(13,260)
AUD	(74)	C CBA AT 100 21/10/21	2021年10月21日	(9,176)	(26,405)	(17,229)
AUD	(6,459)	C CBA AT 102.2792 01/10/21 OTC	2021年10月1日	(9,430)	(9,627)	(197)
AUD	(7,290)	C CBA AT 103.184 06/10/21 OTC	2021年10月6日	(8,100)	(8,903)	(803)
AUD	(7,302)	C CBA AT 103.6171 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(9,941)	(9,712)	229
AUD	(16)	C CBA AT 104 16/12/21	2021年12月16日	(2,241)	(4,302)	(2,061)
AUD	(68)	C CBA AT 104.01 18/11/21	2021年11月18日	(7,679)	(15,048)	(7,369)
AUD	(10,473)	C CBA AT 109.35 22/12/21 OTC	2021年12月22日	(11,232)	(11,413)	(181)
USD	(41)	C CDK UW 42.03 15/10/21 FLEX	2021年10月15日	(3,352)	(5,630)	(2,278)
USD	(10)	C CDK UW 42.5 25/10/21 FLEX	2021年10月25日	(1,078)	(1,431)	(353)
USD	(10)	C CDK UW 43.5 19/11/21 FLEX	2021年11月19日	(1,278)	(1,505)	(227)
AUD	(37,932)	C CHC AT 17.9242 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(9,609)	(6,649)	2,960
USD	(23)	C CI UN 210 05/11/21	2021年11月5日	(11,933)	(11,730)	203
USD	(7)	C CI UN 215 01/10/21	2021年10月1日	(2,911)	(84)	2,827
USD	(9)	C CI UN 215 22/10/21	2021年10月22日	(2,601)	(1,800)	801
USD	(7)	C CI UN 220 19/11/21	2021年11月19日	(2,644)	(2,100)	544
USD	(37)	C CMCSA UW 57.5 19/11/21	2021年11月19日	(5,948)	(6,290)	(342)
USD	(22)	C CMCSA UW 60 08/10/21	2021年10月8日	(2,425)	(88)	2,337
USD	(45)	C CMCSA UW 60 19/11/21	2021年11月19日	(4,690)	(3,780)	910
USD	(47)	C CMCSA UW 61 22/10/21	2021年10月22日	(5,541)	(564)	4,977
USD	(16)	C CMCSA UW 62 08/10/21	2021年10月8日	(1,532)	(112)	1,420
USD	(16)	C CMCSA UW 62.5 15/10/21	2021年10月15日	(1,484)	(80)	1,404
GBP	(894,693)	C CNA LN 0.55121 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(5,909)	(34,084)	(28,175)

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)
GBP	(862, 739)	C CNA LN 0.58102 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6, 822)	(29, 898)	(23, 076)
GBP	(862, 739)	C CNA LN 0.58815 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2, 838)	(12, 142)	(9, 304)
USD	(59)	C COF UN 164.4 15/10/21	2021年10月15日	(18, 448)	(30, 975)	(12, 527)
USD	(22)	C COF UN 180 08/10/21	2021年10月8日	(8, 205)	(990)	7, 215
EUR	(3, 510)	C CON GY 122.994 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5, 151)	(18, 704)	(13, 553)
EUR	(3, 510)	C CON GY 126.5398 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6, 223)	(10, 987)	(4, 764)
EUR	(3, 640)	C CON GY 135.818 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(6, 066)	(1, 730)	4, 336
USD	(13)	C COP UN 56.96 08/10/21 FLEX	2021年10月8日	(1, 973)	(14, 768)	(12, 795)
USD	(40)	C COP UN 59 29/10/21	2021年10月29日	(6, 671)	(31, 800)	(25, 129)
USD	(37)	C COP UN 60 15/10/21	2021年10月15日	(6, 908)	(31, 635)	(24, 727)
USD	(19)	C COP UN 60 19/11/21	2021年11月19日	(2, 789)	(17, 100)	(14, 311)
USD	(40)	C COP UN 65.3 12/11/21 FLEX	2021年11月12日	(10, 911)	(19, 517)	(8, 606)
EUR	(19, 043)	C CS FP 23.1763 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(6, 831)	(24, 398)	(17, 567)
EUR	(18, 362)	C CS FP 23.8598 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2, 646)	(12, 338)	(9, 692)
EUR	(18, 362)	C CS FP 24.6789 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(6, 810)	(13, 488)	(6, 678)
EUR	(18, 362)	C CS FP 25.6285 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(9, 009)	(4, 442)	4, 567
USD	(31)	C CSCO UW 56 03/11/21 FLEX	2021年11月3日	(3, 031)	(4, 002)	(971)
USD	(42)	C CSCO UW 57 05/11/21	2021年11月5日	(3, 266)	(3, 066)	200
USD	(42)	C CSCO UW 57.5 19/11/21	2021年11月19日	(7, 172)	(4, 662)	2, 510
USD	(36)	C CSCO UW 60 08/10/21	2021年10月8日	(3, 105)	(36)	3, 069
USD	(68)	C CSCO UW 60 15/10/21	2021年10月15日	(5, 696)	(340)	5, 356
USD	(62)	C CSCO UW 60 22/10/21	2021年10月22日	(6, 713)	(496)	6, 217
AUD	(2, 555)	C CSL AT 301.0803 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(9, 266)	(3, 524)	5, 742
AUD	(23)	C CSL AT 312.01 21/10/21	2021年10月21日	(6, 008)	(1, 409)	4, 599
AUD	(3, 773)	C CSL AT 315.5029 22/12/21 OTC	2021年12月12日	(10, 247)	(10, 686)	(439)
AUD	(5)	C CSL AT 328 16/12/21	2021年12月16日	(2, 457)	(604)	1, 853
AUD	(105, 715)	C CSR AT 6.012 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(7, 630)	(3, 194)	4, 436
AUD	(614)	C CSR AT 6.11 16/12/21	2021年12月16日	(3, 443)	(3, 983)	(540)
AUD	(105, 562)	C CSR AT 6.4314 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(5, 379)	(200)	5, 179
AUD	(23, 466)	C CTD AT 24 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(7, 177)	(19, 537)	(12, 360)
AUD	(25, 897)	C CTD AT 25 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(11, 052)	(22, 215)	(11, 163)
USD	(45)	C CTSH UW 77 08/11/21 FLEX	2021年11月8日	(11, 419)	(9, 341)	2, 078
USD	(24)	C CTSH UW 77 22/10/21	2021年10月22日	(4, 386)	(4, 680)	(294)
USD	(58)	C CTSH UW 80 05/11/21	2021年11月5日	(9, 068)	(9, 164)	(96)
USD	(18)	C CVS UN 87 29/10/21	2021年10月29日	(2, 593)	(3, 816)	(1, 223)
USD	(20)	C CVS UN 89 08/10/21	2021年10月8日	(2, 515)	(1, 100)	1, 415
USD	(27, 000)	C DANOV UV 14.14 03/11/21 OTC	2021年11月3日	(8, 546)	(4, 063)	4, 483
USD	(26, 900)	C DANOV UV 14.28 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(7, 683)	(2, 367)	5, 316
USD	(23, 100)	C DANOV UV 14.766 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(6, 620)	(173)	6, 447
USD	(24, 500)	C DANOV UV 14.935 06/10/21 OTC	2021年10月6日	(6, 395)	(6)	6, 389
USD	(56)	C DLTR UW 100 19/11/21	2021年11月19日	(7, 155)	(15, 400)	(8, 245)
USD	(13)	C DLTR UW 90 19/11/21	2021年11月19日	(2, 336)	(10, 985)	(8, 649)
USD	(20)	C DLTR UW 93.35 22/10/21 FLEX	2021年10月22日	(3, 635)	(10, 854)	(7, 219)
AUD	(4, 893)	C DMP AT 129.2631 29/09/21 OTC	2021年9月29日	(9, 911)	(88, 309)	(78, 398)
AUD	(4, 102)	C DMP AT 152.252 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(8, 918)	(36, 521)	(27, 603)
EUR	(65, 554)	C ENI IM 10.3713 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(11, 562)	(88, 786)	(77, 224)
EUR	(67, 982)	C ENI IM 10.4425 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(7, 737)	(79, 998)	(72, 261)
EUR	(65, 554)	C ENI IM 10.7913 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(12, 268)	(66, 800)	(54, 532)
EUR	(65, 554)	C ENI IM 11.2315 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(4, 400)	(26, 327)	(21, 927)
USD	(103)	C EQH UN 30 15/10/21	2021年10月15日	(14, 808)	(11, 227)	3, 581
USD	(103)	C EQH UN 30 19/11/21	2021年11月19日	(12, 839)	(20, 188)	(7, 349)
USD	(63)	C EXC UW 48 15/10/21	2021年10月15日	(8, 670)	(6, 867)	1, 803
USD	(61)	C EXC UW 51.36 02/11/21 FLEX	2021年11月2日	(6, 635)	(1, 824)	4, 811
USD	(45)	C FB UW 360 05/11/21	2021年11月5日	(33, 669)	(31, 500)	2, 169
USD	(8)	C FB UW 366 11/11/21 FLEX	2021年11月11日	(6, 294)	(4, 216)	2, 078
USD	(6)	C FB UW 385 15/10/21	2021年10月15日	(4, 633)	(90)	4, 543
USD	(41)	C FISV UW 118 22/10/21	2021年10月22日	(5, 801)	(1, 353)	4, 448

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	(66)	C FISV UW 120 19/11/21	2021年11月19日	(8,480)	(10,362)	(1,882)
USD	(45)	C FLT UN 266.01 15/10/21 FLEX	2021年10月15日	(35,449)	(24,074)	11,375
AUD	(122)	C FMG AT 23 18/11/21	2021年11月18日	(8,281)	(44)	8,237
AUD	(24,612)	C FMG AT 23.9577 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(12,053)	(1)	12,052
AUD	(267)	C FMG AT 25.01 21/10/21	2021年10月21日	(8,712)	(19)	8,693
USD	(91)	C FNF UN 47 19/11/21	2021年11月19日	(14,812)	(11,375)	3,437
USD	(69)	C FNF UN 50 15/10/21	2021年10月15日	(7,367)	(345)	7,022
EUR	(8,107)	C FRE GY 44.8685 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,115)	(1,470)	645
EUR	(8,107)	C FRE GY 46.2645 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(6,007)	(4,726)	1,281
EUR	(8,407)	C FRE GY 48.7962 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(7,700)	(368)	7,332
EUR	(8,107)	C FRE GY 50.7253 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6,572)	(762)	5,810
USD	(170)	C GIL UN 38.8 15/10/21 FLEX	2021年10月15日	(22,060)	(10,330)	11,730
USD	(177)	C GIL UN 40 15/10/21	2021年10月15日	(16,476)	(1,947)	14,529
USD	(38)	C GM UN 52 22/10/21	2021年10月22日	(3,445)	(8,664)	(5,219)
USD	(81)	C GM UN 52.5 15/10/21	2021年10月15日	(8,810)	(15,390)	(6,580)
USD	(28)	C GM UN 53 01/10/21	2021年10月1日	(4,137)	(1,316)	2,821
USD	(7)	C GM UN 53 08/10/21	2021年10月8日	(656)	(854)	(198)
USD	(121)	C GM UN 53 29/10/21	2021年10月29日	(17,517)	(27,709)	(10,192)
AUD	(253)	C GMG AT 23.5 16/12/21	2021年12月16日	(5,133)	(6,018)	(885)
AUD	(24,897)	C GMG AT 23.7212 10/11/21 OTC	2021年11月10日	(6,962)	(2,205)	4,757
USD	(3)	C GOOGL UW 2855 05/11/21	2021年11月5日	(23,575)	(12,840)	10,735
USD	(4)	C GOOGL UW 2875 19/11/21	2021年11月19日	(20,050)	(17,920)	2,130
GBP	(32,276)	C GSK LN 14.76605 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(8,802)	(2,811)	5,991
GBP	(31,123)	C GSK LN 14.79223 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(10,401)	(7,460)	2,941
GBP	(31,123)	C GSK LN 14.93856 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3,294)	(1,552)	1,742
GBP	(31,123)	C GSK LN 15.74349 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(9,645)	(1,507)	8,138
EUR	(4,421)	C HEN GY 76.0822 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1,308)	(3,669)	(2,361)
EUR	(4,421)	C HEN GY 77.0261 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,147)	(8,311)	(3,164)
EUR	(4,421)	C HEN GY 81.3956 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(4,578)	(1,700)	2,878
EUR	(4,585)	C HEN GY 81.7499 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(4,190)	(297)	3,893
USD	(90)	C HHC UN 95 19/11/21	2021年11月19日	(18,812)	(17,910)	902
USD	(31)	C HII UN 203.32 11/10/21 FLEX	2021年10月11日	(15,710)	(3,051)	12,659
GBP	(85,368)	C HSBA LN 3.96423 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1,908)	(7,732)	(5,824)
GBP	(85,368)	C HSBA LN 4.08811 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,107)	(11,322)	(6,215)
GBP	(85,368)	C HSBA LN 4.28357 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(5,307)	(3,932)	1,375
GBP	(88,530)	C HSBA LN 4.31278 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(5,871)	(1,135)	4,736
GBP	(21,899)	C IMB LN 16.12797 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,053)	(3,032)	(979)
GBP	(21,899)	C IMB LN 16.19529 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,350)	(6,362)	(1,012)
GBP	(22,710)	C IMB LN 16.56393 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(5,884)	(1,468)	4,416
GBP	(21,899)	C IMB LN 16.98531 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(5,347)	(2,548)	2,799
EUR	(52,187)	C INGA NA 11.3215 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(10,994)	(62,154)	(51,160)
EUR	(50,324)	C INGA NA 11.9223 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3,643)	(30,764)	(27,121)
EUR	(50,324)	C INGA NA 12.1069 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(10,004)	(35,407)	(25,403)
EUR	(50,324)	C INGA NA 12.2643 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(10,389)	(35,532)	(25,143)
EUR	(143,875)	C ISP IM 2.3878 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,991)	(8,631)	(2,640)
EUR	(143,875)	C ISP IM 2.4353 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6,978)	(6,139)	839
EUR	(143,875)	C ISP IM 2.439 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,528)	(9,146)	(6,618)
EUR	(149,204)	C ISP IM 2.4584 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(6,814)	(8,264)	(1,450)
AUD	(13,351)	C JHX AT 49.1805 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(9,513)	(18,007)	(8,494)
AUD	(11,394)	C JHX AT 56.2872 03/11/21 OTC	2021年11月3日	(6,595)	(1,239)	5,356
USD	(46)	C KO UN 56 08/10/21	2021年10月8日	(3,899)	(184)	3,715
USD	(16)	C LEA UN 165 15/10/21	2021年10月15日	(2,090)	(2,400)	(310)
USD	(16)	C LEA UN 165 19/11/21	2021年11月19日	(6,007)	(10,560)	(4,553)
USD	(24)	C LH UN 300 19/11/21	2021年11月19日	(33,443)	(18,240)	15,203
USD	(20)	C LH UN 310 15/10/21	2021年10月15日	(14,616)	(960)	13,656
USD	(3,540)	C LKOD LI 92.99 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(4,509)	(15,472)	(10,963)
USD	(4,425)	C LKOD LI 95.07 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,137)	(10,528)	(5,391)

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, 425)	C LKOD LI 96.64 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2, 178)	(5, 029)	(2, 851)
AUD	(179, 189)	C MGR AT 3.3122 10/11/21 OTC	2021年11月10日	(5, 746)	(2, 133)	3, 613
USD	(14)	C MPC UN 57.5 15/10/21	2021年10月15日	(3, 413)	(7, 294)	(3, 881)
USD	(14)	C MPC UN 59 08/10/21	2021年10月8日	(2, 041)	(4, 732)	(2, 691)
USD	(21)	C MPC UN 61 22/10/21	2021年10月22日	(3, 292)	(5, 040)	(1, 748)
USD	(20)	C MPC UN 62 29/10/21	2021年10月29日	(2, 955)	(5, 320)	(2, 365)
USD	(31)	C MPC UN 62.5 19/11/21	2021年11月19日	(10, 471)	(9, 393)	1, 078
AUD	(4, 126)	C MQG AT 165.4892 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(6, 858)	(51, 158)	(44, 300)
AUD	(3, 882)	C MQG AT 172.146 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(4, 744)	(30, 309)	(25, 565)
USD	(31)	C MS UN 104 05/11/21	2021年11月5日	(5, 511)	(5, 580)	(69)
USD	(106)	C MS UN 105 15/10/21	2021年10月15日	(36, 863)	(9, 222)	27, 641
USD	(35)	C MSFT UW 295 15/10/21	2021年10月15日	(21, 722)	(7, 665)	14, 057
USD	(44)	C MSFT UW 300 19/11/21	2021年11月19日	(47, 932)	(22, 880)	25, 052
USD	(39)	C MSFT UW 305 05/11/21	2021年11月5日	(22, 182)	(11, 193)	10, 989
USD	(46)	C MSFT UW 305 08/10/21	2021年10月8日	(26, 551)	(828)	25, 723
USD	(23)	C MSFT UW 305 17/12/21	2021年12月17日	(12, 141)	(13, 110)	(969)
USD	(8)	C MSFT UW 305 22/10/21	2021年10月22日	(4, 264)	(880)	3, 384
AUD	(187)	C NAB AT 27 21/10/21	2021年10月21日	(5, 333)	(14, 087)	(8, 754)
AUD	(26, 021)	C NAB AT 27.1767 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(8, 377)	(18, 059)	(9, 682)
AUD	(27, 969)	C NAB AT 27.3184 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(10, 720)	(14, 154)	(3, 434)
AUD	(27, 368)	C NAB AT 27.5534 06/10/21 OTC	2021年10月6日	(8, 439)	(8, 192)	247
USD	(34)	C NI UN 26 15/10/21	2021年10月15日	(1, 828)	(170)	1, 658
USD	(159)	C NI UN 26 19/11/21	2021年11月19日	(2, 666)	(1, 590)	1, 076
AUD	(52, 764)	C NST AT 11.9621 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(10, 783)	(2)	10, 781
GBP	(162, 100)	C NWG LN 2.18373 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(7, 539)	(22, 045)	(14, 506)
GBP	(209, 456)	C NWG LN 2.27379 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3, 273)	(11, 980)	(8, 707)
GBP	(156, 310)	C NWG LN 2.30026 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(7, 620)	(19, 293)	(11, 673)
GBP	(156, 310)	C NWG LN 2.36336 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(7, 928)	(10, 420)	(2, 492)
USD	(66, 399)	C OGZD LI 8.46 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(7, 006)	(99, 121)	(92, 115)
USD	(64, 028)	C OGZD LI 8.58 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(8, 779)	(92, 222)	(83, 443)
USD	(64, 028)	C OGZD LI 9.65 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3, 682)	(28, 001)	(24, 319)
USD	(64, 028)	C OGZD LI 9.83 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(9, 675)	(36, 944)	(27, 269)
EUR	(37, 064)	C ORA FP 10.0726 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(4, 153)	(337)	3, 816
EUR	(35, 740)	C ORA FP 10.2378 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(4, 716)	(1, 272)	3, 444
EUR	(35, 740)	C ORA FP 9.7582 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1, 361)	(885)	476
EUR	(35, 740)	C ORA FP 9.8555 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(4, 549)	(4, 440)	109
AUD	(27, 369)	C OZL AT 24.048 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(16, 326)	(5, 661)	10, 665
AUD	(237)	C OZL AT 25.9 18/11/21	2021年11月18日	(6, 084)	(4, 954)	1, 130
AUD	(22, 994)	C OZL AT 26.6405 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(10, 738)	(1, 024)	9, 714
EUR	(129, 889)	C O2D GY 2.5659 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(6, 285)	(9, 783)	(3, 498)
EUR	(129, 889)	C O2D GY 2.6538 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6, 467)	(7, 039)	(572)
EUR	(134, 700)	C O2D GY 2.6788 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(5, 485)	(3, 248)	2, 237
USD	(67)	C PEG UN 65 15/10/21	2021年10月15日	(9, 431)	(670)	8, 761
GBP	(67, 724)	C PSON LN 7.7716 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3, 621)	(4, 614)	(993)
GBP	(67, 724)	C PSON LN 8.39727 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(9, 520)	(4, 915)	4, 605
GBP	(67, 724)	C PSON LN 8.52977 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(9, 446)	(3, 234)	6, 212
GBP	(70, 233)	C PSON LN 9.37863 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(14, 080)	(688)	13, 392
EUR	(15, 101)	C PUB FP 58.1398 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(14, 062)	(37, 471)	(23, 409)
EUR	(15, 660)	C PUB FP 59.9128 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(14, 140)	(12, 643)	1, 497
EUR	(15, 101)	C PUB FP 60.8944 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(15, 006)	(22, 995)	(7, 989)
AUD	(100, 772)	C QAN AT 5.2871 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(7, 445)	(30, 026)	(22, 581)
AUD	(515)	C QBE AT 12 18/11/21	2021年11月18日	(7, 137)	(12, 993)	(5, 856)
AUD	(3, 355)	C REA AT 170.8755 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(3, 604)	(299)	3, 305
EUR	(42, 070)	C REP SQ 10.5065 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(5, 456)	(35, 522)	(30, 066)
EUR	(40, 567)	C REP SQ 10.551 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(5, 993)	(38, 579)	(32, 586)
EUR	(40, 567)	C REP SQ 10.7407 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5, 217)	(35, 788)	(30, 571)
EUR	(40, 567)	C REP SQ 10.8412 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2, 134)	(21, 371)	(19, 237)

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	(66)	C RIO AT 111.12 16/12/21	2021年12月16日	(8,539)	(7,969)	570
AUD	(4,941)	C RIO AT 129.9026 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(8,702)	0	8,702
USD	(73)	C RL UN 120 15/10/21	2021年10月15日	(30,862)	(16,425)	14,437
USD	(22)	C ROST UW 116.51 05/11/21 FLEX	2021年11月5日	(7,761)	(4,971)	2,790
USD	(21)	C ROST UW 124 01/10/21	2021年10月1日	(7,955)	(2,625)	5,330
USD	(31)	C ROST UW 125 08/10/21	2021年10月8日	(5,880)	(6,200)	(320)
EUR	(9,791)	C RRTL GY 52.8255 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,591)	(3,414)	(823)
EUR	(4,664)	C RRTL GY 53.0198 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(3,783)	(1,719)	2,064
EUR	(6,323)	C RRTL GY 54.6842 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,807)	(4,503)	1,304
EUR	(7,367)	C RRTL GY 55.8668 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(6,729)	(1,800)	4,929
USD	(41)	C RTX UN 88 01/10/21	2021年10月1日	(7,534)	(943)	6,591
EUR	(9,790)	C SAN FP 86.9552 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(3,291)	(2,980)	311
EUR	(9,790)	C SAN FP 87.4617 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(12,800)	(14,449)	(1,649)
EUR	(10,934)	C SAN FP 92.333 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(15,867)	(570)	15,297
EUR	(9,790)	C SAN FP 94.459 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(15,572)	(1,615)	13,957
USD	(135)	C SNY UW 50 17/12/21	2021年12月17日	(16,253)	(16,200)	53
USD	(138)	C SNY UW 50 19/11/21	2021年11月19日	(12,526)	(13,110)	(584)
CHF	(9,563)	C SREN SE 83.9185 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,804)	(2,728)	76
CHF	(9,563)	C SREN SE 85.9764 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(11,455)	(7,893)	3,562
CHF	(9,917)	C SREN SE 88.1723 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(10,770)	(616)	10,154
CHF	(9,563)	C SREN SE 90.1832 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(12,018)	(1,683)	10,335
USD	(43)	C SSNC UW 75 19/11/21	2021年11月19日	(5,494)	(4,730)	764
USD	(4,200)	C SSNC UW 76.306 07/10/21 OTC	2021年10月7日	(6,600)	(3)	6,597
USD	(9,300)	C SSNC UW 77.565 06/10/21 OTC	2021年10月6日	(12,011)	0	12,011
GBP	(57,348)	C STAN LN 4.57073 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1,132)	(2,805)	(1,673)
GBP	(57,348)	C STAN LN 4.91348 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(4,019)	(3,752)	267
GBP	(59,472)	C STAN LN 4.94469 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(3,535)	(509)	3,026
GBP	(57,348)	C STAN LN 5.01737 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(4,027)	(1,410)	2,617
USD	(124)	C STLD UW 70 15/10/21	2021年10月15日	(37,472)	(1,736)	35,736
AUD	(1,011)	C STO AT 6.75 18/11/21	2021年11月18日	(7,100)	(45,184)	(38,084)
AUD	(938)	C STO AT 7.26 21/10/21	2021年10月21日	(7,470)	(12,509)	(5,039)
GBP	(82,831)	C S32 LN 1.9295 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1,272)	(3,041)	(1,769)
GBP	(305,714)	C TSCO LN 2.55621 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(15,421)	(24,990)	(9,569)
USD	(25)	C TSM UN 117 05/11/21	2021年11月5日	(4,325)	(4,350)	(25)
EUR	(27,014)	C UCG IM 11.3303 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(4,299)	(13,430)	(9,131)
EUR	(26,050)	C UCG IM 11.4128 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,020)	(10,790)	(8,770)
EUR	(26,050)	C UCG IM 11.5203 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(5,416)	(16,715)	(11,299)
EUR	(26,050)	C UCG IM 12.4994 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,633)	(9,569)	(3,936)
CHF	(1,211)	C UHR SE 279.2016 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(1,478)	(334)	1,144
CHF	(1,211)	C UHR SE 287.069 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(4,584)	(1,058)	3,526
CHF	(1,211)	C UHR SE 292.79 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(5,311)	(1,394)	3,917
CHF	(1,256)	C UHR SE 330.885 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(7,144)	(23)	7,121
USD	(55)	C UL UN 55 19/11/21	2021年11月19日	(8,127)	(7,700)	427
USD	(9,700)	C UL UN 57.9974 22/10/21 OTC	2021年10月22日	(11,922)	(740)	11,182
USD	(5,300)	C UL UN 58.25 12/10/21 OTC	2021年10月12日	(6,345)	(68)	6,277
USD	(263)	C VTRS UW 15 01/10/21	2021年10月1日	(11,774)	(1,052)	10,722
AUD	(28,208)	C WBC AT 25.91 29/12/21 OTC	2021年12月29日	(9,290)	(13,235)	(3,945)
AUD	(247)	C WBC AT 26 21/10/21	2021年10月21日	(8,008)	(8,457)	(449)
AUD	(26,555)	C WBC AT 26.9373 06/10/21 OTC	2021年10月6日	(8,914)	(237)	8,677
AUD	(23,754)	C WBC AT 27.1163 27/10/21 OTC	2021年10月27日	(4,994)	(2,106)	2,888
AUD	(24,560)	C WBC AT 27.2618 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(9,329)	(492)	8,837
AUD	(96,709)	C WEB AT 5.3773 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(14,019)	(67,419)	(53,400)
USD	(29)	C WFC UN 46 22/10/21	2021年10月22日	(3,009)	(6,235)	(3,226)
USD	(177)	C WFC UN 49.25 12/11/21 FLEX	2021年11月12日	(15,986)	(19,881)	(3,895)
USD	(94)	C WFC UN 50 15/10/21	2021年10月15日	(17,932)	(3,290)	14,642
USD	(15)	C WFC UN 50 19/11/21	2021年11月19日	(1,182)	(1,515)	(333)
USD	(168)	C WFC UN 51 05/11/21	2021年11月5日	(12,729)	(9,072)	3,657

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	(18,472)	C WOW AT 40.3866 20/10/21 OTC	2021年10月20日	(7,428)	(3,406)	4,022
AUD	(136)	C WOW AT 40.93 16/12/21	2021年12月16日	(6,281)	(6,568)	(287)
GBP	(41,763)	C WPP LN 10.24828 21/10/21 OTC	2021年10月21日	(9,298)	(4,172)	5,126
GBP	(40,272)	C WPP LN 10.40662 18/11/21 OTC	2021年11月18日	(7,209)	(7,603)	(394)
GBP	(40,272)	C WPP LN 10.44883 09/12/21 OTC	2021年12月9日	(8,143)	(9,713)	(1,570)
GBP	(40,272)	C WPP LN 9.91311 18/10/21 OTC	2021年10月18日	(2,368)	(8,332)	(5,964)
AUD	(16,331)	C WTC AT 38.102 13/10/21 OTC	2021年10月13日	(10,921)	(183,024)	(172,103)
AUD	(9,130)	C WTC AT 53.155 17/11/21 OTC	2021年11月17日	(8,864)	(22,124)	(13,260)
AUD	(11,322)	C WTC AT 53.2087 10/11/21 OTC	2021年11月10日	(7,697)	(25,366)	(17,669)
USD	(58)	C XRAY UW 62.5 15/10/21	2021年10月15日	(9,440)	(1,450)	7,990
USD	(65)	C XRAY UW 63.5 03/11/21 FLEX	2021年11月3日	(9,995)	(4,359)	5,636
USD	(39)	C ZBH UN 148.8 15/10/21 FLEX	2021年10月15日	(17,658)	(14,456)	3,202
USD	(17)	C ZBH UN 150 19/11/21	2021年11月19日	(6,762)	(10,880)	(4,118)
HKD	(2,200,000)	C 1398 HK 4.6107 05/10/21 OTC	2021年10月5日	(220)	(54)	166
JPY	(10,000)	C 6501 JT 7567.6334 04/10/21 OTC	2021年10月4日	(124)	0	124
JPY	(26,000)	C 7203 JT 2225.814 04/10/21 OTC	2021年10月4日	(97)	(1)	96
JPY	(12,000)	C 8058 JT 3709.68 01/10/21 OTC	2021年10月1日	(77)	0	77
JPY	(35,000)	C 8591 JT 2328.7 05/10/21 OTC	2021年10月5日	(66)	(7)	59
HKD	(2,600,000)	C 939 HK 5.8571 05/10/21 OTC	2021年10月5日	(260)	(444)	(184)
AUD	(321)	P AS51 6575 16/12/21	2021年12月16日	(176,261)	(137,448)	38,813
				(3,071,315)	(3,931,639)	(860,324)
				(2,742,259)	(3,681,966)	(939,707)

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年8月19日）

作成対象期間（2020年8月20日～2021年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		騰 落 率	中 率			
	円		%	%	%	百万円
15期(2017年 8 月21日)	10, 208	△0. 0		64. 0	—	17, 754
16期(2018年 8 月20日)	10, 206	△0. 0		38. 7	—	13, 511
17期(2019年 8 月19日)	10, 205	△0. 0		59. 3	—	8, 458
18期(2020年 8 月19日)	10, 203	△0. 0		68. 2	—	3, 175
19期(2021年 8 月19日)	10, 200	△0. 0		60. 1	—	9, 159

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

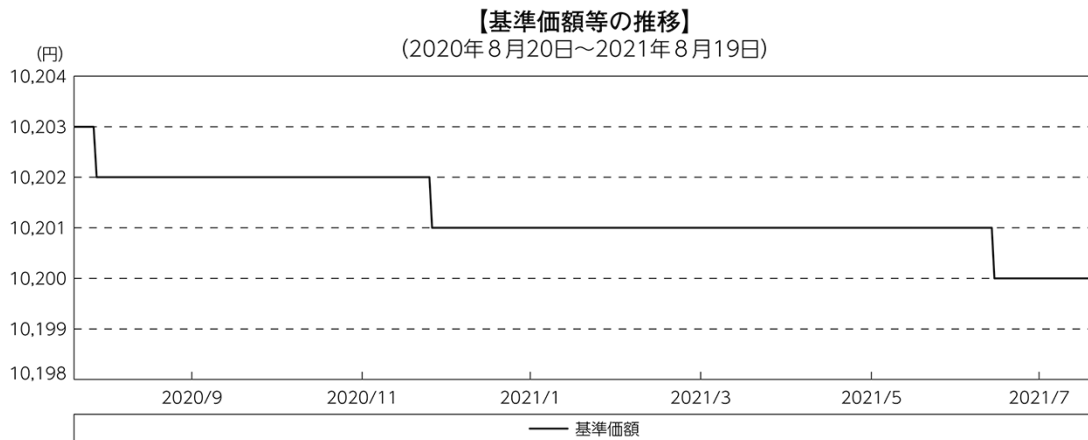
年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰 落 率	率			
(期 首) 2020年 8 月19日	円 10, 203		% —		% 68. 2	% —
8 月末	10, 202	△0. 0		58. 9	—	—
9 月末	10, 202	△0. 0		50. 4	—	—
10月末	10, 202	△0. 0		56. 6	—	—
11月末	10, 202	△0. 0		28. 3	—	—
12月末	10, 201	△0. 0		48. 3	—	—
2021年 1 月末	10, 201	△0. 0		58. 0	—	—
2 月末	10, 201	△0. 0		56. 6	—	—
3 月末	10, 201	△0. 0		53. 8	—	—
4 月末	10, 201	△0. 0		59. 8	—	—
5 月末	10, 201	△0. 0		58. 1	—	—
6 月末	10, 201	△0. 0		57. 9	—	—
7 月末	10, 200	△0. 0		55. 9	—	—
(期 末) 2021年 8 月19日	10, 200	△0. 0		60. 1	—	—

* 騰落率は期首比です。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

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

○投資環境

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

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

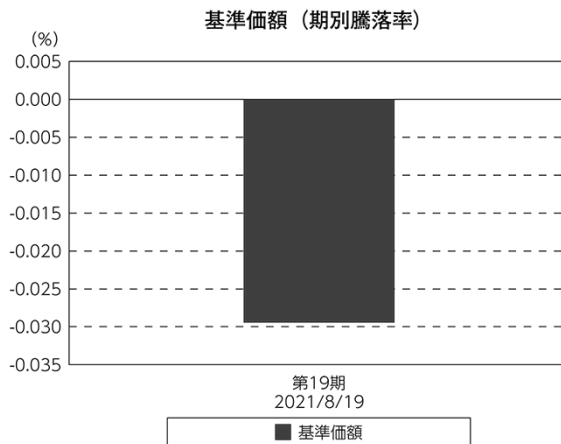
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 8 月20日～2021年 8 月19日)

該当事項はございません。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2020年 8 月20日～2021年 8 月19日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	地方債証券	千円 2, 933, 243	千円 — (2, 410, 000)
	特殊債券	7, 744, 464	— (6, 142, 000)
	社債券（投資法人債券を含む）	4, 656, 400	— (3, 416, 400)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)
*単位未満は切り捨て。
*（ ）内は償還等による増減分です。
*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

その他有価証券

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

*金額は受け渡し代金。
*単位未満は切り捨て。
*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年8月20日～2021年8月19日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2021年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

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

* () 内は非上場債で内書きです。
* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
* 金額の単位未満は切り捨て。
* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額
地方債証券		%	千円	千円
東京都	公募第702回	1. 04	100, 000	100, 353
大阪府	公募第354回	1. 03	100, 000	100, 201
共同発行市場地方債 公募第102回		1. 03	500, 000	500, 520
熊本県	公募平成23年度第 2 回	1. 0	340, 000	340, 645
広島市	公募平成23年度第 2 回	1. 0	200, 000	200, 380
広島市	公募平成23年度第 5 回	1. 01	60, 000	60, 319
小	計		1, 300, 000	1, 302, 420
特殊債券(除く金融債)				
政保	地方公共団体金融機構債券 (8 年) 第 2 回	0. 502	30, 000	30, 058
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第152回	1. 1	77, 000	77, 321
首都高速道路	第19回	0. 07	500, 000	500, 131
阪神高速道路	第19回	0. 02	460, 000	460, 073
成田国際空港	第11回	1. 067	100, 000	100, 534
小	計		1, 167, 000	1, 168, 119
金融債券				
商工債券	利付第802回い号	0. 06	30, 000	30, 002
しんきん中金債券	利付第321回	0. 03	150, 000	150, 002
しんきん中金債券	利付第322回	0. 03	450, 000	450, 018
商工債券	利付 (3 年) 第223回	0. 11	500, 000	500, 053
商工債券	利付 (3 年) 第224回	0. 11	100, 000	100, 013
小	計		1, 230, 000	1, 230, 089
普通社債券(含む投資法人債券)				
中部電力	第522回	0. 13	300, 000	300, 284
関西電力	第525回	0. 14	100, 000	100, 050
クレディセゾン	第53回社債間限定同順位特約付	0. 435	600, 000	600, 488
トヨタファイナンス	第66回社債間限定同順位特約付	0. 233	100, 000	100, 018
三菱UFJ リース	第43回社債間限定同順位特約付	0. 06	500, 000	500, 088
三井不動産	第44回社債間限定同順位特約付	1. 173	200, 000	200, 129
小	計		1, 800, 000	1, 801, 060
合	計		5, 497, 000	5, 501, 690

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	5,501,690	60.1
コール・ローン等、その他	3,657,462	39.9
投資信託財産総額	9,159,152	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年8月19日現在)

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

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

○損益の状況 (2020年8月20日～2021年8月19日)

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

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用)	2,690,621,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,977,425,742
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家販売制限付)	1,413,674,178
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	287,434,434
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	241,214,028
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	101,692,450
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投信	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
ネクストコア	2,282,012
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第12回 野村短期公社債ファンド	1,901,723
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース) 毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース) 毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース) 毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	984,834

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース) 毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース) 毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース) 毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース) 年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース) 毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース) 毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース) 年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース) 年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース) 年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース) 年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース) 年2回決算型	983,672
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投信 (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
野村日本ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルリアルコース) 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	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
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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (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
第7回 野村短期公社債ファンド	204,767
野村通貨選択日本株投信 (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 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信 (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 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンプルトン・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信 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型	41,054
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型	23,859
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	9,826
野村DCテンプレート・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプレート・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,809

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

〇お知らせ

該当事項はございません。